

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2018

Aperçu du portefeuille

Répartition du portefeuille	% de la valeur liquidative
Obligations	82,0
Obligations	81,7
Options achetées*	0,3
Positions vendeur sur contrats à terme**	(0,0)
Trésorerie et placements à court terme	18,4
Actions	1,8
Actions	1,8
Options achetées†	0,0
Fonds/billets négociés en bourse	1,2
Options sur devises achetées††	0,0
Autres éléments d'actif (de passif)	(3,4)

Répartition régionale	% de la valeur liquidative
États-Unis	49,0
Canada	25,7
Trésorerie et placements à court terme	18,4
Autres	1,9
Pays-Bas	1,3
Royaume-Uni	1,3
Australie	1,2
Brésil	1,0
Bahamas	0,8
France	0,7
Colombie	0,5
Japon	0,4
Aruba	0,3
Irlande	0,3
Italie	0,3
Luxembourg	0,3
Autres éléments d'actif (de passif)	(3,4)

Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative
Obligations de sociétés	35,0
Prêts à terme	30,1
Trésorerie et placements à court terme	18,4
Obligations fédérales	8,4
Obligations d'État étrangères	7,5
Fonds/billets négociés en bourse	1,2
Obligations provinciales	0,7
Énergie	0,6
Services publics	0,5
Services financiers	0,4
Autres	0,3
Soins de santé	0,2
Consommation discrétionnaire	0,1
Autres éléments d'actif (de passif)	(3,4)

Exposition nette aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar canadien	96,4
Dollar américain	2,8
Real brésilien	0,4
Rouble russe	0,4

Les 25 principaux titres acheteur

Émetteur/Fonds sous-jacent	% de la valeur liquidative
Trésorerie et placements à court terme	18,4
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, taux variable 15-03-2023	4,0
Gouvernement du Canada 2,00 % 01-06-2028	3,8
Obligations du Trésor des États-Unis 2,25 % 15-11-2027	2,5
Obligations du Trésor des États-Unis 3,00 % 15-02-2048	1,7
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,2
McDermott Escrow 1 Inc. 10,63 % 01-05-2024, rachetables 2021	0,9
Rackspace Hosting Inc. 8,63 % 15-11-2024, rachetables 2019	0,9
Queensland Treasury Corp. 2,75 % 20-08-2027	0,8
Matterhorn Merger Sub LLC 8,50 % 01-06-2026, rachetables 2021	0,8
Arch Merger Sub Inc. 8,50 % 15-09-2025, rachetables 2020	0,8
Gibson Energy Inc. 5,25 % 15-07-2024, rachetables 2020	0,7
SRS Distribution Inc. 8,25 % 01-07-2026, rachetables 2021	0,7
California Resources Corp. 8,00 % 15-12-2022, rachetables 2018	0,7
Renfro Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 31-03-2021	0,7
Vidéotron Itée 5,75 % 15-01-2026, rachetables 2020	0,7
Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,50 % 22-03-2023	0,7
Calpine Corp. 5,25 % 01-06-2026, rachetables 2021	0,6
Obligations du Trésor du Royaume-Uni 4,25 % 07-12-2027	0,6
Numericable-SFR 6,00 % 15-05-2022, rachetables	0,6
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	0,6
Uber Technologies Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 13-07-2023	0,6
Banque Canadienne Impériale de Commerce 3,00 % 28-10-2024, rachetables 2019	0,6
Bell Canada 2,70 % 27-02-2024, rachetables	0,6
CCO Holdings LLC 5,13 % 01-05-2027, rachetables 2022	0,6

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **44,8**

* Les valeurs du capital théorique représentent 23,6 % de la valeur liquidative des options achetées.

** Les valeurs du capital théorique représentent -4,1 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans.

† Les valeurs du capital théorique représentent 0,3 % de la valeur liquidative des options achetées.

†† Les valeurs du capital théorique représentent 6,5 % 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 du Trésor américain à 10 ans**	(0,0)

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

Valeur liquidative totale du FNB **278,7 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.

