

FNB DE REVENU FIXE CANADIEN DE BASE PLUS MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2024

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	94,6
Obligations	94,5
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)*	0,1
Options achetées**	–
Fonds/billets négociés en bourse	2,6
Trésorerie et équivalents de trésorerie	2,1
Autres éléments d'actif (de passif)	0,5
Actions	0,2
Actions	0,1
Options achetées†	0,1
Options sur swaps achetées††	–
Options sur swaps vendues††	–

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	83,5
États-Unis	9,3
Nouvelle-Zélande	2,8
Trésorerie et équivalents de trésorerie	2,1
Royaume-Uni	1,1
Autres éléments d'actif (de passif)	0,5
Brésil	0,1
France	0,1
Australie	0,1
Mexique	0,1
Chili	0,1
Bahamas	0,1
Autre	0,1

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	50,8
Obligations provinciales	24,2
Obligations fédérales	11,2
Obligations d'État étrangères	8,4
Fonds/billets négociés en bourse	2,6
Trésorerie et équivalents de trésorerie	2,1
Autres éléments d'actif (de passif)	0,5
Autre	0,2

OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT§	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
AAA	15,1
AA	27,3
A	12,8
BBB	24,7
Inférieure à BBB	5,5
Sans note	9,1

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

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

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

†† Les valeurs théoriques représentent 31,3 % de la valeur liquidative des options sur swaps achetées et –32,2 % 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

FNB DE REVENU FIXE CANADIEN DE BASE PLUS MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2024

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur/Fonds sous-jacent	
Province de l'Ontario 4,15 % 02-06-2034	4,6
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-12-2055	4,2
Province de l'Ontario 3,80 % 02-12-2034	3,3
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	2,8
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 2,13 % 15-02-2054	2,4
Trésorerie et équivalents de trésorerie	2,1
Province de l'Ontario 4,60 % 02-12-2055	2,0
Gouvernement du Canada 3,00 % 01-06-2034	1,8
FINB Obligations canadiennes totales Mackenzie	1,6
Province de Québec 4,45 % 01-09-2034	1,6
Gouvernement du Canada 3,25 % 01-12-2034	1,6
Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 3,50 % 14-04-2033, REGS	1,6
Rogers Communications Inc., taux variable 17-12-2081	1,4
TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027	1,3
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	1,2
Province de Québec 4,20 % 01-12-2057	1,2
Province de l'Ontario 4,15 % 02-12-2054	1,1
Province de l'Alberta 3,10 % 01-06-2050	1,0
Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 2,00 % 15-04-2037	0,8
Province de l'Ontario 4,05 % 02-02-2032	0,7
Banque Royale du Canada, taux variable 24-11-2080, rachetables 2025	0,6
Brookfield Renewable Energy Partners ULC 3,63 % 15-01-2027, rachetables 2026	0,6
Province de l'Ontario 2,65 % 02-12-2050	0,6
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2080	0,6
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	43,8

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 2	—
Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente souscrite @ 75,00 \$ éch. 15-01-2025 B	—
Contrats à terme standardisés à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME	0,1
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	0,1
Valeur liquidative totale du FNB	783,5 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 FNB. 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 FNB, où elles sont disponibles dans les 90 jours.



MACKENZIE
Placements