

## 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](http://www.placementsmackenzie.com) ou [www.sedar.com](http://www.sedar.com).



## **Présentation trimestrielle du portefeuille** (suite)

Au 30 juin 2018

### **Les 25 principaux titres vendeur**

| <b>Émetteur</b>                                       | <b>% de la valeur liquidative</b> |
|---|-----------------------------------|
| Contrats à terme sur obligations américaines à 5 ans* | (0,0)                             |

|  |              |
|--|--------------|
| <b>Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale</b> | <b>(0,0)</b> |
|--|--------------|

**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.*

