

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2018

Aperçu du portefeuille

Répartition du portefeuille	% de la valeur liquidative
Obligations	91,1
Obligations	91,1
Options achetées*	0,1
Positions vendeur sur contrats à terme**	(0,1)
Trésorerie et placements à court terme	5,0
Fonds/billets négociés en bourse	4,3
Actions	0,2
Options sur devises achetées†	0,0
Autres éléments d'actif (de passif)	(0,6)

Répartition régionale	% de la valeur liquidative
Canada	77,6
États-Unis	13,1
Trésorerie et placements à court terme	5,0
Royaume-Uni	2,1
Allemagne	0,9
Australie	0,6
Bermudes	0,5
Autres	0,4
France	0,2
Israël	0,2
Autres éléments d'actif (de passif)	(0,6)

Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative
Obligations de sociétés	64,0
Obligations provinciales	18,8
Prêts à terme	6,0
Trésorerie et placements à court terme	5,0
Fonds/billets négociés en bourse	4,3
Obligations fédérales	1,9
Obligations d'État étrangères	0,4
Autres	0,2
Autres éléments d'actif (de passif)	(0,6)

Exposition nette aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar canadien	99,8
Dollar américain	0,2

Les 25 principaux titres acheteur

Émetteur/Fonds sous-jacent	% de la valeur liquidative
Province de l'Ontario, taux variable 21-08-2023	10,9
Trésorerie et placements à court terme	5,0
FNB de revenu fixe à rendement élevé mondial Mackenzie	4,3
Province de l'Ontario 2,60 % 08-09-2023	3,7
Fortified Trust 1,67 % 23-07-2021	2,3
OMERS Realty Corp. 2,971 % 05-04-2021	2,2
Banque Royale du Canada 2,95 % 01-05-2023	2,0
Bell Canada 3,00 % 03-10-2022, rachetables	2,0
Banque Canadienne de l'Ouest 2,74 % 16-06-2022	2,0
Province de Québec 3,50 % 01-12-2022	1,8
Province de Terre-Neuve 3,00 % 02-06-2026	1,7
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, taux variable 15-09-2023	1,7
Banque HSBC Canada 3,25 % 15-09-2023	1,5
Chartwell résidences pour retraités 3,79 % 11-12-2023, rachetables 2023	1,5
Dollarama inc., taux variable 16-03-2020	1,5
Fiducie à terme de créances Hollis II 1,788 % 26-02-2020	1,5
Fiducie cartes de crédit Eagle 2,63 % 17-10-2022	1,5
Gaz Métro inc. 1,52 % 25-05-2020	1,5
Capital Power Corp. 4,28 % 18-09-2024, rachetables 2024	1,5
Fonds de placement immobilier H&R 2,92 % 06-05-2022	1,5
La Banque de Nouvelle-Écosse 1,90 % 02-12-2021	1,5
Banque Nationale du Canada 1,96 % 30-06-2022	1,5
Ventas Canada Finance Ltd. 2,55 % 15-03-2023, rachetables 2023	1,5
Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,50 % 22-03-2023	1,5
Inter Pipeline Ltd. 2,61 % 13-09-2023, rachetables	1,5

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **59,1**

* Les valeurs du capital théorique représentent 2,7 % de la valeur liquidative des options achetées.

** Les valeurs du capital théorique représentent -8,0 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations canadiennes à 5 ans.

† Les valeurs du capital théorique représentent 2,8 % 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 31 décembre 2018

Les 25 principaux titres vendeur

Émetteur	% de la valeur liquidative
Contrats à terme sur obligations canadiennes à 5 ans**	(0,1)

Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(0,1)
--	--------------

Valeur liquidative totale du FNB **5,9 millions \$**

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 31 décembre 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.

