

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2018

Aperçu du portefeuille

Répartition du portefeuille	% de la valeur liquidative
Obligations	95,0
<i>Obligations</i>	95,3
<i>Positions vendeur sur contrats à terme*</i>	(0,3)
Trésorerie et placements à court terme	2,9
Fonds/billets négociés en bourse	1,3
Autres éléments d'actif (de passif)	0,7
Options sur devises achetées**	0,1

Répartition régionale	% de la valeur liquidative
Canada	84,6
États-Unis	8,4
Trésorerie et placements à court terme	2,9
Royaume-Uni	1,4
Australie	0,8
Autres éléments d'actif (de passif)	0,7
Nouvelle-Zélande	0,6
Pays-Bas	0,3
Danemark	0,3
Allemagne	0,2
Autres	(0,2)

Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative
Obligations de sociétés	49,9
Obligations provinciales	21,6
Obligations fédérales	18,2
Trésorerie et placements à court terme	2,9
Obligations d'État étrangères	2,9
Titres adossés à des créances hypothécaires	1,4
Fonds/billets négociés en bourse	1,3
Obligations supranationales	0,9
Autres éléments d'actif (de passif)	0,7
Titres adossés à des créances mobilières	0,4
Autres	(0,2)

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
Gouvernement du Canada 2,00 % 01-06-2028	6,3
Province de l'Ontario 2,90 % 02-06-2049	5,2
Province de l'Ontario 2,90 % 02-06-2028	5,2
Gouvernement du Canada 1,25 % 01-12-2047, rendement réel	3,0
Trésorerie et placements à court terme	2,9
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1 2,35 % 15-06-2023	2,8
Province de Québec 3,50 % 01-12-2048	2,5
Province de l'Ontario 2,60 % 08-09-2023	2,0
Obligations du Trésor des États-Unis 3,00 % 15-02-2048	1,8
Banque Royale du Canada 2,95 % 01-05-2023	1,5
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, taux variable 15-09-2023	1,4
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,3
Gouvernement du Canada 2,50 % 01-06-2024	1,2
Banque Nationale du Canada 1,96 % 30-06-2022	1,2
La Banque Toronto-Dominion 1,91 % 18-07-2023	1,1
Gouvernement du Canada 3,50 % 01-06-2020	1,1
Banque Royale du Canada 3,30 % 26-09-2023	1,0
Province de l'Ontario 0,00 % 02-06-2024	0,9
Province de Québec 2,75 % 01-09-2028	0,9
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-12-2048	0,9
Province de Terre-Neuve 3,70 % 17-10-2048	0,8
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	0,8
OMERS Realty Corp. 3,24 % 04-10-2027, rachetables 2027	0,8
Banque Canadienne Impériale de Commerce 2,97 % 11-07-2023	0,8
Banque de Montréal 2,70 % 11-09-2024	0,7

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **48,1**

* Les valeurs du capital théorique représentent -8,6 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations canadiennes à 10 ans.

** Les valeurs du capital théorique représentent 5,6 % 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 31 décembre 2018

Les 25 principaux titres vendeur

Émetteur	% de la valeur liquidative
Contrats à terme sur obligations canadiennes à 10 ans*	(0,3)

Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(0,3)
--	--------------

Valeur liquidative totale du Fonds **1,3 milliard \$**

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

