

FONDS DE REVENU FIXE SANS CONTRAINTES CANADA VIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2022

Aperçu du portefeuille du Fonds sous-jacent*

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	89,1
Obligations	87,9
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)**	1,1
Options achetées†	0,1
Options vendues†	–
Trésorerie et placements à court terme	5,6
Fonds privés	2,4
Actions	1,5
Actions	1,4
Options achetées††	0,1
Autres éléments d'actif (de passif)	1,5
Options sur devises achetées§	–
Swaps§§	(0,1)

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	37,9
États-Unis	37,5
Autre	6,0
Trésorerie et placements à court terme	5,6
Mexique	2,2
Brésil	1,6
Chine	1,5
Allemagne	1,5
Autres éléments d'actif (de passif)	1,5
Royaume-Uni	1,2
Luxembourg	1,0
Pays-Bas	0,6
Australie	0,5
Nouvelle-Zélande	0,5
Corée du Sud	0,5
Malaisie	0,4

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	58,5
Obligations d'État étrangères	13,1
Obligations fédérales	8,3
Trésorerie et placements à court terme	5,6
Prêts à terme	4,6
Fonds privés	2,4
Obligations supranationales	1,7
Autres éléments d'actif (de passif)	1,5
Services financiers	1,3
Obligations provinciales	1,2
Autre	1,2
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,4
Obligations municipales	0,1
Énergie	0,1

* Le Fonds est actuellement entièrement investi dans le Fonds de revenu fixe sans contraintes Mackenzie (le « Fonds sous-jacent »), qui est géré par une société liée au gestionnaire. Pour le prospectus et d'autres renseignements concernant le Fonds sous-jacent, veuillez consulter l'adresse www.sedar.com.

** Les valeurs théoriques représentent –57,5 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

† Les valeurs théoriques représentent 23,0 % de la valeur liquidative des options achetées et –21,2 % de la valeur liquidative des options vendues.

†† Les valeurs théoriques représentent 3,9 % de la valeur liquidative des options achetées.

§ Les valeurs théoriques représentent 3,1 % de la valeur liquidative des options sur devises achetées.

§§ Les valeurs théoriques représentent 5,5 % de la valeur liquidative des swaps sur rendement total.

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.

FONDS DE REVENU FIXE SANS CONTRAINTES CANADA VIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2022

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS

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

Émetteur/Fonds sous-jacent	
Trésorerie et placements à court terme	5,4
FINB Obligations toutes sociétés canadiennes Mackenzie	4,3
FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	4,1
FINB Obligations à court terme canadiennes Mackenzie	3,5
Gouvernement du Canada 1,75 % 01-12-2053	2,7
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-08-2024	2,1
Northleaf Private Credit II LP ¹⁾	1,8
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052	1,6
Fonds à rendement absolu de titres de créance Mackenzie, série R	1,1
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	1,1
Microsoft Corp. 2,53 % 01-06-2050	1,0
Société Financière Internationale 7,75 % 18-01-2030	0,9
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2051	0,9
Gouvernement du Mexique 7,75 % 29-05-2031	0,9
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2032	0,8
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	0,8
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	0,8
FINB Obligations de marchés émergents Mackenzie (couvert en \$ CA)	0,8
Gouvernement de l'Allemagne 0 % 15-08-2052	0,7
Gouvernement du Canada 1,50 % 01-06-2031	0,6
République fédérale d'Allemagne, obligations indexées sur l'inflation, 0,10 % 15-04-2046	0,6
Apple Inc. 2,65 % 11-05-2050	0,6
Société Financière Internationale 7,50 % 18-01-2028	0,6
Sagard Credit Partners II LP ¹⁾	0,6
Obligations du Trésor des États-Unis 1,88 % 15-02-2032	0,6
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	38,9

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS

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

Émetteur	
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF option de vente souscrite @ 65,00 \$ éch. 17-03-2023	–
Contrats à terme standardisés sur obligations américaines à 5 ans	–
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF option de vente souscrite @ 64,00 \$ éch. 17-02-2023	–
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF option de vente souscrite @ 63,00 \$ éch. 20-01-2023	–
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF option de vente souscrite @ 64,00 \$ éch. 17-03-2023	–
Contrats à terme standardisés sur obligations Euro-Schatz	–
Contrats à terme standardisés sur euro-obligations à long terme du gouvernement italien (BTP)	0,2
Contrats à terme standardisés sur obligations Euro-Bobl	0,4
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans	0,5
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	1,1
Valeur liquidative totale du Fonds sous-jacent	2,7 milliards \$
Valeur liquidative totale du Fonds	26,1 millions \$

1) L'émetteur de ce titre est lié au gestionnaire.

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 31 décembre 2022 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.