

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2024

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	91,2
Obligations	91,2
Options achetées*	–
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)**	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie	3,4
Fonds communs de placement	1,9
Fonds/billets négociés en bourse	1,7
Fonds privés	1,0
Autres éléments d'actif (de passif)	0,6
Actions	0,2
Actions	0,2
Options achetées†	–
Options sur swaps achetées††	–
Options sur swaps vendues††	–

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	79,1
États-Unis	11,2
Trésorerie et équivalents de trésorerie	3,4
Nouvelle-Zélande	3,0
Royaume-Uni	1,0
Autres éléments d'actif (de passif)	0,6
Australie	0,4
Allemagne	0,3
Brésil	0,2
Bahamas	0,2
France	0,2
Mexique	0,1
Chine	0,1
Chili	0,1
Luxembourg	0,1

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	50,1
Obligations provinciales	22,9
Obligations fédérales	9,2
Obligations d'État étrangères	8,6
Trésorerie et équivalents de trésorerie	3,4
Fonds communs de placement	1,9
Fonds/billets négociés en bourse	1,7
Fonds privés	1,0
Autres éléments d'actif (de passif)	0,6
Services financiers	0,2
Obligations supranationales	0,2
Obligations municipales	0,1
Prêts à terme	0,1

OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT§	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
AAA	13,1
AA	26,0
A	13,1
BBB	24,9
Inférieure à BBB	4,7
Sans note	9,4

* Les valeurs théoriques représentent 0,2 % de la valeur liquidative des options achetées.

** Les valeurs théoriques représentent –1,5 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

† Les valeurs théoriques représentent 3,9 % de la valeur liquidative des options achetées.

†† Les valeurs théoriques représentent 31,0 % de la valeur liquidative des options sur swaps achetées et –32,1 % 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.



MACKENZIE
Placements

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE 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 2,75 % 01-12-2055	5,0
Province de l'Ontario 4,15 % 02-06-2034	3,7
Trésorerie et équivalents de trésorerie	3,4
Province de Québec 4,40 % 01-12-2055	3,2
Province de l'Ontario 3,80 % 02-12-2034	3,0
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,12 % 15-04-2025	2,7
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 2,13 % 15-02-2054	2,4
Province de Québec 4,45 % 01-09-2034	2,0
Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 3,50 % 14-04-2033	1,7
Province de Québec 4,20 % 01-12-2057	1,4
Province de l'Alberta 3,10 % 01-06-2050	1,3
Rogers Communications Inc., taux variable 17-12-2081	1,3
TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027	1,2
Gouvernement du Canada 3,25 % 01-12-2034	1,2
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	1,2
Province de l'Ontario 4,60 % 02-12-2055	1,2
Gouvernement du Canada 3,00 % 01-06-2034	1,1
Fonds de titres à revenu fixe de sociétés mondiales Mackenzie, série R	1,0
Fonds de titres à taux variable de qualité Mackenzie, série R	1,0
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	0,9
FINB Obligations à long terme du gouvernement canadien Mackenzie	0,8
Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 2,00 % 15-04-2037	0,8
Province de l'Ontario 2,65 % 02-12-2050	0,8
Banque Royale du Canada, taux variable 24-11-2080, rachetables 2025	0,7
Brookfield Renewable Energy Partners ULC 3,63 % 15-01-2027, rachetables 2026	0,7
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	43,7

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	350,9 millions \$

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