

FONDS HYPOTHÉCAIRE ET DE REVENU À COURT TERME IG MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2022

Aperçu du portefeuille

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Trésorerie et équivalents de trésorerie	3,6
Gouvernement du Canada 1,25 % 01-03-2027	2,9
Gouvernement du Canada 4,25 % 01-12-2026, rendement réel	1,7
Charter Communications Operating LLC, taux variable 01-02-2024, rachetables 2024	1,2
Province de la Colombie-Britannique 2,85 % 18-06-2025	0,8
Province de l'Ontario 1,55 % 01-11-2029	0,7
Daimler Trucks Finance Canada Inc. 2,14 % 13-12-2024	0,6
OMERS Finance Trust 1,55 % 21-04-2027	0,6
Province de l'Alberta 2,55 % 01-06-2027	0,5
¹⁾ FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	0,5
The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 29-04-2025	0,5
Hydro One Inc. 0,71 % 16-01-2023	0,5
Morgan Stanley, taux variable 21-03-2025	0,4
Amazon.com Inc. 0,25 % 12-05-2023	0,4
PACCAR Financial Corp. 0,99 % 14-05-2024	0,4
John Deere Financial Inc. 2,41 % 01-14-2025	0,4
Banque Laurentienne du Canada 1,95 % 17-03-2025	0,4
Société Financière Manuvie, taux variable 09-05-2028, rachetables 2023	0,4
Central 1 Credit Union, taux variable 30-06-2031	0,4
Province de Québec 2,25 % 22-02-2024	0,4
Province de la Saskatchewan 2,65 % 02-06-2027	0,4
Athene Global Funding, taux variable 09-04-2024	0,4
La Banque Toronto-Dominion 2,85 % 03-08-2024	0,4
¹⁾ Fonds de revenu à taux variable IG Mackenzie, série P	0,4
OMERS Realty Corp. 1,30 % 22-09-2023	0,3
	19,2

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR*	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Contrats à terme sur des obligations Euro-Schatz (EUX)	(19,1)
Contrat à terme standardisé sur des obligations du Trésor américain à 5 ans (CBOT)	(11,0)
Contrat à terme sur des obligations du gouvernement du Japon à 10 ans (SGX Mini)	(3,3)
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF	–
Invesco Senior Loan ETF	–
	(33,4)

* Les positions vendeur se composent d'options souscrites et de positions vendeur sur contrats à terme standardisés sur les titres énumérés.

VALEUR LIQUIDATIVE TOTALE (EN MILLIERS DE DOLLARS) 3 873 475

FONDS HYPOTHÉCAIRE ET DE REVENU À COURT TERME IG MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 30 juin 2022

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

Positions acheteur

Créances hypothécaires	48,2
Obligations	45,9
Fonds négociés en bourse	1,0
Fonds communs de placement	0,4
Actions	0,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	3,6
	99,2

Positions vendeur

Obligations	(33,4)
-------------	--------

Autres éléments d'actif (de passif) net 34,2

Total 100,0

PRÊTS HYPOTHÉCAIRES PAR ANNÉE D'ÉCHÉANCE % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

2022	1,1
2023	3,1
2024	8,9
2025	11,7
2026	17,1
2027	6,3
	48,2

PAR TAUX D'INTÉRÊT % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

Inférieur à 2,5 %	22,7
2,5 - 3,0 %	18,4
3,0 - 3,5 %	6,0
Supérieur à 3,5 %	1,1
	48,2

OBLIGATIONS

RÉPARTITION SECTORIELLE % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

Obl. de sociétés	34,0
Gouvernement fédéral	4,8
Gouvernements provinciaux	3,3
Prêts à terme	3,1
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,4
Supranationales	0,2
Gouvernements étrangers	(33,3)
	12,5

NOTE DE CRÉDIT % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

AAA	5,7
AA	3,1
A	11,8
BBB	11,3
Inférieure à BBB	5,5
Sans note	8,5
	45,9

1) Pour le prospectus et d'autres renseignements concernant le ou les fonds sous-jacents du portefeuille, veuillez consulter les adresses suivantes : www.ig.ca/fr ou www.sedar.com.

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 30 juin 2022 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.