

FONDS À RENDEMENT ABSOLU DE TITRES DE CRÉANCE MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2023

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Obligations	82,8	(2,0)	80,8
Obligations	69,6	(1,9)	67,7
Contrats à terme standardisés*	13,1	(0,1)	13,0
Options achetées**	0,1	–	0,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	13,0	–	13,0
Fonds privés	2,9	–	2,9
Autres éléments d'actif (de passif)	2,8	–	2,8
Actions	0,5	–	0,5
Swaps†	0,4	–	0,4
Options sur swaps achetées††	–	–	–
Options sur swaps vendues††	–	–	–
Fonds/billets négociés en bourse	0,5	(0,9)	(0,4)

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
États-Unis	39,8	(2,1)	37,7
Canada	31,3	(0,7)	30,6
Trésorerie et équivalents de trésorerie	13,0	–	13,0
Australie	5,4	–	5,4
Autres éléments d'actif (de passif)	2,8	–	2,8
Suisse	1,4	–	1,4
Pays-Bas	1,2	–	1,2
Israël	1,1	–	1,1
Luxembourg	1,1	–	1,1
France	1,0	–	1,0
Autre	1,0	–	1,0
Royaume-Uni	0,9	–	0,9
Espagne	0,7	–	0,7
Chine	0,5	–	0,5
Brésil	0,4	–	0,4
Swaps	0,4	–	0,4
Colombie	0,3	–	0,3
Inde	0,3	–	0,3
Italie	0,3	–	0,3
Japon	–	(0,1)	(0,1)

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Obligations de sociétés	67,9	(1,9)	66,0
Trésorerie et équivalents de trésorerie	13,0	–	13,0
Obligations d'État étrangères	13,1	(0,1)	13,0
Fonds privés	2,9	–	2,9
Autres éléments d'actif (de passif)	2,8	–	2,8
Obligations d'État étrangères	1,0	–	1,0
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,7	–	0,7
Services financiers	0,5	–	0,5
Autre	0,5	–	0,5
Fonds/billets négociés en bourse	0,5	(0,9)	(0,4)

OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT§	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
AA	1,2
A	3,5
BBB	5,5
BB	27,9
B	15,9
Inférieure à B	4,8
Sans note	8,9

* Les valeurs théoriques représentent 12,7 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur) et –8,7 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

** Les valeurs théoriques représentent 38,3 % de la valeur liquidative des options achetées.

† Les valeurs théoriques représentent 19,6 % de la valeur liquidative des swaps.

†† Les valeurs théoriques représentent 14,6 % de la valeur liquidative des options sur swaps achetées et –1,0 % 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.



MACKENZIE
Placements

FONDS À RENDEMENT ABSOLU DE TITRES DE CRÉANCE MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2023

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Trésorerie et équivalents de trésorerie	25,7
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	2,0
Northleaf Private Credit II LP ¹⁾	1,9
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-01-2025	1,7
Morgan Stanley 3,00 % 07-02-2024	1,5
Gray Television Inc. 5,38 % 15-11-2031	1,4
Inter Pipeline Ltd., taux variable 19-11-2079, rachetables 2029	1,1
Secure Energy Services Inc. 7,25 % 30-12-2026	1,1
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,50 % 15-04-2024	1,0
Pembina Pipeline Corp., taux variable 25-01-2081	1,0
Weatherford International Ltd. 8,63 % 30-04-2030	1,0
Sagard Credit Partners II LP ¹⁾	1,0
Compagnie Crédit Ford du Canada 2,96 % 16-09-2026	0,9
CHIP Mortgage Trust 1,50 % 15-11-2024	0,9
Vidéotron Itée 4,50 % 15-01-2030, rachetables 2024	0,9
Keyera Corp., taux variable 13-06-2079, rachetables 2029	0,9
VistaJet Malta Finance PLC 6,38 % 01-02-2030	0,9
Algonquin Power & Utilities Corp., taux variable 18-01-2082	0,9
Vermilion Energy Inc. 6,88 % 01-05-2030	0,9
Corporation Parkland du Canada 4,50 % 01-10-2029	0,8
Vidéotron Itée 3,13 % 15-01-2031	0,8
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 5,13 % 09-05-2029	0,8
Domtar Corp. 6,75 % 01-10-2028	0,8
Produits Kruger S.E.C. 5,38 % 09-04-2029	0,8
Tamarack Valley Energy Ltd. 7,25 % 10-05-2027	0,8
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	51,5

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur/Fonds sous-jacent	
SPDR Bloomberg Barclays Convertible Securities ETF	(0,9)
Bombardier Inc. 6,00 % 15-02-2028	(0,4)
TRI Pointe Group Inc. 5,70 % 15-06-2028	(0,3)
Credit Acceptance Corp. 6,63 % 15-03-2026	(0,3)
Bombardier Inc. 7,88 % 15-04-2027	(0,3)
W. R. Grace Holdings LLC 5,63 % 15-08-2029	(0,2)
Bread Financial Holdings Inc. 7,00 % 15-01-2026	(0,2)
Eco Material Technologies Inc. 7,88 % 31-01-2027	(0,2)
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans	(0,1)
Paramount Global 4,20 % 19-05-2032	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans de moindre valeur	–
Contrats à terme standardisés sur euro-obligations	–
Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente souscrite @ 93,00 \$ éch. 17-01-2024	–
Swap sur rendement total sur HYG éch. 28-03-2024	–
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(2,9)
Valeur liquidative totale du Fonds	99,5 millions \$

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 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