

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2018

Aperçu du portefeuille

Répartition effective du portefeuille	% de la valeur liquidative
Obligations	93,9
Obligations	94,0
Options achetées*	0,1
Options vendues*	(0,0)
Positions vendeur sur contrats à terme**	(0,2)
Trésorerie et placements à court terme	5,0
Actions	0,8
Autres éléments d'actif (de passif)	0,3
Options sur devises achetées†	0,0

Répartition régionale effective

Répartition régionale effective	% de la valeur liquidative
Canada	74,0
États-Unis	13,7
Trésorerie et placements à court terme	5,0
Royaume-Uni	2,1
Nouvelle-Zélande	1,1
Allemagne	0,9
Autres	0,8
Pays-Bas	0,7
Australie	0,5
Danemark	0,3
Autres éléments d'actif (de passif)	0,3
France	0,1
Luxembourg	0,1
Bahamas	0,1
Mexique	0,1
Irlande	0,1
Bermudes	0,1

Répartition sectorielle effective

Répartition sectorielle effective	% de la valeur liquidative
Obligations de sociétés	65,3
Obligations provinciales	14,4
Obligations fédérales	6,0
Trésorerie et placements à court terme	5,0
Prêts à terme	4,8
Obligations supranationales	1,7
Obligations d'État étrangères	1,5
Titres adossés à des créances mobilières	0,3
Énergie	0,3
Services publics	0,3
Autres éléments d'actif (de passif)	0,3
Services financiers	0,2
Autres	(0,1)

Exposition nette effective aux devises

Exposition nette effective aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar canadien	99,7
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 25 principaux titres acheteur

Émetteur/Fonds sous-jacent	% de la valeur liquidative
Province de l'Ontario, taux variable 21-08-2023	5,8
Province de l'Ontario 2,60 % 08-09-2023	5,1
Trésorerie et placements à court terme	4,4
Fonds d'opportunités en titres de créance mondiaux Mackenzie, série R	4,0
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1 2,35 % 15-06-2023	2,8
Bell Canada 3,00 % 03-10-2022, rachetables	2,6
Dollarama inc., taux variable 16-03-2020	2,1
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, taux variable 15-09-2023	1,6
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,6
Banque Royale du Canada 2,95 % 01-05-2023	1,5
Enbridge Inc. 3,19 % 05-12-2022	1,4
Banque Laurentienne du Canada, taux variable 24-04-2019	1,4
Fonds d'obligations tactique mondial Mackenzie, série R	1,3
La Banque Toronto-Dominion 1,91 % 18-07-2023	1,3
Banque HSBC Canada 2,17 % 29-06-2022	1,2
Banque Nationale du Canada 1,96 % 30-06-2022	1,2
Banque internationale pour la reconstruction et le développement 3,50 % 22-01-2021	1,1
Province de Terre-Neuve 3,00 % 02-06-2026	1,1
Banque Royale du Canada 3,30 % 26-09-2023	1,1
Fédération des caisses Desjardins du Québec 2,39 % 25-08-2022	1,1
Banque Canadienne Impériale de Commerce 3,30 % 26-05-2025	1,0
La Banque de Nouvelle-Écosse 2,98 % 17-04-2023	0,9
Genesis Trust II 1,699 % 15-04-2020	0,9
Crédit Toyota Canada Inc., taux variable 13-10-2020	0,9
JPMorgan Chase & Co. 3,19 % 05-03-2021	0,9

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **48,3**

* Les valeurs du capital théorique représentent 2,7 % de la valeur liquidative des options achetées et -0,6 % de la valeur liquidative des options vendues.

** Les valeurs du capital théorique représentent -11,8 % 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
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF	
option de vente souscrite @ 79,00 \$ éch. 18-04-2019*	(0,0)
Contrats à terme sur obligations canadiennes à 5 ans**	(0,2)
<hr/>	
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(0,2)

Valeur liquidative totale du Fonds **308,0 millions \$**

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.

