

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2018

Aperçu du portefeuille

Répartition effective du portefeuille	% de la valeur liquidative
Obligations	94,6
Obligations	94,6
Options achetées*	0,0
Positions vendeur sur contrats à terme**	(0,0)
Trésorerie et placements à court terme	3,3
Fonds/billets négociés en bourse	1,9
Actions	0,9
Options sur devises achetées†	0,0
Autres éléments d'actif (de passif)	(0,7)

Répartition régionale effective	% de la valeur liquidative
Canada	71,9
États-Unis	17,7
Trésorerie et placements à court terme	3,3
Royaume-Uni	2,3
Bermudes	1,6
Autres	1,0
Belgique	0,7
Australie	0,6
Danemark	0,3
Pays-Bas	0,3
Brésil	0,2
Nouvelle-Zélande	0,2
Allemagne	0,2
France	0,2
Luxembourg	0,1
Bahamas	0,1
Autres éléments d'actif (de passif)	(0,7)

Répartition sectorielle effective	% de la valeur liquidative
Obligations de sociétés	46,2
Obligations provinciales	20,3
Obligations fédérales	14,8
Prêts à terme	7,1
Obligations d'État étrangères	5,6
Trésorerie et placements à court terme	3,3
Fonds/billets négociés en bourse	1,9
Obligations supranationales	0,6
Énergie	0,4
Services publics	0,3
Services financiers	0,2
Autres éléments d'actif (de passif)	(0,7)

Exposition nette effective aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar canadien	100,3
Dollar américain	(0,3)

La répartition effective présente l'exposition du Fonds par portefeuille, région ou secteur ou l'exposition nette aux devises calculée en combinant les placements directs et indirects du Fonds.

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

** Les valeurs du capital théorique représentent -11,7 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans.

Les 25 principaux titres acheteur

Émetteur/Fonds sous-jacent	% de la valeur liquidative
Fonds d'opportunités en titres de créance mondiaux Mackenzie, série R	7,7
Province de l'Ontario 2,90 % 02-06-2028	4,2
Gouvernement du Canada 2,00 % 01-06-2028	3,9
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, taux variable 15-03-2023	3,8
Obligations du Trésor des États-Unis 3,00 % 15-02-2048	3,2
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-12-2048	3,0
Province de Québec 3,50 % 01-12-2048	3,0
Province de l'Ontario 2,60 % 08-09-2023	2,7
Gouvernement du Canada 1,25 % 01-12-2047, rendement réel	2,4
Province de l'Ontario, taux variable 27-06-2022	2,3
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,9
Trésorerie et placements à court terme	1,7
Banque Royale du Canada 2,95 % 01-05-2023	1,4
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1 2,35 % 15-06-2023	1,3
Province de Québec 2,75 % 01-09-2028	1,3
Banque Nationale du Canada 1,96 % 30-06-2022	1,3
Gouvernement des Bermudes 3,72 % 25-01-2027, rachetables 2026	1,1
Province de Terre-Neuve 3,70 % 17-10-2048	0,9
Province de l'Ontario 0,00 % 02-12-2023	0,9
Province de l'Ontario 2,90 % 02-12-2046	0,9
La Banque de Nouvelle-Écosse 2,29 % 28-06-2024	0,8
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	0,8
La Fédération des caisses Desjardins du Québec 2,09 % 17-01-2022	0,7
Fairfax Financial Holdings Ltd. 8,30 % 15-04-2026	0,7
Heathrow Funding Ltd. 3,25 % 21-05-2025	0,7

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **52,6**

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 Fonds **223,3 millions \$**

† Les valeurs du capital théorique représentent 6,6 % 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.

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.

