

# FNB DE REVENU FIXE À COURT TERME CANADIEN MACKENZIE

## Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2023

### Aperçu du portefeuille

| RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE                              | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|--|----------------------------|
| Obligations  | 96,8                       |
| Obligations  | 96,8                       |
| Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)* | –                          |
| Autres éléments d'actif (de passif)                      | 1,7                        |
| Fonds/billets négociés en bourse                         | 1,6                        |
| Options sur swaps achetées**                             | –                          |
| Options sur swaps vendues**                              | –                          |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie                  | (0,1)                      |

| RÉPARTITION RÉGIONALE                   | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|---|----------------------------|
| Canada                                  | 90,3                       |
| États-Unis                              | 7,1                        |
| Autres éléments d'actif (de passif)     | 1,7                        |
| Royaume-Uni                             | 0,5                        |
| Australie                               | 0,2                        |
| Luxembourg                              | 0,1                        |
| Japon                                   | 0,1                        |
| Irlande                                 | 0,1                        |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie | (0,1)                      |

| RÉPARTITION SECTORIELLE                     | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|---|----------------------------|
| Obligations de sociétés                     | 62,2                       |
| Obligations fédérales                       | 23,4                       |
| Obligations provinciales                    | 9,9                        |
| Autres éléments d'actif (de passif)         | 1,7                        |
| Fonds/billets négociés en bourse            | 1,6                        |
| Obligations d'État étrangères               | 0,6                        |
| Titres adossés à des créances hypothécaires | 0,6                        |
| Prêts à terme                               | 0,1                        |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie     | (0,1)                      |

| OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT† | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|---------------------------------|----------------------------|
| AAA                             | 24,4                       |
| AA                              | 6,5                        |
| A                               | 30,5                       |
| BBB                             | 25,1                       |
| Inférieure à BBB                | 1,3                        |
| Sans note                       | 9,0                        |

\* Les valeurs théoriques représentent –6,2 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

\*\* Les valeurs théoriques représentent 1,4 % de la valeur liquidative des options sur swaps achetées et –1,4 % 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.

### LES 25 PRINCIPALES

| POSITIONS ACHETEUR  | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|---|----------------------------|
| <b>Émetteur/Fonds sous-jacent</b>   |                            |
| Gouvernement du Canada 3,25 % 01-09-2028  | 10,7                       |
| Gouvernement du Canada 2,75 % 01-09-2027  | 8,1                        |
| Province de l'Ontario 2,40 % 02-06-2026   | 4,6                        |
| Apple Inc. 1,13 % 11-05-2025, rachetables 2025  | 2,6                        |
| Province de l'Ontario 3,60 % 08-03-2028   | 2,3                        |
| Bell Canada Inc. 3,60 % 29-09-2027, rachetables 2027  | 2,3                        |
| Financière Sun Life inc., taux variable 21-11-2033  | 2,2                        |
| Province de Québec 2,75 % 01-09-2028  | 1,8                        |
| Banque Royale du Canada, taux variable 01-02-2033   | 1,7                        |
| Rogers Communications Inc. 3,10 % 15-04-2025  | 1,6                        |
| AltaLink, L.P. 3,40 % 06-06-2024, rachetables 2024  | 1,5                        |
| Banque Nationale du Canada, taux variable 18-08-2026, rachetables 2025                        | 1,4                        |
| Fiducie du Canada pour l'habitation 2,25 % 15-12-2025   | 1,4                        |
| Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 2,85 % 21-05-2027                         | 1,3                        |
| Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027   | 1,3                        |
| Hydro One Inc. 2,54 % 05-04-2024, rachetables 2024  | 1,3                        |
| Fédération des caisses Desjardins du Québec 4,41 % 19-05-2027                                 | 1,2                        |
| Gouvernement du Canada 4,25 % 01-12-2026, rendement réel                                      | 1,2                        |
| FINB Obligations à court terme canadiennes Mackenzie  | 1,1                        |
| La Banque Toronto-Dominion 4,48 % 18-01-2028  | 0,9                        |
| OPB Finance Trust 2,98 % 25-01-2027   | 0,8                        |
| La Banque Toronto-Dominion 4,21 % 01-06-2027  | 0,8                        |
| Wells Fargo & Co. 2,98 % 19-05-2026   | 0,8                        |
| TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027                                 | 0,8                        |
| Société Financière Manuvie, taux variable 10-03-2033  | 0,7                        |
| <b>Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale</b> | <b>54,4</b>                |

Pour le prospectus et d'autres renseignements concernant le ou les fonds sous-jacents du portefeuille, veuillez consulter les adresses suivantes : [www.placementsmackenzie.com](http://www.placementsmackenzie.com) ou [www.sedarplus.ca](http://www.sedarplus.ca).



**MACKENZIE**  
Placements

# FNB DE REVENU FIXE À COURT TERME CANADIEN MACKENZIE

---

## **Présentation trimestrielle du portefeuille** (suite)

Au 31 décembre 2023

| <b>LES 25 PRINCIPALES<br/>POSITIONS VENDEUR</b>   | <b>% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE</b> |
|---|-----------------------------------|
| <b>Émetteur</b>   |                                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement<br>du Japon à 10 ans de moindre valeur      | –                                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 5 ans   | –                                 |
| Indice Markit North American Investment Grade CDX<br>option de vente souscrite @ 93,00 \$ éch. 17-01-2024 | –                                 |
| <hr/>   |                                   |
| <b>Principales positions vendeur en tant que<br/>pourcentage de la valeur liquidative totale</b>          | –                                 |
| <hr/>   |                                   |
| <b>Valeur liquidative totale du FNB</b>   | <b>18,2 millions \$</b>           |

*Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 31 décembre 2023 en raison des opérations de portefeuille continues du FNB. 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 FNB, où elles sont disponibles dans les 90 jours.*

