

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2018

Aperçu du portefeuille

Répartition effective du portefeuille	% de la valeur liquidative
Obligations	97,2
Obligations	97,2
Positions vendeur sur contrats à terme*	(0,0)
Trésorerie et placements à court terme	3,3
Actions	1,2
Options sur devises achetées**	0,0
Autres éléments d'actif (de passif)	(1,7)

Répartition régionale effective	% de la valeur liquidative
Canada	77,0
États-Unis	17,4
Trésorerie et placements à court terme	3,3
Royaume-Uni	1,6
Allemagne	0,7
Bermudes	0,4
Autres	0,4
Israël	0,3
Pays-Bas	0,2
Bahamas	0,1
Brésil	0,1
France	0,1
Luxembourg	0,1
Autres éléments d'actif (de passif)	(1,7)

Répartition sectorielle effective	% de la valeur liquidative
Obligations de sociétés	63,0
Obligations fédérales	12,5
Obligations provinciales	12,5
Prêts à terme	8,6
Trésorerie et placements à court terme	3,3
Produits industriels	1,2
Obligations d'État étrangères	0,6
Autres éléments d'actif (de passif)	(1,7)

Exposition nette effective aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar canadien	99,3
Dollar américain	0,5
Euro	0,1
Livre sterling	0,1

La répartition effective présente l'exposition du FNB par portefeuille, région ou secteur ou l'exposition nette aux devises calculée en combinant les placements directs et indirects du FNB.

Les 25 principaux titres acheteur

Émetteur/Fonds sous-jacent	% de la valeur liquidative
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, taux variable 15-03-2023	11,5
Province de l'Ontario, taux variable 27-06-2022	8,6
FNB de revenu à taux variable Mackenzie	3,9
FNB de revenu fixe à rendement élevé mondial Mackenzie	3,8
Province de l'Ontario 2,60 % 08-09-2023	2,7
Trésorerie et placements à court terme	2,4
Fortified Trust 1,67 % 23-07-2021	2,0
OMERS Realty Corp. 2,971 % 05-04-2021	1,9
Enbridge Inc. 3,19 % 05-12-2022	1,8
Industrielle Alliance, Assurance et services financiers inc. 2,80 % 16-05-2024, rachetables 2019	1,8
Banque Royale du Canada 2,95 % 01-05-2023	1,7
Bell Canada 3,00 % 03-10-2022, rachetables	1,7
Banque Canadienne de l'Ouest 2,74 % 16-06-2022	1,7
Allied Properties Real Estate Investment Trust 3,93 % 14-11-2022	1,7
Banque Manuvie du Canada 1,92 % 01-09-2021	1,6
Wells Fargo & Co. 2,51 % 27-10-2023	1,5
La Fédération des caisses Desjardins du Québec 2,09 % 17-01-2022	1,4
Dollarama inc., taux variable 16-03-2020	1,3
Banque HSBC Canada 3,25 % 15-09-2023	1,3
Chartwell résidences pour retraités 3,79 % 11-12-2023, rachetables 2023	1,3
Banque Laurentienne du Canada 2,81 % 13-06-2019	1,3
Capital Power Corp. 4,28 % 18-09-2024, rachetables 2024	1,3
Fiducie cartes de crédit Eagle 2,63 % 17-10-2022	1,3
Fiducie à terme de créances Hollis II 1,788 % 26-02-2020	1,3
Gaz Métro inc. 1,52 % 25-05-2020	1,3

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **62,1**

* Les valeurs du capital théorique représentent -6,4 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations américaines à 5 ans.

** Les valeurs du capital théorique représentent 3,9 % de la valeur liquidative des options sur devises achetées.

Pour le prospectus et d'autres renseignements concernant le ou les fonds sous-jacents du portefeuille, veuillez consulter les adresses suivantes : www.placementsmackenzie.com ou www.sedar.com.



Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 30 juin 2018

Les 25 principaux titres vendeur

Émetteur	% de la valeur liquidative
Contrats à terme sur obligations américaines à 5 ans*	(0,0)

Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(0,0)
--	--------------

Valeur liquidative totale du FNB **7,0 millions \$**

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 30 juin 2018 en raison des opérations de portefeuille continues du FNB. 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 FNB, où elles sont disponibles dans les 90 jours.

