

FONDS PRIVÉ DE TITRES À REVENU FIXE PROFIL^{MC}

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2024

Aperçu du portefeuille

| RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|-----------------------------------------------------------|----------------------------|
| Obligations | 76,3 |
| Obligations | 67,0 |
| Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)* | 9,3 |
| Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)* | – |
| Options achetées** | – |
| Options vendues** | – |
| Biens immobiliers | 8,8 |
| Placements à court terme | 6,7 |
| Prêts hypothécaires | 5,2 |
| Fonds privés | 4,9 |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 0,4 |
| Swaps† | 0,1 |
| Actions | 0,1 |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie | 0,1 |
| Emprunts hypothécaires | (2,6) |

| RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|-----------------------------------------|----------------------------|
| Canada | 59,1 |
| États-Unis | 25,1 |
| Japon | 3,8 |
| Autre | 2,7 |
| Royaume-Uni | 2,3 |
| Îles Caïmans | 1,4 |
| Allemagne | 1,1 |
| Italie | 0,9 |
| Irlande | 0,9 |
| France | 0,5 |
| Israël | 0,4 |
| Suisse | 0,4 |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 0,4 |
| Pays-Bas | 0,4 |
| Australie | 0,3 |
| Danemark | 0,2 |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie | 0,1 |

| RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|-------------------------------------------------------------|----------------------------|
| Obligations de sociétés | 35,7 |
| Obligations d'État étrangères | 14,2 |
| Obligations provinciales | 11,6 |
| Obligations fédérales | 9,5 |
| Biens immobiliers | 8,8 |
| Services financiers | 5,2 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires | 4,9 |
| Fonds privés | 4,9 |
| Billets à escompte fédéraux à court terme | 3,8 |
| Billets à escompte de gouvernements étrangers à court terme | 2,9 |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 0,4 |
| Prêts à terme | 0,3 |
| Autre | 0,3 |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie | 0,1 |
| Emprunts hypothécaires | (2,6) |

| OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT†† | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|----------------------------------|----------------------------|
| AAA | 8,7 |
| AA | 10,4 |
| A | 14,4 |
| BBB | 12,3 |
| Inférieure à BBB | 5,3 |
| Sans note | 5,8 |

* Les valeurs théoriques représentent 9,3 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur) et –12,0 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

** Les valeurs théoriques représentent 15,2 % de la valeur liquidative des options achetées et –4,7 % de la valeur liquidative des options vendues.

† Les valeurs théoriques représentent 60,7 % de la valeur liquidative des swaps.

†† 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 par portefeuille, région ou secteur calculée en combinant les placements directs et indirects du Fonds.

FONDS PRIVÉ DE TITRES À REVENU FIXE PROFIL^{MC}

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 30 juin 2024

LES 25 PRINCIPALES

POSITIONS ACHETEUR % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

| Émetteur/Fonds sous-jacent | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|
| Fonds hypothécaire et de revenu à court terme IG Mackenzie, série P | 12,1 |
| Fonds de biens immobiliers IG Mackenzie, série P | 8,0 |
| Province de l'Ontario 4,15 % 02-06-2034 | 2,8 |
| Gouvernement du Canada, bon du Trésor 26-09-2024 | 2,4 |
| Bons du Trésor à escompte du Japon 17-09-2024 | 1,5 |
| Gouvernement du Canada 4,67 % 12-09-2024 | 1,4 |
| Banque Royale du Canada 4,70 % 02-07-2024 | 1,4 |
| Northleaf Private Credit II LP ¹⁾ | 1,3 |
| Bons du Trésor à escompte du Japon 01-07-2024 | 1,3 |
| Gouvernement du Canada 2,75 % 01-12-2055 | 1,2 |
| Province de Québec 4,40 % 01-12-2055 | 1,2 |
| Northleaf Senior Private Credit-L LP ¹⁾ | 1,1 |
| Bons du Trésor à escompte du Japon 08-07-2024 | 1,1 |
| Northleaf Senior Private Credit LP ¹⁾ | 1,1 |
| Gouvernement du Canada, bon du Trésor 29-08-2024 | 1,0 |
| Gouvernement du Canada 2,75 % 01-06-2033 | 1,0 |
| Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,12 % 15-04-2025 | 0,9 |
| Gouvernement du Canada 3,00 % 01-06-2034 | 0,9 |
| FINB Obligations canadiennes totales Mackenzie | 0,9 |
| FINB Obligations toutes sociétés canadiennes Mackenzie | 0,8 |
| Province de Québec 4,45 % 01-09-2034 | 0,8 |
| Bons du Trésor à escompte du Japon 05-08-2024 | 0,7 |
| Province de l'Alberta 3,10 % 01-06-2050 | 0,7 |
| Obligations du Trésor des États-Unis 05-09-2024 | 0,7 |
| PIMCO Corporate Opportunities Fund III Offshore Feeder LP | 0,6 |
| Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale | 46,9 |

LES 25 PRINCIPALES

POSITIONS VENDEUR % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

| Émetteur | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|
| Contrat à terme standardisé sur obligations du Trésor américain à long terme (CBOT) | — |
| Contrat à terme standardisé sur des obligations du Trésor américain à 5 ans (CBOT) | — |
| Contrat à terme standardisé SOFR de CME à 3 mois | — |
| Contrats à terme standardisés sur obligations Euro-Schatz | — |
| Contrat à terme standardisé sur des obligations Euro-BOBL (EUX) | — |
| Contrat à terme standardisé sur des obligations Euro-BUXL à 30 ans (EUX) | — |
| Contrat à terme standardisé sur obligations du Royaume-Uni (ICE) | — |
| Contrat à terme standardisé sur des obligations du Trésor ASX à 10 ans (SFE) | — |
| Contrat à terme standardisé sur des obligations du gouvernement du Japon à 10 ans (SGX Mini) | — |
| Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente souscrite @ 95,00 \$ éch. 17-07-2024 | — |
| Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale | — |
| Valeur liquidative totale du Fonds | 9,2 milliards \$ |

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

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.sedarplus.ca. L'émetteur des Fonds Mackenzie est lié au gestionnaire.

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 30 juin 2024 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.