

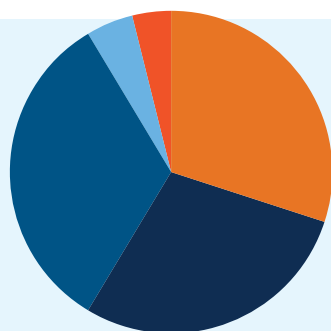
Indice Solactive EM USD Govt & Govt Related Bond Select CAD Hedged NTR

Cet indice fait l'objet d'un suivi par QEBH - FINB Obligations de marchés émergents Mackenzie (couvert en \$ CA)

Aperçu de l'indice

- Indice pondéré selon la valeur au marché fondé sur des règles pour mesurer le rendement des obligations d'État de marchés émergents libellées en \$ US.
- Couvert en dollars canadiens.
- Le classement d'un pays à titre de pays émergent est tributaire du cadre de classement des pays de Solactive, complété par la série en devise locale au moyen d'une évaluation de la négociabilité de chaque marché pour les investisseurs étrangers.
- L'indice est rééquilibré mensuellement, et la liste des marchés émergents éligibles est revue annuellement.

Caractéristiques de l'indice



Composition par échéance

■ 28,6 %	1 à 5 ans	■ 30,1 %	15+ ans
■ 32,7 %	5 à 10 ans	■ 3,7 %	Espèces et quasi-espèces
■ 4,9 %	10 à 15 ans		

Qualité du crédit : BBB

Durée effective : 7,81 ans

Rendement à l'échéance : 6,32 %

Coupon moyen : 5,29 %

Rendement des distributions : 6.47%

Source : Données du FNB QEBH utilisées comme approximation; Mackenzie, au 31 juillet 2020

Règles d'inclusion

Admissibilité du pays

- Ne comprend que les obligations émises par une entité souveraine ou liée à un gouvernement, ce qui comprend les émetteurs gouvernementaux régionaux et locaux, les entités détenues majoritairement par des gouvernements et des organismes gouvernementaux dotés d'un mandat public et (ou) d'une garantie de dette gouvernementale.

Montant en circulation

- Montant nominal à payer minimal de 500 millions \$ US/500 millions EUR.

Devises admissibles

- Les obligations doivent être émises en \$ US ou en euros, et le coupon et le capital de l'obligation sont payables dans la même devise.

Coupon

- Coupon nominal à taux fixe.



Règles d'inclusion

Échéance	<ul style="list-style-type: none">• Au moins 18 mois pour les nouvelles émissions intégrées dans l'indice.• Au moins 12 mois jusqu'à l'échéance finale.				
Types de titres	<table><tr><td>Inclus</td><td>Exclus</td></tr><tr><td><ul style="list-style-type: none">• Les obligations éligibles doivent comporter un prix disponible auprès d'un fournisseur de prix des obligations reconnu comme il est établi par le comité de l'indice.</td><td><ul style="list-style-type: none">• Bons du Trésor• Billets à taux variable• Obligations perpétuelles• Obligations indexées à l'inflation• Obligations hybrides et de capital bancaire• Obligations titrisées• Les émetteurs non souverains de Russie et d'Ukraine sont exclus.• Les pays dont la pondération totale est de moins de 0,3 % de tous les pays éligibles à chaque examen annuel en mai seront exclus.</td></tr></table>	Inclus	Exclus	<ul style="list-style-type: none">• Les obligations éligibles doivent comporter un prix disponible auprès d'un fournisseur de prix des obligations reconnu comme il est établi par le comité de l'indice.	<ul style="list-style-type: none">• Bons du Trésor• Billets à taux variable• Obligations perpétuelles• Obligations indexées à l'inflation• Obligations hybrides et de capital bancaire• Obligations titrisées• Les émetteurs non souverains de Russie et d'Ukraine sont exclus.• Les pays dont la pondération totale est de moins de 0,3 % de tous les pays éligibles à chaque examen annuel en mai seront exclus.
Inclus	Exclus				
<ul style="list-style-type: none">• Les obligations éligibles doivent comporter un prix disponible auprès d'un fournisseur de prix des obligations reconnu comme il est établi par le comité de l'indice.	<ul style="list-style-type: none">• Bons du Trésor• Billets à taux variable• Obligations perpétuelles• Obligations indexées à l'inflation• Obligations hybrides et de capital bancaire• Obligations titrisées• Les émetteurs non souverains de Russie et d'Ukraine sont exclus.• Les pays dont la pondération totale est de moins de 0,3 % de tous les pays éligibles à chaque examen annuel en mai seront exclus.				

Source : Solactive

Règles de rééquilibrage

Changements au sein de l'indice	<p>Les opérations sur le capital suivantes entraîneront des changements ou des rajustements à un indice au cours du mois :</p> <ul style="list-style-type: none">a) Remboursement anticipé ou remboursement completb) Opérations à taux nulc) Obligations en défautd) Offres publiques d'échange obligatoires
Réinvestissement des flux de trésorerie	<ul style="list-style-type: none">• Les flux de trésorerie au cours du mois provenant des paiements d'intérêts et de capital contribuent aux rendements mensuels de l'indice et sont investis directement dans l'indice à la date de prise d'effet.
Nouvelles émissions	<ul style="list-style-type: none">• Les titres admissibles émis, mais pas nécessairement réglés au plus tard à la date de rééquilibrage de fin de mois, peuvent être inclus dans l'indice le mois suivant si les renseignements sur les titres et leur prix sont immédiatement disponibles.

Source : Solactive



Tarification et questions connexes

Source et fréquence	<ul style="list-style-type: none">• L'indice est calculé et distribué une fois par jour ouvrable.
Moment	<ul style="list-style-type: none">• L'indice est calculé à 23 h HC chaque jour ouvrable.• Si le dernier jour ouvrable est un jour férié, les cours du jour ouvrable précédent sont utilisés.
Côté acheteur ou côté vendeur	<ul style="list-style-type: none">• Les obligations comprises dans l'indice sont cotées du côté acheteur.
Hypothèses de règlement	<ul style="list-style-type: none">• Les intérêts courus sont calculés à compter de la date de la convention de règlement (t+2).
Couverture de change	<ul style="list-style-type: none">• La méthode de couverture du risque de change de l'indice utilise les contrats à terme sur un mois qui sont refixés à la fin de chaque mois et couvre chaque obligation libellée en devises non assujettie de l'indice dans la devise assujettie. Aucun ajustement n'est apporté à la couverture pendant le mois pour tenir compte de la variation du prix des titres qui composent l'indice.
Calendrier	<ul style="list-style-type: none">• L'indice suit le calendrier des jours fériés comme il est recommandé par la SIFMA et les jours fériés de Target 2 en Europe.

Source : Solactive

Les placements dans les fonds négociés en bourse peuvent donner lieu à des commissions, des frais de gestion et d'autres frais. Veuillez lire le prospectus avant d'investir. Les fonds négociés en bourse ne sont pas garantis, leur valeur varie fréquemment et leur rendement antérieur peut ne pas se reproduire. Le contenu de ce commentaire (y compris les faits, les perspectives, les opinions, les recommandations, les descriptions de produits ou titres ou les références à des produits ou titres) ne doit pas être pris ni être interprété comme un conseil en matière de placement ni comme une offre de vente ou une sollicitation d'offre d'achat, ou une promotion, recommandation ou commandite de toute entité ou de tout titre cité. Bien que nous nous efforcions d'en assurer l'exactitude et l'exhaustivité, nous n'assumons aucune responsabilité quant à son utilisation.

Solactive AG ne parraine pas le FINB Obligations de marchés émergents Mackenzie (couvert en \$ CA), n'en fait pas la promotion et ne vend pas ses parts, ne l'appuie pas et ne donne aucune garantie, expresse ou implicite, quant aux résultats pouvant découler de l'utilisation de l'indice, des marques de commerce et/ou quant au prix de l'indice à quelque moment que ce soit ou à tout autre égard. L'indice Solactive EM USD Govt & Govt Related Bond Select CAD Hedged NTR est calculé et publié par Solactive AG. Solactive AG fait de son mieux pour s'assurer que l'indice est correctement comptabilisé. Sans égard à ses obligations envers l'émetteur, Solactive AG n'a aucunement l'obligation de signaler les erreurs dans l'indice aux tiers, y compris aux investisseurs et aux intermédiaires financiers du FINB Obligations de marchés émergents Mackenzie (couvert en \$ CA). La publication de l'indice par Solactive AG ou la concession de licence de l'indice, ou encore la marque de commerce de l'indice pour permettre de s'en servir relativement au FINB Obligations de marchés émergents Mackenzie (couvert en \$ CA) ne constitue pas une recommandation de Solactive AG d'investir le capital dans ledit FINB Obligations de marchés émergents Mackenzie (couvert en \$ CA) et ne représente pas non plus une garantie ni une opinion de Solactive AG en ce qui a trait aux placements effectués dans le FINB Obligations de marchés émergents Mackenzie (couvert en \$ CA).