

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2024

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	100,7
Obligations	95,4
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)*	5,3
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)*	–
Fonds privés	1,0
Autres éléments d'actif (de passif)	0,5
Actions	0,3
Options sur swaps achetées**	–
Options sur swaps vendues**	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(2,5)

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	80,0
États-Unis	16,6
Mexique	1,6
Royaume-Uni	1,1
Autre	0,6
Autres éléments d'actif (de passif)	0,5
Australie	0,5
Irlande	0,3
Brésil	0,3
Luxembourg	0,2
France	0,2
Bahamas	0,2
Chine	0,1
Allemagne	0,1
Japon	0,1
Chili	0,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(2,5)

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	62,3
Obligations provinciales	16,0
Obligations fédérales	11,3
Obligations d'État étrangères	10,1
Fonds privés	1,0
Autres éléments d'actif (de passif)	0,5
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,4
Services financiers	0,3
Prêts à terme	0,3
Obligations supranationales	0,2
Obligations municipales	0,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(2,5)

OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT†	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
AAA	7,5
AA	19,1
A	24,6
BBB	26,4
Inférieure à BBB	4,4
Sans note	8,8

* Les valeurs théoriques représentent 5,3 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur) et –3,0 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

** Les valeurs théoriques représentent 50,2 % de la valeur liquidative des options sur swaps achetées et –17,8 % 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 D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 30 juin 2024

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur/Fonds sous-jacent	
Province de l'Ontario 4,15 % 02-06-2034	6,9
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-12-2055	3,7
Province de Québec 4,40 % 01-12-2055	3,1
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,12 % 15-04-2025	2,7
Obligations du Trésor des États-Unis 4,63 % 15-05-2054	2,2
Province de l'Alberta 3,10 % 01-06-2050	2,1
Province de Québec 4,45 % 01-09-2034	2,1
Fonds à rendement absolu de titres de créance Mackenzie, série R	2,0
Trésorerie et placements à court terme	2,0
Obligations du Trésor des États-Unis 4,25 % 15-02-2054	1,5
Gouvernement du Mexique 7,75 % 23-11-2034	1,3
TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027	1,3
Rogers Communications Inc., taux variable 17-12-2081	1,1
Province de l'Ontario 4,15 % 02-12-2054	1,1
Fonds de titres à revenu fixe de sociétés mondiales Mackenzie, série R	1,0
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	1,0
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	1,0
FINB Obligations à long terme du gouvernement canadien Mackenzie	0,9
Gouvernement du Canada 0,50 % 01-12-2050	0,7
British Columbia Investment Management 4,90 % 02-06-2033	0,7
Northleaf Private Credit II LP ¹⁾	0,7
Brookfield Renewable Energy Partners ULC 3,63 % 15-01-2027, rachetables 2026	0,7
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052	0,6
Province de l'Ontario 4,05 % 02-02-2032	0,6
Financière Sun Life inc., taux variable 13-08-2029, rachetables 2024	0,6
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	41,6

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente @ 95,00 \$ éch. 17-07-2024	—
Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente @ 95,00 \$ éch. 17-07-2024 A	—
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans	—
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	—
Valeur liquidative totale du Fonds	329,0 millions \$

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 30 juin 2024 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