

FONDS DE REVENU À COURT TERME CANADIEN MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2023

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	97,7
Obligations	97,7
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)*	–
Autres éléments d'actif (de passif)	1,1
Fonds/billets négociés en bourse	1,0
Actions	0,2
Options sur swaps achetées**	–
Options sur swaps vendues**	–

RÉPARTITION RÉGIONALE

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	86,3
États-Unis	10,7
Autres éléments d'actif (de passif)	1,1
Royaume-Uni	0,5
Chine	0,4
Japon	0,4
Brésil	0,1
Pérou	0,1
Mexique	0,1
Irlande	0,1
Australie	0,1
Luxembourg	0,1

RÉPARTITION SECTORIELLE

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	64,3
Obligations fédérales	16,6
Obligations provinciales	15,4
Autres éléments d'actif (de passif)	1,1
Fonds/billets négociés en bourse	1,0
Obligations d'État étrangères	0,6
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,4
Services financiers	0,2
Prêts à terme	0,2
Obligations supranationales	0,2

OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT†

OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT†	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
AAA	17,3
AA	6,2
A	38,1
BBB	25,5
Inférieure à BBB	1,2
Sans note	9,4

* Les valeurs théoriques représentent –6,0 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

** Les valeurs théoriques représentent 1,5 % 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.



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU À COURT TERME CANADIEN MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2023

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Province de l'Ontario 2,60 % 02-06-2025	7,3
Gouvernement du Canada 3,25 % 01-09-2028	6,8
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-09-2027	5,9
Province de l'Ontario 3,60 % 08-03-2028	2,6
Hydro One Inc. 4,91 % 27-01-2028	2,5
Province de l'Ontario 3,40 % 08-09-2028	2,5
Province de Québec 2,75 % 01-09-2028	2,4
Société Financière Manuvie, taux variable 10-03-2033	2,3
Apple Inc. 2,51 % 19-08-2024, rachetables 2024	2,3
Banque Nationale du Canada, taux variable 18-08-2026, rachetables 2025	2,2
Financière Sun Life inc., taux variable 21-11-2033	2,1
Rogers Communications Inc. 3,10 % 15-04-2025	2,1
Gouvernement du Canada 4,25 % 01-12-2026, rendement réel	1,9
Bell Canada Inc. 3,60 % 29-09-2027, rachetables 2027	1,8
AltaLink, L.P. 3,40 % 06-06-2024, rachetables 2024	1,8
Banque Royale du Canada, taux variable 01-02-2033	1,6
Fiducie du Canada pour l'habitation 2,25 % 15-12-2025	1,5
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 07-04-2032	1,4
John Deere Financial Inc. 5,17 % 15-09-2028	1,4
La Banque Toronto-Dominion, 4,21 %, 01-06-2027	1,4
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	1,4
Fédération des caisses Desjardins du Québec 4,41 % 19-05-2027	1,4
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 2,85 % 21-05-2027	1,3
Banque de Montréal 1,76 % 10-03-2026	1,3
Fédération des caisses Desjardins du Québec, taux variable 23-08-2032	1,1
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	60,3

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans	—
Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 5 ans	—
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	266,7 millions \$

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