

FONDS DE REVENU FIXE SANS CONTRAINTES EN DOLLARS US MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2023

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	88,7
Obligations	88,5
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)*	0,3
Options achetées**	–
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)*	(0,1)
Autres éléments d'actif (de passif)	3,1
Fonds privés	3,0
Trésorerie et équivalents de trésorerie	2,2
Placements à court terme	1,8
Actions	1,1
Swaps†	0,1
Options sur swaps achetées††	–
Options sur swaps vendues††	–

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	45,2
Canada	36,6
Autres éléments d'actif (de passif)	3,1
Brésil	2,3
Mexique	2,3
Trésorerie et équivalents de trésorerie	2,2
Autre	2,0
Afrique du Sud	1,5
Allemagne	1,0
France	0,8
Nouvelle-Zélande	0,6
Luxembourg	0,5
Chine	0,4
Irlande	0,4
Australie	0,4
Colombie	0,4
Suisse	0,3

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	65,2
Obligations d'État étrangères	14,6
Obligations fédérales	4,5
Autres éléments d'actif (de passif)	3,1
Fonds privés	3,0
Trésorerie et équivalents de trésorerie	2,2
Prêts à terme	1,9
Billets à escompte de gouvernements étrangers à court terme	1,8
Services financiers	1,1
Obligations supranationales	1,0
Obligations provinciales	0,9
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,5
Autre	0,1
Obligations municipales	0,1

OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT§	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
AAA	5,7
AA	14,8
A	4,7
BBB	21,1
Inférieure à BBB	28,3
Sans note	6,2

* Les valeurs théoriques représentent 0,3 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur) et –11,4 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

** Les valeurs théoriques représentent 7,4 % de la valeur liquidative des options achetées.

† Les valeurs théoriques représentent 4,0 % de la valeur liquidative des swaps.

†† Les valeurs théoriques représentent 19,1 % de la valeur liquidative des options sur swaps achetées et –7,1 % 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. Ce tableau présente uniquement les obligations détenues directement par le Fonds.

La répartition effective présente l'exposition du Fonds par portefeuille, région ou secteur calculée en combinant les placements directs et indirects du Fonds.



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU FIXE SANS CONTRAINTES EN DOLLARS US MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2023

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR

	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur/Fonds sous-jacent	
FINB Obligations toutes sociétés canadiennes Mackenzie	3,0
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-07-2024	2,4
Trésorerie et équivalents de trésorerie	2,2
Northleaf Private Credit II LP ¹⁾	2,0
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,50 % 15-04-2024	1,8
FINB Obligations à court terme canadiennes Mackenzie	1,8
Obligations du Trésor des États-Unis 5,44 % 05-09-2024	1,8
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052	1,7
Gouvernement de l'Afrique du Sud 8,88 % 28-02-2035	1,5
Microsoft Corp. 2,53 % 01-06-2050	1,2
Gouvernement du Brésil 6,25 % 18-03-2031	1,1
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2027	1,1
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	1,1
FINB Obligations de marchés émergents Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,1
Banque Royale du Canada, taux variable 24-11-2081	1,0
Sagard Credit Partners II LP ¹⁾	1,0
Société Financière Internationale 7,75 % 18-01-2030	1,0
Enbridge Inc., taux variable 15-01-2084	0,9
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	0,9
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2032	0,9
Obligations du Trésor des États-Unis 3,50 % 15-02-2033	0,9
Gouvernement de l'Allemagne 0 % 15-08-2052	0,9
Gouvernement du Mexique 8,50 % 31-05-2029	0,9
Altice France SA 5,13 % 15-07-2029	0,8
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2082	0,8

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **33,8**

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 @ 97,00 \$ éch. 21-02-2024	–
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 **18,6 millions \$ US**

1) L'émetteur de ce titre est lié au gestionnaire.

Pour le prospectus et d'autres renseignements concernant le ou les fonds sous-jacents du portefeuille, veuillez consulter les adresses suivantes : www.placementsmackenzie.com ou www.sedarplus.ca.

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.



MACKENZIE
Placements