

Fonds de revenu à taux variable Mackenzie Série F

Revenu fixe et marché monétaire

Rendement annualisé composé[‡] 31/05/2024

| | |
|--------------------------------|--------|
| 1 mois | 1,0 % |
| 3 mois | 2,2 % |
| Année à ce jour | 4,3 % |
| 1 an | 11,1 % |
| 2 ans | 6,4 % |
| 3 ans | 3,7 % |
| 5 ans | 2,9 % |
| 10 ans | 3,7 % |
| Depuis le lancement (mai 2013) | 4,1 % |

Répartition régionale 30/04/2024

TRÉSORERIE ET ÉQUIVALENTS DE TRÉSORERIE

| | |
|---------------------------|--------|
| Trésorerie et équivalents | -0,5 % |
|---------------------------|--------|

GLOBALEMENT

| | |
|-------------|--------|
| États-Unis | 75,5 % |
| Canada | 11,3 % |
| Pays-Bas | 4,5 % |
| Luxembourg | 2,5 % |
| Royaume-Uni | 1,9 % |
| Espagne | 1,3 % |
| Allemagne | 1,1 % |
| Australie | 1,0 % |
| France | 0,6 % |
| Autres | 0,8 % |

Répartition sectorielle 30/04/2024

| | | | |
|-------------------------|--------|---|--------|
| Prêts bancaires | 87,9 % | SICAV et OPC | 0,3 % |
| Obligations de sociétés | 7,3 % | Titres adossés à des créances hypothécaires | 0,3 % |
| Actions | 2,7 % | Trésorerie et équivalents | -0,5 % |

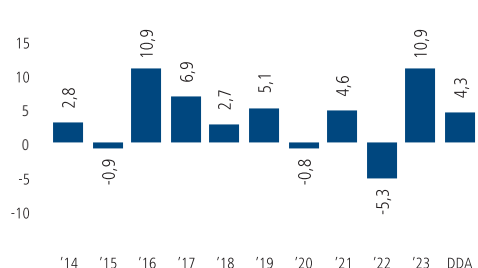
Répartition par cote**** 31/05/2024

| | | | |
|-----|--------|---------------------------|--------|
| AAA | 2,0 % | B | 47,1 % |
| AA | 0,0 % | CCC et moins | 9,2 % |
| A | 0,0 % | Oblig. non évaluées | 17,5 % |
| BBB | 3,4 % | Trésorerie et équivalents | 2,8 % |
| BB | 15,4 % | Actions | 2,6 % |

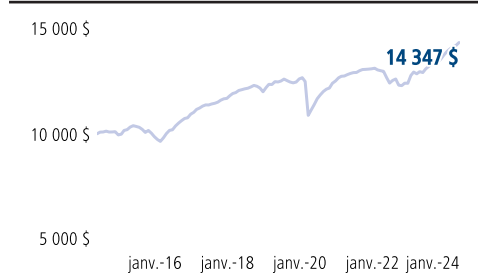
Gestionnaires de portefeuille

Équipe des placements à revenu fixe Mackenzie
Konstantin Boehmer, Dan Cooper, Movin Mokbel

Rendement pour l'année civile (%) 31/05/2024



Valeur d'un placement de 10 000 \$ 31/05/2024



Principaux titres*** 30/04/2024

Les principaux titres représentent 13,1 % du fonds

ACTIONS

| | |
|---|-------|
| Northleaf Private Credit II LP MI 15 | 1,2 % |
| TITRES À REVENU FIXE | |
| Société canadienne d'hypothèques et de logement, taux variable 15-09-2026 | 2,0 % |
| Hunter Douglas Inc., prêt à terme B 1 ^{er} rang, taux var. 25-02-2029 | 1,6 % |
| Restaurant Brands, prêt à terme 1 ^{er} rang, taux variable 12-09-2030 | 1,4 % |
| Timber Servicios Empresariales SA, prêt à terme B 1 ^{er} rang, taux variable | 1,3 % |
| Jadex Inc., prêt à terme 1 ^{er} rang, taux variable | 1,3 % |
| OpenMarket Inc., prêt à terme de 1 ^{er} rang 17-09-2026 | 1,2 % |
| KP Germany Erste GmbH, prêt à terme B 1 ^{er} rang, taux variable 04-02-2026 | 1,1 % |
| Upfield USA Corp. prêt à terme B 1 ^{er} rang, taux variable 02-01-2028 | 1,1 % |
| Specialty Pharma III Inc. prêt à terme B de 1 ^{er} rang | 1,0 % |

NOMBRE TOTAL DE PLACEMENTS EN ACTIONS : 18

NOMBRE TOTAL DE PLACEMENTS EN TITRES À REVENU FIXE : 259

Évaluation du risque du fonds (3 ans) 31/05/2024

| | | | |
|------------------------------|-------|-----------------|------|
| Écart-type ann. | 3,64 | Bêta | 0,88 |
| Écart-type ann. ind. de réf. | 3,83 | R-carré | 0,87 |
| Alpha | -1,75 | Ratio de Sharpe | 0,20 |

Source : Placements Mackenzie

Données clés sur le fonds

Actif total du fonds : 493,7 millions \$

Valeur liquidative par titre (31/05/2024) : 8,13 \$CA 5,96 \$US

RFG (ausept. 2023) : F : 0,90 % A : 1,98 %

Frais de gestion : F : 0,65 % A : 1,55 %

Duration (30/04/2024) : 0,4 an(s)

Rendement à l'échéance (30/04/2024) : 10,4 %

Indice de référence** : **Indice Morningstar LSTA Leveraged Loan (couvert en \$ CA)**

Qualité de crédit moyenne (30/04/2024) : **B+**

Dernière distribution :

| SÉRIE | FRÉQUENCE | MONTANT | DATE |
|-------|-----------|---------|-----------|
| F | Mensuelle | 0,0864 | 5/24/2024 |
| A | Mensuelle | 0,0782 | 5/24/2024 |
| FB | Mensuelle | 0,0872 | 5/24/2024 |
| PW | Mensuelle | 0,0812 | 5/24/2024 |
| PWFB | Mensuelle | 0,0857 | 5/24/2024 |

Codes du fonds :

| SÉRIE (\$ CA) | PRÉFIXE | FA | FR * | FM2 * | FM3 * |
|---------------|---------|------|------|-------|-------|
| F | MFC | 4328 | — | — | — |
| A | MFC | — | 4324 | 7210 | 4325 |
| FB | MFC | 4978 | — | — | — |
| PW | MFC | 6139 | — | — | — |
| PWFB | MFC | 6851 | — | — | — |

D'autres séries de fonds sont disponibles à l'adresse placementsmackenzie.com/codesdefonds

Pourquoi investir dans ce fonds?

- Les prêts à taux variable offrent des rendements plus élevés que d'autres actifs à taux fixe à court terme.
- Les prêts à a taux variable sont d'ordinaire moins sensibles aux fluctuations des taux d'intérêt que les obligations à taux fixe.
- Dans un contexte de hausse des taux d'intérêt, l'intérêt versé sur ces instruments pourrait aussi augmenter.
- La capacité d'investir dans des obligations à taux variable et dans des obligations de sociétés à rendement élevé accroît la liquidité.
- Permet d'accéder à la catégorie d'actif des prêts à taux variable que les particuliers peuvent difficilement souscrire.

Tolérance au risque

FAIBLE MOYENNE ÉLEVÉE



* Depuis le 1^{er} juin 2022, le mode de souscription avec frais de rachat et le mode de souscription avec frais modérés ne seront plus offerts pour l'achat de titres, y compris les achats faits au moyen d'un programme systématique comme un programme de prélèvements préautorisés. Il demeurera possible d'échanger des titres d'un fonds Mackenzie acquis selon le mode de souscription avec frais de rachat ou avec frais modérés pour des titres d'un autre fonds Mackenzie selon le même mode de souscription, jusqu'à l'expiration du barème applicable des frais de rachat.

** L'indice Morningstar LSTA Leveraged Loan (couvert en \$ CA) est un indice général qui vise à refléter le rendement des facilités de crédit en dollars américains sur le marché des prêts à effet de levier. L'exposition aux devises est couverte en dollars canadiens.

*** Les principaux titres en portefeuille de ce fonds peuvent, mais non nécessairement, représenter les plus importants titres du fonds. Plutôt, les principaux titres sont sélectionnés pour leur signification générale dans l'évaluation du portefeuille de placement.

**** Les notes de crédit et les catégories de crédit sont basées sur les notes d'une agence de notation désignée.

‡ Les placements dans les fonds communs peuvent donner lieu à des commissions de vente et de suivi, ainsi qu'à des frais de gestion et autres. Veuillez lire le prospectus avant d'investir. Les taux de rendement indiqués représentent le rendement annuel composé historique total au 31 mai 2024, y compris les variations de la valeur des parts et le réinvestissement de les distributions, et ne tiennent pas compte des frais d'acquisition, de rachat, de distribution ou facultatifs ni des impôts sur le revenu payables par tout(e) porteur ou porteuse de titres et qui auraient réduit le rendement. Les fonds communs ne sont pas des placements garantis, leur valeur varie fréquemment et leur rendement antérieur peut ne pas se reproduire. L'écart-type permet de mesurer la variabilité des rendements obtenus relativement au rendement moyen. Plus l'écart-type est élevé, plus l'éventail des rendements obtenus est vaste. L'écart-type est généralement utilisé comme mesure du risque.