

FONDS HYPOTHÉCAIRE ET DE REVENU À COURT TERME IG MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2023

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	51,1
Obligations	49,4
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)*	1,7
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)*	–
Options achetées**	–
Options vendues**	–
Prêts hypothécaires	47,7
Autres éléments d'actif (de passif)	0,6
Fonds négociés en bourse	0,3
Trésorerie et équivalents de trésorerie	0,2
Actions	0,1

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	90,5
États-Unis	6,4
Autres éléments d'actif (de passif)	0,6
Chine	0,5
Japon	0,4
Royaume-Uni	0,4
Pérou	0,2
Trésorerie et équivalents de trésorerie	0,2
Brésil	0,2
Autre	0,2
Irlande	0,1
Australie	0,1
Mexique	0,1
Luxembourg	0,1

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Services financiers	47,7
Obligations de sociétés	36,1
Obligations provinciales	8,1
Obligations fédérales	5,3
Obligations d'État étrangères	0,6
Autres éléments d'actif (de passif)	0,6
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,5
Fonds négociés en bourse	0,3
Prêts à terme	0,3
Autre	0,2
Trésorerie et équivalents de trésorerie	0,2
Services publics	0,1

OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT [†]	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
AAA	4,3
AA	4,1
A	17,5
BBB	13,7
Inférieure à BBB	2,0
Sans note	7,8

PRÊTS HYPOTHÉCAIRES PAR ANNÉE D'ÉCHÉANCE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
2024	8,6
2025	11,6
2026	17,5
2027	7,2
2028	2,8

PAR TAUX D'INTÉRÊT	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Inférieur à 2,5 %	19,7
2,5 – 3,0 %	13,3
3,0 – 3,5 %	3,8
Supérieur à 3,5 %	10,9

* Les valeurs théoriques représentent 1,7 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur) et –5,0 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

** Les valeurs théoriques représentent 1,6 % de la valeur liquidative des options achetées et –1,6 % de la valeur liquidative des options vendues.

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

FONDS HYPOTHÉCAIRE ET DE REVENU À COURT TERME IG MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2023

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Province de Québec 2,75 % 01-09-2028	3,5
Province de l'Ontario 3,40 % 08-09-2028	3,4
Gouvernement du Canada 4,25 % 01-12-2026, rendement réel Trésorerie et équivalents de trésorerie	2,0
Gouvernement du Canada 3,25 % 01-09-2028	1,8
Province de l'Ontario 3,60 % 08-03-2028	1,6
John Deere Financial Inc. 5,17 % 15-09-2028	1,1
Banque Royale du Canada, taux variable 01-02-2033	0,9
La Banque Toronto-Dominion, 4,21 %, 01-06-2027	0,9
Bruce Power L.P. 4,70 % 21-12-2027	0,7
Financière Sun Life inc., taux variable 10-05-2032, rachetables 2027	0,7
Gibson Energy Inc. 5,80 % 12-07-2026	0,7
TransCanada PipeLines Ltd. 3,80 % 05-04-2027, rachetables 2027	0,6
Waste Management of Canada Corp. 2,60 % 23-09-2026, rachetables 2026	0,6
North West Redwater Partnership Co. Ltd. 3,20 % 24-04-2026	0,6
Banque de Montréal 4,71 % 07-12-2027	0,5
TransCanada PipeLines Ltd. 5,42 % 10-03-2026	0,5
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,50 % 15-04-2024	0,5
Bell Canada Inc. 3,60 % 29-09-2027, rachetables 2027	0,5
Enbridge Inc. 3,20 % 08-06-2027, rachetables 2027	0,5
Société Financière Manuvie, taux variable 10-03-2033	0,5
Bank of America Corp., taux variable 16-03-2028	0,5
Central 1 Credit Union, taux variable 30-06-2031	0,5
Banque Nationale du Canada 5,22 % 14-06-2028	0,5
Fonds hypothécaire Canada 3,84 % 01-11-2028	0,4
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	24,6

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Contrat à terme standardisé sur des obligations canadiennes à 5 ans (MSE)	—
Contrat à terme standardisé sur des obligations du gouvernement du Japon à 10 ans (SGX Mini)	—
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	—
Valeur liquidative totale du Fonds	3,3 milliards \$

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.