

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2023

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Actions	53,3
Obligations	43,4
Obligations	43,5
Contrats à terme standardisés sur actions (vendeur)*	(0,1)
Autres éléments d'actif (de passif)	1,8
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,2
Fonds privés	0,3
Options sur swaps achetées**	–
Options sur swaps vendues**	–

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	48,3
États-Unis	33,7
Autre	3,3
Allemagne	1,8
Autres éléments d'actif (de passif)	1,8
France	1,7
Pays-Bas	1,3
Japon	1,3
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,2
Irlande	1,1
Suisse	1,0
Royaume-Uni	0,9
Luxembourg	0,6
Brésil	0,5
Mexique	0,5
Danemark	0,5
Australie	0,5

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	36,1
Services financiers	14,1
Énergie	6,4
Technologie de l'information	6,4
Produits industriels	6,0
Matériaux	4,4
Consommation de base	4,1
Obligations d'État étrangères	3,8
Soins de santé	3,6
Consommation discrétionnaire	3,4
Services de communication	2,4
Prêts à terme	1,8
Autre	1,8
Autres éléments d'actif (de passif)	1,8
Services publics	1,5
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,2
Obligations fédérales	0,9
Fonds privés	0,3

OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT [†]	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
AAA	1,9
AA	5,1
A	2,0
BBB	10,9
Inférieure à BBB	11,9
Sans note	3,7

* Les valeurs théoriques représentent –4,8 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

** Les valeurs théoriques représentent 3,7 % de la valeur liquidative des options sur swaps achetées et –0,7 % 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 STRATÉGIQUE MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2023

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur/Fonds sous-jacent	
FNB de revenu fixe à rendement élevé mondial Mackenzie	5,7
Banque Royale du Canada	2,2
Banque de Montréal	1,8
La Banque Toronto-Dominion	1,5
Microsoft Corp.	1,3
Canadian Natural Resources Ltd.	1,3
Canadian Pacific Kansas City Ltd.	1,2
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,1
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	1,0
Les Compagnies Loblaw Itée	1,0
Corporation TC Énergie	1,0
TELUS Corp.	0,9
Intact Corporation financière	0,9
Enbridge Inc.	0,9
Financière Sun Life inc.	0,9
Fonds à rendement absolu de titres de créance Mackenzie, série R	0,8
Suncor Énergie Inc.	0,8
La Banque de Nouvelle-Écosse	0,7
Société Financière Manuvie	0,7
Broadcom Inc.	0,7
Charter Communications Operating LLC 5,05 % 30-03-2029, rachetables 2028	0,7
JPMorgan Chase & Co.	0,7
Mines Agnico Eagle Ltée	0,7
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,50 % 15-04-2024	0,7
Alphabet Inc.	0,6
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	29,8

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans	(0,1)
Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente souscrite @ 93,00 \$ éch. 17-01-2024	–
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(0,1)
Valeur liquidative totale du Fonds	1,7 milliard \$

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 2023 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