

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2023

Aperçu du portefeuille

| RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|---|----------------------------|
| Actions | 54,4 |
| Obligations | 40,3 |
| Obligations | 37,4 |
| Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)* | 3,0 |
| Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)* | (0,1) |
| Fonds/billets négociés en bourse | 2,3 |
| Placements à court terme | 1,2 |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 0,9 |
| Fonds privés | 0,6 |
| Fonds communs de placement | 0,3 |
| Options sur swaps achetées** | – |
| Options sur swaps vendues** | – |

| RÉPARTITION RÉGIONALE | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|-------------------------------------|----------------------------|
| États-Unis | 50,7 |
| Canada | 14,9 |
| Autre | 6,4 |
| Allemagne | 4,7 |
| France | 2,9 |
| Japon | 2,6 |
| Irlande | 2,3 |
| Nouvelle-Zélande | 2,3 |
| Mexique | 2,2 |
| Pays-Bas | 2,2 |
| Royaume-Uni | 1,9 |
| Brésil | 1,9 |
| Suisse | 1,9 |
| Australie | 1,3 |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 0,9 |
| Danemark | 0,9 |

| RÉPARTITION SECTORIELLE | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|---|----------------------------|
| Obligations d'État étrangères | 19,0 |
| Obligations de sociétés | 17,5 |
| Technologie de l'information | 11,0 |
| Services financiers | 9,3 |
| Soins de santé | 7,9 |
| Produits industriels | 5,9 |
| Consommation de base | 5,7 |
| Consommation discrétionnaire | 4,6 |
| Énergie | 3,7 |
| Matériaux | 3,4 |
| Fonds/billets négociés en bourse | 2,3 |
| Services de communication | 2,2 |
| Autre | 2,0 |
| Obligations fédérales | 1,4 |
| Obligations provinciales | 1,4 |
| Billets à escompte de gouvernements étrangers à court terme | 1,2 |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 0,9 |
| Fonds privés | 0,6 |

| OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT† | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|---------------------------------|----------------------------|
| AAA | 5,3 |
| AA | 10,1 |
| A | 3,9 |
| BBB | 9,2 |
| Inférieure à BBB | 5,7 |
| Sans note | 3,2 |

* Les valeurs théoriques représentent 2,9 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur) et –5,9 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

** Les valeurs théoriques représentent 3,6 % de la valeur liquidative des options sur swaps achetées et –0,6 % de la valeur liquidative des options sur swaps vendues.

† Les notes de crédit et les catégories de crédit sont basées sur les notes d'une agence de notation désignée.



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2023

| LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|---|----------------------------|
| Émetteur | |
| Obligations du Trésor des États-Unis 5,39 % 08-08-2024 | 3,1 |
| Microsoft Corp. | 2,7 |
| Obligations du Trésor des États-Unis 3,50 % 15-02-2033 | 2,3 |
| Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2031 | 1,8 |
| SAP AG | 1,5 |
| JPMorgan Chase & Co. | 1,4 |
| Broadcom Inc. | 1,4 |
| Amazon.com Inc. | 1,4 |
| Alphabet Inc. | 1,4 |
| Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 3,50 % 14-04-2033 | 1,3 |
| Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052 | 1,3 |
| Apple Inc. | 1,2 |
| Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2032 | 1,2 |
| Deutsche Börse AG | 1,2 |
| Gouvernement du Canada 3,50 % 01-03-2028 | 1,1 |
| Motorola Solutions Inc. | 1,0 |
| Shell PLC | 1,0 |
| Johnson & Johnson | 1,0 |
| Chevron Corp. | 1,0 |
| CME Group Inc. | 1,0 |
| Philip Morris International Inc. | 1,0 |
| Glencore PLC | 1,0 |
| AstraZeneca PLC | 1,0 |
| Roche Holding AG | 0,9 |
| AbbVie Inc. | 0,9 |
| Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale | 34,1 |

| LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|---|----------------------------|
| Émetteur | |
| Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans | (0,1) |
| Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente souscrite @ 93,00 \$ éch. 17-01-2024 | — |
| Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale | (0,1) |
| Valeur liquidative totale du Fonds | 2,1 milliards \$ |

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 31 décembre 2023 en raison des opérations de portefeuille continues du Fonds. Les mises à jour trimestrielles des titres sont disponibles dans les 60 jours suivant la fin de chaque trimestre, sauf pour le trimestre se terminant le 31 mars, date de clôture de l'exercice du Fonds, où elles sont disponibles dans les 90 jours.

