

# FONDS DE REVENU FIXE CANADIEN ÉQUILIBRÉ II CANADA VIE

## Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2023

### Aperçu du portefeuille

| RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE                               | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|---|----------------------------|
| Obligations   | 71,8                       |
| Obligations   | 65,0                       |
| Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)* | 6,9                        |
| Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)*  | (0,1)                      |
| Actions   | 27,4                       |
| Fonds/billets négociés en bourse                          | 3,7                        |
| Autres éléments d'actif (de passif)                       | 0,9                        |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie                   | (3,8)                      |

| RÉPARTITION RÉGIONALE                   | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|---|----------------------------|
| Canada                                  | 78,9                       |
| États-Unis                              | 17,6                       |
| Allemagne                               | 1,0                        |
| Autres éléments d'actif (de passif)     | 0,9                        |
| Autre                                   | 0,8                        |
| Royaume-Uni                             | 0,7                        |
| France                                  | 0,6                        |
| Japon                                   | 0,6                        |
| Irlande                                 | 0,6                        |
| Pays-Bas                                | 0,5                        |
| Suisse                                  | 0,5                        |
| Australie                               | 0,3                        |
| Danemark                                | 0,2                        |
| Espagne                                 | 0,2                        |
| Taiïwan                                 | 0,2                        |
| Singapour                               | 0,2                        |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie | (3,8)                      |

| RÉPARTITION SECTORIELLE                 | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|---|----------------------------|
| Obligations de sociétés                 | 38,1                       |
| Obligations provinciales                | 17,2                       |
| Obligations fédérales                   | 11,4                       |
| Services financiers                     | 7,1                        |
| Obligations d'État étrangères           | 5,0                        |
| Fonds/billets négociés en bourse        | 3,7                        |
| Énergie                                 | 3,3                        |
| Technologie de l'information            | 3,3                        |
| Produits industriels                    | 3,2                        |
| Matériaux                               | 2,2                        |
| Consommation de base                    | 2,1                        |
| Soins de santé                          | 2,0                        |
| Consommation discrétionnaire            | 1,7                        |
| Autre                                   | 1,4                        |
| Services de communication               | 1,2                        |
| Autres éléments d'actif (de passif)     | 0,9                        |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie | (3,8)                      |

| OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT** | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|----------------------------------|----------------------------|
| AAA                              | 6,3                        |
| AA                               | 15,9                       |
| A                                | 17,6                       |
| BBB                              | 13,8                       |
| Inférieure à BBB                 | 3,5                        |
| Sans note                        | 7,9                        |

\* Les valeurs théoriques représentent 6,8 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur) et -7,3 % 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.

# FONDS DE REVENU FIXE CANADIEN ÉQUILIBRÉ II CANADA VIE

## Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2023

| LES 25 PRINCIPALES<br>POSITIONS ACHETEUR  | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|---|----------------------------|
| <b>Émetteur/Fonds sous-jacent</b>   |                            |
| Province de Québec 4,40 % 01-12-2055  | 4,3                        |
| Province de l'Ontario 3,65 % 02-06-2033   | 3,8                        |
| Gouvernement du Canada 2,75 % 01-06-2033  | 3,5                        |
| Banque Royale du Canada 4,95 % 02-01-2024   | 2,1                        |
| Province de Québec 3,60 % 01-09-2033  | 2,0                        |
| Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation<br>0,50 % 15-04-2024                | 2,0                        |
| FINB Obligations américaines à rendement élevé Mackenzie<br>(couvert en \$ CA)                    | 1,8                        |
| FINB Obligations canadiennes totales Mackenzie  | 1,7                        |
| Province de l'Alberta 3,10 % 01-06-2050   | 1,2                        |
| Province de la Colombie-Britannique 3,55 % 18-06-2033   | 1,2                        |
| Banque Royale du Canada   | 1,1                        |
| Banque de Montréal  | 0,9                        |
| Province de l'Alberta 3,45 % 01-12-2043   | 0,8                        |
| Banque de Montréal 2,70 % 11-09-2024  | 0,7                        |
| Fiducie du Canada pour l'habitation 2,90 % 15-06-2024   | 0,7                        |
| La Banque Toronto-Dominion  | 0,7                        |
| Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation<br>1,50 % 15-02-2053                | 0,7                        |
| Microsoft Corp.   | 0,7                        |
| Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027   | 0,7                        |
| TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077,<br>rachetables 2027                                  | 0,7                        |
| Province de l'Alberta 2,95 % 01-06-2052   | 0,7                        |
| Canadian Natural Resources Ltd.   | 0,7                        |
| Gouvernement du Canada 0,50 % 01-12-2050  | 0,6                        |
| Province de la Saskatchewan 3,10 % 02-06-2050   | 0,6                        |
| Canadian Pacific Kansas City Ltd.   | 0,6                        |
| <b>Principales positions acheteur en tant que<br/>pourcentage de la valeur liquidative totale</b> | <b>34,5</b>                |

| LES 25 PRINCIPALES<br>POSITIONS VENDEUR  | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|--|----------------------------|
| <b>Émetteur</b>  |                            |
| Contrats à terme standardisés sur obligations<br>du gouvernement du Japon à 10 ans               | (0,1)                      |
| <b>Principales positions vendeur en tant que<br/>pourcentage de la valeur liquidative totale</b> | <b>(0,1)</b>               |
| <b>Valeur liquidative totale du Fonds</b>  | <b>131,5 millions \$</b>   |

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