

FNB d'obligations sans contraintes Mackenzie

Revenu fixe mondial

Rendement annualisé composé 31/07/2024

| | |
|---------------------------------|-------|
| 1 mois | 1,9 % |
| 3 mois | 4,1 % |
| Année à ce jour | 3,4 % |
| 1 an | 7,2 % |
| 2 ans | 5,0 % |
| 3 ans | 0,8 % |
| 5 ans | 1,8 % |
| Depuis le lancement (avr. 2016) | 3,1 % |

Répartition régionale 31/07/2024

| | |
|-----------------------------|--------------|
| TRÉSORERIE ET ÉQUIV. | |
| Trésorerie et équivalents | 8,3 % |
| GLOBALEMENT | |
| États-Unis | 40,9 % |
| Canada | 33,7 % |
| Allemagne | 2,9 % |
| Royaume-Uni | 2,0 % |
| Afrique du Sud | 1,3 % |
| Mexique | 1,3 % |
| Nouvelle-Zélande | 1,3 % |
| Brésil | 1,2 % |
| Luxembourg | 1,0 % |
| Autres*** | 6,1 % |
| total | 100 % |

Répartition sectorielle 31/07/2024

| | |
|---|--------------|
| Obligations de sociétés | 64,9 % |
| Titres à revenu fixe étrangers | 14,5 % |
| Prêts bancaires | 7,7 % |
| Obligations fédérales | 1,3 % |
| Actions | 1,1 % |
| Obligations provinciales | 0,3 % |
| Titres adossés à des créances hypothécaires | 0,2 % |
| Trésorerie et équivalents | 8,3 % |
| Autres | 1,7 % |
| total | 100 % |

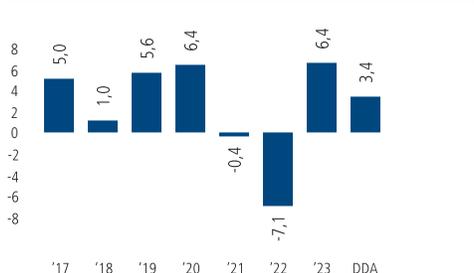
Répartition par cote** 31/07/2024

| | | | |
|-----|--------|---------------------------|--------|
| AAA | 5,7 % | CCC | 3,5 % |
| AA | 12,0 % | Obliq. non évaluées | 10,5 % |
| A | 5,8 % | Actions | 1,1 % |
| BBB | 23,6 % | Autres | 0,1 % |
| BB | 17,6 % | Trésorerie et équivalents | 8,3 % |
| B | 11,8 % | | |

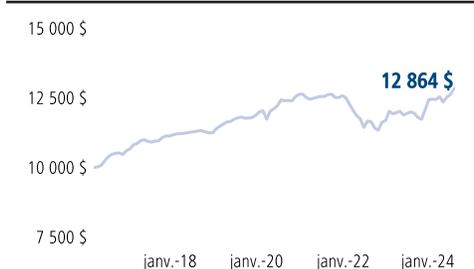
Gestionnaires de portefeuille

Équipe des placements à revenu fixe Mackenzie

Rendement pour l'année civile (%) 31/07/2024



Valeur d'un placement de 10 000 \$ 31/07/2024



Principaux titres 28/06/2024

Les principaux titres représentent 24,4 % du fonds

| | |
|---------------------------|--------|
| Cash, Cash Equivalents 1 | 10,3 % |
| MACKENZIE CANADIAN ALL CO | 2,1 % |
| T 3 1/2 02/15/33 | 1,9 % |
| OBL 2.1 04/12/29 | 1,9 % |
| B 09/05/24 | 1,9 % |
| TII 0 1/8 02/15/52 | 1,3 % |
| MBONO 7.75 11/23/34 M | 1,3 % |
| SAGB 8 7/8 02/28/35 #2035 | 1,3 % |
| NZGB 4 1/4 05/15/34 | 1,3 % |
| MBONO 8 1/2 03/01/29 | 1,1 % |

NOMBRE TOTAL DE TITRES : 654

Évaluation du risque du fonds

| | |
|------------------------------|------|
| Écart-type ann. | 4,9 |
| Écart-type ann. ind. de réf. | 5,8 |
| Alpha | 0,7 |
| Bêta | 0,7 |
| R-carré | 0,7 |
| Ratio de Sharpe | -0,6 |

Source : Placements Mackenzie

Données clés sur le fonds 30/06/2024

| | |
|---|--|
| Symbole : | MUB |
| Actif total du fonds : | 970,32 millions \$ |
| Valeur liquidative par titre (31/07/2024) : | 18,39 \$ |
| CUSIP : | 55454N104 |
| Date d'inscription : | 19/04/2016 |
| Indice de référence* : | Indice Bloomberg Multiverse TR Index (couv. \$ CA) |
| Catégorie du fonds : | Revenu fixe mondial |
| Fréquence de distribution : | Mensuelle |
| Admissibilité RRD : | Oui |
| Frais de gestion : | 0,50 % |
| Duration modifiée : | 4,99 an(s) |
| Rendement à l'échéance : | 7,05 % |
| Coupon moyen pondéré : | 4,85 % |
| Rendement des distributions : | 5,03 % |

Terme jusqu'à l'échéance (ans) 31/07/2024

| | |
|---------------------------|--------------|
| 0 - 1 an | 2,4 % |
| 1 - 2 ans | 2,5 % |
| 2 - 3 ans | 6,3 % |
| 3 - 5 ans | 20,1 % |
| 5 - 7 ans | 19,0 % |
| 7 - 10 ans | 12,5 % |
| 10 - 15 ans | 2,6 % |
| 15 - 20 ans | 2,3 % |
| 20+ ans | 22,8 % |
| Autres | 1,2 % |
| Trésorerie et équivalents | 8,3 % |
| total | 100 % |

Pourquoi investir dans ce fonds?

- Aide à améliorer le profil risque/rendement d'un portefeuille étant donné que les titres de créance ont tendance à avoir une faible corrélation avec les titres à revenu fixe traditionnels.
- Son approche sans contraintes atténue le risque du cycle de crédit en s'ajustant à la conjoncture et en optimisant les titres.
- Minimise la volatilité découlant des fluctuations des taux d'intérêt ou de l'élargissement des écarts de taux, en ajustant de façon tactique les titres sous-jacents dans le portefeuille.

Tolérance au risque

| | | |
|--------|---------|--------|
| FAIBLE | MOYENNE | ÉLEVÉE |
|--------|---------|--------|



* L'indice Bloomberg Multiverse (couvert) fournit une mesure générale du marché mondial des obligations à revenu fixe. L'indice représente l'union de l'indice Global Aggregate, qui fournit une mesure générale des marchés mondiaux des titres de créance à revenu fixe de première qualité, et de l'indice Global High-Yield, qui fournit une mesure générale des marchés mondiaux des titres à revenu fixe à rendement élevé, et regroupe toutes les devises admissibles. Le rendement de l'indice est calculé avec une couverture envers les devises étrangères, ce qui limite l'impact des fluctuations des taux de change sur les rendements en dollars canadiens.

** Les notes de crédit et les catégories de crédit sont basées sur les notes d'une agence de notation désignée.

*** Autres comprend les contrats de change.