

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE II CANADA VIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2023

Aperçu du portefeuille du Fonds sous-jacent*

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Actions	52,5
Obligations	44,6
Obligations	44,7
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)**	(0,1)
Autres éléments d'actif (de passif)	1,7
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,2

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	48,6
États-Unis	33,9
Autre	3,1
Allemagne	1,8
France	1,7
Autres éléments d'actif (de passif)	1,7
Japon	1,3
Irlande	1,2
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,2
Pays-Bas	1,1
Suisse	1,0
Royaume-Uni	0,9
Brésil	0,6
Australie	0,5
Mexique	0,5
Danemark	0,5
Luxembourg	0,4

* Le Fonds est actuellement entièrement investi dans le Fonds de revenu stratégique Canada Vie (le « Fonds sous-jacent »). Pour le prospectus et d'autres renseignements concernant le fonds sous-jacents du portefeuille ou les fonds détenus par le portefeuille, veuillez consulter les adresses suivantes : www.placementscanadavie.com ou www.sedar.com. Le gestionnaire des Fonds Mackenzie est lié au gestionnaire.

** Les valeurs théoriques représentent -5,2 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

† 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.

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

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	37,4
Services financiers	13,8
Technologie de l'information	6,4
Énergie	6,4
Produits industriels	6,0
Matériaux	4,4
Consommation de base	4,1
Soins de santé	3,5
Consommation discrétionnaire	3,4
Obligations d'État étrangères	3,2
Services de communication	2,4
Prêts à terme	2,2
Autres éléments d'actif (de passif)	1,7
Autre	1,6
Services publics	1,5
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,2
Obligations fédérales	0,8

OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT†	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
AAA	2,1
AA	4,6
A	2,4
BBB	12,3
Inférieure à BBB	13,2
Sans note	3,0

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE II CANADA VIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2023

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS

ACHETEUR DU FONDS SOUS-JACENT* % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

Émetteur/Fonds sous-jacent	
FNB de revenu fixe à rendement élevé mondial Mackenzie	2,3
Banque Royale du Canada	2,2
Banque de Montréal	1,8
FNB de revenu à taux variable Mackenzie	1,5
La Banque Toronto-Dominion	1,5
Canadian Natural Resources Ltd.	1,3
Microsoft Corp.	1,3
Canadian Pacific Kansas City Ltd.	1,2
FINB Obligations toutes sociétés canadiennes Mackenzie	1,1
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	1,0
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,0
Les Compagnies Loblaw Itée	1,0
Corporation TC Énergie	1,0
Fonds à rendement absolu de titres de créance Mackenzie, série CL	0,9
TELUS Corp.	0,9
Intact Corporation financière	0,9
Enbridge Inc.	0,9
Financière Sun Life inc.	0,9
Suncor Énergie Inc.	0,8
La Banque de Nouvelle-Écosse	0,7
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	0,7
Charter Communications Operating LLC 5,05 % 30-03-2029, rachetables 2028	0,7
JPMorgan Chase & Co.	0,7
Mines Agnico Eagle Ltée	0,7
Broadcom Inc.	0,7
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	27,7

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS

VENDEUR DU FONDS SOUS-JACENT* % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

Émetteur	
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans	(0,1)
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(0,1)
Valeur liquidative totale du Fonds sous-jacent	1,8 milliard \$
Valeur liquidative totale du Fonds	98,6 millions \$

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 31 décembre 2023 en raison des opérations de portefeuille continues du Fonds et du Fonds sous-jacent. 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.