

FONDS DE REVENU FIXE SANS CONTRAINTES EN DOLLARS US MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2024

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	87,4
Obligations	87,2
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)*	0,2
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)*	–
Options achetées**	–
Options vendues**	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie	5,3
Fonds privés	2,9
Placements à court terme	2,0
Actions	1,3
Autres éléments d'actif (de passif)	1,0
Swaps†	0,1
Options sur swaps achetées††	–
Options sur swaps vendues††	–

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	41,7
Canada	34,0
Trésorerie et équivalents de trésorerie	5,3
Mexique	4,7
Bésil	3,1
Allemagne	2,9
Afrique du Sud	1,6
Nouvelle-Zélande	1,4
Autre	1,2
Autres éléments d'actif (de passif)	1,0
France	0,8
Luxembourg	0,6
Chine	0,5
Irlande	0,4
Bahamas	0,3
Suisse	0,3
Italie	0,2

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	63,0
Obligations d'État étrangères	18,9
Trésorerie et équivalents de trésorerie	5,3
Fonds privés	2,9
Prêts à terme	2,3
Billets à escompte de gouvernements étrangers à court terme	2,0
Obligations supranationales	1,4
Services financiers	1,1
Autres éléments d'actif (de passif)	1,0
Obligations fédérales	1,0
Obligations provinciales	0,4
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,3
Énergie	0,2
Obligations municipales	0,1
Autre	0,1

OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT§	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
AAA	5,4
AA	10,9
A	4,5
BBB	23,4
Inférieure à BBB	29,4
Sans note	8,7

* Les valeurs théoriques représentent 0,2 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur) et –5,1 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

** Les valeurs théoriques représentent 1,7 % de la valeur liquidative des options achetées et –1,6 % de la valeur liquidative des options vendues.

† Les valeurs théoriques représentent 4,1 % de la valeur liquidative des swaps.

†† Les valeurs théoriques représentent 53,9 % de la valeur liquidative des options sur swaps achetées et –62,0 % 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 DE REVENU FIXE SANS CONTRAINTES EN DOLLARS US MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 30 juin 2024

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur/Fonds sous-jacent	
Trésorerie et équivalents de trésorerie	5,4
FINB Obligations toutes sociétés canadiennes Mackenzie	2,1
Northleaf Private Credit II LP ¹⁾	2,0
Obligations du Trésor des États-Unis 5,44 % 05-09-2024	2,0
Obligation fédérale 2,10 % 12-04-2029	1,9
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	1,6
Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 4,25 % 15-05-2034	1,4
Gouvernement du Mexique 7,75 % 23-11-2034	1,3
Gouvernement du Mexique 8,50 % 01-03-2029	1,2
Gouvernement du Brésil 6,25 % 18-03-2031	1,1
Enbridge Inc., taux variable 15-01-2084, rachetables 2033	1,0
Fonds de titres à revenu fixe de sociétés mondiales Mackenzie, série R	1,0
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2027	1,0
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2032	1,0
Sagard Credit Partners II LP ¹⁾	0,9
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	0,9
Société Financière Internationale 7,75 % 18-01-2030	0,9
Obligations du Trésor des États-Unis 3,50 % 15-02-2033	0,9
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2031	0,9
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	0,9
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2082	0,8
Gouvernement de l'Allemagne 0 % 15-08-2052	0,8
Gouvernement du Mexique 8,50 % 31-05-2029	0,8
Obligations du Trésor des États-Unis 2,75 % 15-08-2032	0,8
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	34,3

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente souscrite @ 80,00 \$ éch. 18-09-2024 B	—
Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente souscrite @ 80,00 \$ éch. 18-09-2024	—
Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente souscrite @ 85,00 \$ éch. 21-08-2024	—
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF, option de vente souscrite @ 69,00 \$ éch. 19-07-2024	—
Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente souscrite @ 72,50 \$ éch. 17-07-2024	—
Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente souscrite @ 98,00 \$ éch. 17-07-2024	—
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	17,5 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 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