

# FINB OBLIGATIONS AMÉRICAINES À RENDEMENT ÉLEVÉ MACKENZIE (COUVERT EN \$ CA)

## Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2023

### Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	47,0
Trésorerie et équivalents de trésorerie	39,4
Autres éléments d'actif (de passif)	12,1
Swaps*	0,8
Actions	0,7

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Trésorerie et équivalents de trésorerie	39,4
Canada	27,0
Autres éléments d'actif (de passif)	12,1
France	9,8
États-Unis	5,0
Japon	4,0
Suède	1,9
Autre	0,8

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés – Services financiers	47,0
Trésorerie et équivalents de trésorerie	39,4
Autres éléments d'actif (de passif)	12,1
Autre	0,8
Technologie de l'information	0,5
Consommation discrétionnaire	0,1
Services de communication	0,1

\* Les valeurs théoriques représentent 87,8 % de la valeur liquidative des swaps.

### LES 25 PRINCIPALES POSITIONS % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

Émetteur	
Trésorerie et équivalents de trésorerie	39,4
Banque de Montréal, taux variable 12-08-2023	9,0
Banque Royale du Canada, taux variable 05-10-2023	8,0
Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, taux variable 20-07-2023	5,0
Banque de Montréal, taux variable 09-07-2024	5,0
Banque Fédérative du Crédit Mutuel 3,75 % 20-07-2023	4,8
Morgan Stanley, taux variable 10-11-2023	4,3
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc., taux variable 16-10-2023	3,3
Banque de Montréal 0,40 % 15-09-2023	3,3
Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0,55 % 01-09-2023	1,9
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 15-09-2023	1,7
Swap sur rendement total sur HYG éch. 01-09-2023	0,6
GTT Communications Inc.	0,5
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. 3,76 % 26-07-2023	0,4
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. 2,53 % 13-09-2023	0,2
Swap sur rendement total sur HYG éch. 05-07-2023	0,1
Swap sur rendement total sur HYG éch. 08-09-2023	0,1
NMG Parent LLC	0,1
MYT Holding Co.	–
MYT Holding LLC	–
Endo Finance LLC 6,00 % 30-06-2028	–
The Hertz Corp. 7,13 % 01-08-2026, rachetables 2022	–
The Hertz Corp. 5,50 % 15-10-2024, rachetables 2021	–
Mallinckrodt PLC	–
Earthstone Energy Inc.	–

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **87,7**

Valeur liquidative totale du FNB **39,7 millions \$**

Le FNB ne détenait aucune position vendeur à la clôture de la période.

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 30 juin 2023 en raison des opérations de portefeuille continues du FNB.

### Dénégation de responsabilité du fournisseur de l'indice

Solactive AG ne parraine pas le FINB Obligations américaines à rendement élevé Mackenzie (couvert en \$ CA), n'en fait pas la promotion et ne vend pas ses parts, ne les appuie pas et ne donne aucune garantie, expresse ou implicite, quant aux résultats pouvant découler de l'utilisation de l'indice Solactive USD High Yield Corporates Total Market Hedged to CAD (l'« indice sous-jacent »), des marques de commerce et/ou quant au prix de l'indice à quelque moment que ce soit ou à tout autre égard. Solactive AG calcule et publie l'indice sous-jacent. Elle fait de son mieux pour s'assurer que les calculs de l'indice sous-jacent sont corrects. Exclusion faite de ses obligations envers Mackenzie, Solactive AG n'a aucunement l'obligation de signaler toute erreur pouvant s'être produite dans le calcul de l'indice sous-jacent à un tiers, ce qui comprend, sans s'y limiter, les investisseurs et/ou les intermédiaires financiers du FINB Obligations américaines à rendement élevé Mackenzie (couvert en \$ CA). Le fait que Solactive AG publie l'indice sous-jacent et accorde des licences à son égard ou à l'égard de toute marque de commerce connexe en vue de leur utilisation par le FINB Obligations américaines à rendement élevé Mackenzie (couvert en \$ CA) ne constitue pas une recommandation de sa part concernant un placement dans le FINB Obligations américaines à rendement élevé Mackenzie (couvert en \$ CA) ni ne constitue une garantie ou un avis de Solactive AG en ce qui concerne un placement dans le FINB Obligations américaines à rendement élevé Mackenzie (couvert en \$ CA).