

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2018

Aperçu du portefeuille

Répartition du portefeuille	% de la valeur liquidative
Actions	58,5
Obligations	36,7
Obligations	36,7
Positions vendeur sur contrats à terme*	0,0
Options achetées**	0,0
Fonds communs de placement	2,8
Trésorerie et placements à court terme	1,2
Fonds/billets négociés en bourse	0,6
Autres éléments d'actif (de passif)	0,2
Options sur devises achetées†	0,0

Répartition régionale	% de la valeur liquidative
Canada	61,4
États-Unis	24,2
Royaume-Uni	3,0
Japon	2,2
Corée du Sud	1,6
Chine	1,3
Trésorerie et placements à court terme	1,2
Australie	1,0
Zambie	0,8
Bermudes	0,6
Pays-Bas	0,6
Allemagne	0,6
Brésil	0,5
Belgique	0,3
Nouvelle-Zélande	0,3
Autres éléments d'actif (de passif)	0,2
Autres	0,2

Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative
Obligations de sociétés	16,2
Services financiers	14,0
Technologie de l'information	10,1
Consommation discrétionnaire	8,2
Énergie	7,5
Obligations fédérales	6,6
Obligations provinciales	6,2
Matières	6,0
Prêts à terme	5,8
Produits industriels	5,5
Consommation courante	3,5
Fonds communs de placement	2,8
Soins de santé	2,5
Autres	2,3
Obligations d'État étrangères	1,4
Trésorerie et placements à court terme	1,2
Autres éléments d'actif (de passif)	0,2

Exposition nette aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar canadien	81,7
Dollar américain	11,1
Autres	3,0
Won sud-coréen	1,6
Dollar de Hong Kong	1,3
Livre sterling	1,3

Les 25 principaux titres acheteur

Émetteur/Fonds sous-jacent	% de la valeur liquidative
Gouvernement du Canada 2,00 % 01-06-2028	3,5
La Banque Toronto-Dominion	2,7
Fonds d'opportunités en titres de créance mondiaux Mackenzie, série R	2,0
Province de Québec 3,50 % 01-12-2048	1,9
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-12-2048	1,9
Banque Royale du Canada	1,8
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	1,8
La Banque de Nouvelle-Écosse	1,4
Constellation Software Inc.	1,2
Magna International Inc.	1,2
Apple Inc.	1,2
Trésorerie et placements à court terme	1,2
Gouvernement du Canada 1,25 % 01-12-2047, rendement réel	1,2
T. Rowe Price Group Inc.	1,2
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée	1,1
Rogers Communications Inc.	1,1
Groupe CGI inc.	1,1
Enerplus Corp.	1,1
Alimentation Couche-Tard inc.	1,1
SK Hynix Inc.	1,1
Tourmaline Oil Corp.	1,0
Financière Sun Life inc.	1,0
Canfor Corp.	1,0
Le Groupe Stars inc.	0,9
Electrocomponents PLC	0,9

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **35,6**

* Les valeurs du capital théorique représentent -4,5 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans et -1,0 % de la valeur liquidative des contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME.

** Les valeurs du capital théorique représentent 0,9 % de la valeur liquidative des options achetées.

† Les valeurs du capital théorique représentent 2,6 % 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
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	349,0 millions \$

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.

