

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2023

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	98,7
Obligations	91,4
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)*	7,4
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)*	(0,1)
Prêts hypothécaires	2,7
Autres éléments d'actif (de passif)	1,0
Options achetées**	–
Options vendues**	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(2,4)

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	86,0
États-Unis	13,3
Royaume-Uni	1,0
Autres éléments d'actif (de passif)	1,0
Mexique	0,3
Brésil	0,2
Australie	0,1
Chine	0,1
Chili	0,1
Japon	0,1
Irlande	0,1
Allemagne	0,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(2,4)

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	45,7
Obligations provinciales	26,5
Obligations fédérales	18,7
Obligations d'État étrangères	7,1
Services financiers	2,7
Autres éléments d'actif (de passif)	1,0
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,5
Obligations municipales	0,2
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(2,4)

OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT†	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
AAA	13,3
AA	17,9
A	27,3
BBB	18,7
Inférieure à BBB	0,1
Sans note	7,8

* Les valeurs théoriques représentent 7,4 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur) et –7,7 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

** Les valeurs théoriques représentent 3,4 % de la valeur liquidative des options achetées et –1,4 % 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. Ce tableau présente uniquement les obligations détenues directement par le Fonds.

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2023

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur/Fonds sous-jacent	
Province de l'Ontario 3,65 % 02-06-2033	8,6
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-06-2033	6,7
Fonds hypothécaire et de revenu à court terme IG Mackenzie, série P	5,6
Province de Québec 4,40 % 01-12-2055	4,4
Gouvernement du Canada 2,50 % 01-12-2032	2,6
Gouvernement du Canada 5,07 % 29-02-2024	2,4
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,50 % 15-04-2024	2,3
FINB Obligations canadiennes totales Mackenzie	2,2
Province de Québec 3,60 % 01-09-2033	1,6
Province de l'Alberta 3,10 % 01-06-2050	1,5
Province de l'Ontario 4,15 % 02-12-2054	1,2
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,50 % 15-02-2053	1,0
Province de l'Alberta 2,95 % 01-06-2052	1,0
Province de l'Alberta 4,15 % 01-06-2033	1,0
Hydro One Inc. 4,91 % 27-01-2028	0,9
FINB Obligations toutes sociétés canadiennes Mackenzie	0,9
Province de Québec 2,75 % 01-09-2028	0,9
Gouvernement du Canada 1,75 % 01-12-2053	0,8
Banque Royale du Canada 2,61 % 01-11-2024	0,8
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	0,8
Province de la Colombie-Britannique 3,55 % 18-06-2033	0,7
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052	0,7
Fiducie du Canada pour l'habitation 2,90 % 15-06-2024	0,7
Gouvernement du Canada 0,50 % 01-12-2050	0,7
Province de l'Ontario 4,05 % 02-02-2032	0,6
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	50,6

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Contrat à terme standardisé sur des obligations du gouvernement du Japon à 10 ans (SGX Mini)	(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	6,0 milliards \$

La répartition effective présente l'exposition du Fonds par portefeuille, région ou secteur calculée en combinant les placements directs et indirects du Fonds.

Pour le prospectus et d'autres renseignements concernant le ou les fonds sous-jacents du portefeuille, veuillez consulter les adresses suivantes : www.ig.ca/fr ou www.sedarplus.ca. L'émetteur des Fonds Mackenzie est lié au gestionnaire.

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.