

FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2024

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	98,0
Obligations	97,8
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)*	0,2
Options achetées**	–
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)*	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,4
Autres éléments d'actif (de passif)	0,6
Actions	–
Actions	–
Options achetées†	–
Options sur swaps achetées††	–
Options sur swaps vendues††	–

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	81,7
États-Unis	10,9
Nouvelle-Zélande	3,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,4
Royaume-Uni	1,2
Autres éléments d'actif (de passif)	0,6
Australie	0,4
Allemagne	0,3
Chili	0,2
Mexique	0,1
Autre	0,1

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	49,9
Obligations provinciales	26,1
Obligations fédérales	13,2
Obligations d'État étrangères	8,5
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,4
Autres éléments d'actif (de passif)	0,6
Obligations municipales	0,2
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,1

OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT [§]	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
AAA	16,1
AA	27,2
A	15,6
BBB	23,1
Sans note	9,9

* Les valeurs théoriques représentent 0,2 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur) et –1,6 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

** Les valeurs théoriques représentent 0,1 % de la valeur liquidative des options achetées.

† Les valeurs théoriques représentent 2,6 % de la valeur liquidative des options achetées.

†† Les valeurs théoriques représentent 21,0 % de la valeur liquidative des options sur swaps achetées et –22,0 % 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 CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2024

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur/Fonds sous-jacent	
Gouvernement du Canada 3,00 % 01-06-2034	4,1
Province de l'Ontario 4,15 % 02-06-2034	4,1
Province de Québec 4,40 % 01-12-2055	3,4
Province de l'Ontario 3,80 % 02-12-2034	3,3
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,12 % 15-04-2025	3,0
FINB Obligations canadiennes totales Mackenzie	2,7
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-12-2055	2,4
Province de Québec 4,45 % 01-09-2034	2,2
Gouvernement du Canada 3,25 % 01-12-2034	2,1
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 2,13 % 15-02-2054	2,0
Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 3,50 % 14-04-2033	1,7
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,6
Province de l'Alberta 3,10 % 01-06-2050	1,4
Province de l'Ontario 4,60 % 02-12-2055	1,3
FINB Obligations toutes sociétés canadiennes Mackenzie	1,1
Province de Québec 4,20 % 01-12-2057	1,0
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	1,0
FINB Obligations à long terme du gouvernement canadien Mackenzie	0,9
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-06-2033	0,9
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	0,9
Province de l'Ontario 2,65 % 02-12-2050	0,8
Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 2,00 % 15-04-2037	0,8
TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027	0,7
Province de l'Ontario 4,05 % 02-02-2032	0,7
Gouvernement du Canada 3,50 % 01-03-2034	0,6
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	44,7

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente souscrite @ 75,00 \$ éch. 19-03-2025	—
Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente souscrite @ 72,50 \$ éch. 19-02-2025	—
Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente souscrite @ 75,00 \$ éch. 15-01-2025	—
Contrats à terme standardisés à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME	—
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	—
Valeur liquidative totale du Fonds	1,2 milliard \$

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 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