

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2018

Aperçu du portefeuille

Répartition du portefeuille	% de la valeur liquidative
Obligations	88,6
Obligations	88,6
Positions vendeur sur contrats à terme*	0,0
Trésorerie et placements à court terme	7,8
Autres éléments d'actif (de passif)	2,3
Fonds/billets négociés en bourse	1,3
Options sur devises achetées**	0,0
Répartition régionale	% de la valeur liquidative
Canada	77,6
États-Unis	8,5
Trésorerie et placements à court terme	7,8
Autres éléments d'actif (de passif)	2,3
Royaume-Uni	1,1
Australie	0,8
Belgique	0,7
Nouvelle-Zélande	0,6
Danemark	0,3
Pays-Bas	0,2
Allemagne	0,1
Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative
Obligations de sociétés	48,0
Obligations provinciales	19,7
Obligations fédérales	16,3
Trésorerie et placements à court terme	7,8
Autres éléments d'actif (de passif)	2,3
Obligations d'État étrangères	1,9
Titres adossés à des créances hypothécaires	1,4
Fonds/billets négociés en bourse	1,3
Obligations supranationales	0,8
Titres adossés à des créances mobilières	0,5
Exposition nette aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar canadien	99,6
Dollar américain	0,4

* Les valeurs du capital théorique représentent -10,6 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans et -1,4 % de la valeur liquidative des contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME.

** Les valeurs du capital théorique représentent 6,0 % de la valeur liquidative des options sur devises achetées.

Les 25 principaux titres acheteur

Émetteur/Fonds sous-jacent	% de la valeur liquidative
Gouvernement du Canada 2,00 % 01-06-2028	8,4
Trésorerie et placements à court terme	7,8
Province de l'Ontario 2,90 % 02-06-2028	4,8
Gouvernement du Canada 1,25 % 01-12-2047, rendement réel	2,9
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1 2,35 % 15-06-2023	2,5
Province de l'Ontario 2,60 % 08-09-2023	2,5
Province de Québec 3,50 % 01-12-2048	2,4
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-12-2048	1,8
Obligations du Trésor des États-Unis 3,00 % 15-02-2048	1,6
Province de l'Ontario 2,90 % 02-12-2046	1,4
Banque Royale du Canada 2,95 % 01-05-2023	1,4
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,3
Banque Nationale du Canada 1,96 % 30-06-2022	1,1
La Banque Toronto-Dominion 1,91 % 18-07-2023	1,1
Fiducie d'actifs BNC 7,447 %, perpétuelles (taux variable @ 30-06-2020), rachetables 2020	1,0
Province de l'Ontario 2,80 % 02-06-2048	1,0
La Banque de Nouvelle-Écosse 2,29 % 28-06-2024	0,9
Banque Canadienne Impériale de Commerce 2,47 % 05-12-2022	0,9
Province de l'Ontario 0,00 % 02-06-2024	0,9
Province de Terre-Neuve 3,70 % 17-10-2048	0,8
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	0,8
Province du Manitoba 1,738 % 01-12-2018, rendement réel	0,7
Province de Québec 2,75 % 01-09-2028	0,7
OMERS Realty Corp. 3,24 % 04-10-2027, rachetables 2027	0,7
Banque de Montréal 2,70 % 11-09-2024	0,7
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	50,1

Les 25 principaux titres vendeur

Émetteur	% de la valeur liquidative
Contrats à terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans*	0,0
Contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME*	0,0
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	0,0
Valeur liquidative totale du Fonds	1,4 milliard \$

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.

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