

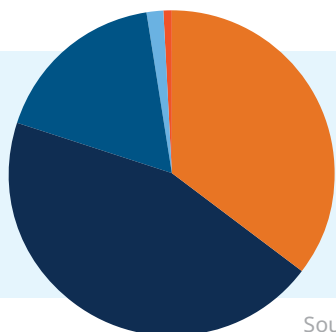
# Indice Solactive Canadian Select Universe Bond

Cet indice fait l'objet d'un suivi par QBB - FINB Obligations canadiennes totales Mackenzie

## Aperçu de l'indice

- Indice pondéré selon la valeur au marché fondé sur des règles pour mesurer le rendement du marché canadien des obligations de première qualité (obligations d'État et de sociétés).
- L'univers total est divisé entre l'univers des titres de sociétés (voir l'indice Solactive Canadian Select Corporate Bond) et l'univers des titres d'État.
- Dans l'univers des titres d'État, un processus en trois étapes est utilisé pour identifier les composantes de l'indice :
  - D'abord, chaque obligation est classée en fonction de sa durée effective jusqu'à l'échéance. La pondération pour chaque émission dans chaque catégorie d'échéance est calculée ainsi que le rendement pondéré et la durée pondérée.
  - Deuxièmement, les obligations qui composent 90 % des pondérations de l'univers des titres d'État sont prises en compte. Afin de limiter la rotation, seuls les émetteurs dont la pondération varie de plus de 3 % pourront être déplacés — comparativement à la sélection du mois précédent.
  - Troisièmement, l'écart absolu par obligation par rapport à la durée pondérée et au rendement pondéré respectifs par émission dans chaque catégorie d'échéance est calculé. Pour chaque obligation, des points sont attribués à partir de l'écart absolu sur la durée et de l'écart absolu sur le rendement. Pour chaque émission dans chaque catégorie d'échéance, les obligations sont classées en fonction de leurs points et seules les obligations avec le rang le plus élevé seront choisies en tant que composantes de l'indice.

## Caractéristiques de l'indice



### Composition par échéance

■ 44,8 %	1 à 5 ans	■ 35,4 %	15+ ans
■ 17,3 %	5 à 10 ans	■ 0,7 %	Espèces et quasi-espèces
■ 1,8 %	10 à 15 ans		

**Qualité du crédit : AA**  
**Durée effective : 7,65 ans**  
**Rendement à l'échéance : 1,05 %**  
**Coupon moyen : 3,07 %**  
**Rendement des distributions : 1,84 %**

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

## Règles d'inclusion

<b>Admissibilité du pays</b>	• Obligations de première qualité (obligations d'État et de sociétés) émises au Canada.
<b>Montant en circulation</b>	• Au moins 100 millions de dollars canadiens pour les obligations de sociétés et 50 millions de dollars canadiens pour les obligations d'État.
<b>Devises admissibles</b>	• Obligations émises au Canada et libellées en dollars canadiens.
<b>Coupon</b>	• Coupon nominal à taux fixe.
<b>Échéance</b>	• Au moins 12 mois jusqu'à l'échéance finale.
<b>Note</b>	• Note d'au moins BBB- ou l'équivalent chez S&P ou Moody's.



## Règles d'inclusion

### Types de titres

#### Inclus

- Pour que les obligations soient admissibles, un cours doit être obtenu auprès d'un fournisseur de cours obligataires reconnu, tel que déterminé par le comité des indices.

#### Exclus

- Obligations à taux variable
- Obligations convertibles
- Titres adossés à des créances hypothécaires
- Titres adossés à des créances mobilières
- Titres indexés sur l'inflation

Source : Solactive

## Règles de rééquilibrage

### Changements au sein de l'indice

Les opérations sur le capital suivantes entraîneront des changements ou des rajustements à un indice au cours du mois :

- a) Remboursement anticipé ou remboursement complet
- b) Opérations à taux nul
- c) Obligations en défaut
- d) Offres publiques d'échange obligatoires

### Réinvestissement des flux de trésorerie

- 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

- 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

- L'indice est calculé et distribué une fois par jour ouvrable.

### Moment

- 17 h (HE) ou à la fermeture du marché anticipé, le cas échéant.
- Si le dernier jour ouvrable est un jour férié, les cours du jour ouvrable précédent sont utilisés.

### Côté acheteur ou côté vendeur

- Les obligations comprises dans l'indice sont cotées du côté acheteur.

### Hypothèses de règlement

- Les intérêts courus sont calculés à compter de la date de la convention de règlement (t+2).

### Calendar

- L'indice suit le calendrier des jours fériés au Canada, conformément à la SIFMA.

Source : Solactive

Les placements dans les fonds négociés en bourse (FNB) peuvent donner lieu à des commissions, des frais de gestion et d'autres frais. Veuillez lire le prospectus avant d'investir. Les FNB ne sont pas garantis, leur valeur varie fréquemment, et leur rendement antérieur peut ne pas se reproduire. Le contenu de cette présentation (y compris les faits, les perspectives, les opinions, les recommandations, les descriptions de produits ou de titres, ou les références à des produits ou à des titres) ne doit pas être pris ni être interprété comme un conseil en matière de placement, ni comme une offre de vendre 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 canadiennes totales Mackenzie, 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. Solactive AG calcule et publie l'indice Solactive Canadian Select Universe Bond. Solactive AG fait de son mieux pour s'assurer que les calculs sont corrects. 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 canadiennes totales Mackenzie. 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 canadiennes totales Mackenzie ne constitue pas une recommandation de Solactive AG d'investir le capital dans ledit FINB Obligations canadiennes totales Mackenzie 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 canadiennes totales Mackenzie.