

CATÉGORIE PORTEFEUILLE PRUDENT SYMÉTRIE

PORTEFEUILLE DE GESTION DE L'ACTIF

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2018

Aperçu du portefeuille du Fonds sous-jacent*

| Répartition effective du portefeuille | % de la valeur liquidative |
|---|----------------------------|
| Obligations | 64,9 |
| Obligations | 54,1 |
| Positions acheteur sur contrats à terme** | 10,8 |
| Positions vendeur sur contrats à terme† | (0,0) |
| Actions | 33,0 |
| Actions | 31,9 |
| Positions acheteur sur contrats à terme†† | 1,0 |
| Positions vendeur sur contrats à terme§ | 0,1 |
| Trésorerie et placements à court terme§§ | 1,2 |
| Fonds/billets négociés en bourse | 0,7 |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 0,2 |
| Répartition régionale effective | % de la valeur liquidative |
| Canada | 58,7 |
| États-Unis | 24,1 |
| Autres | 5,4 |
| Royaume-Uni | 2,3 |
| Allemagne | 1,6 |
| Japon | 1,6 |
| Trésorerie et placements à court terme§§ | 1,2 |
| Australie | 1,2 |
| Chine | 0,7 |
| Pays-Bas | 0,6 |
| France | 0,5 |
| Suisse | 0,5 |
| Corée du Sud | 0,5 |
| Irlande | 0,3 |
| Hong Kong | 0,3 |
| Brésil | 0,3 |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 0,2 |
| Répartition sectorielle effective | % de la valeur liquidative |
| Obligations de sociétés | 29,3 |
| Obligations fédérales | 20,3 |
| Services financiers | 7,2 |
| Obligations d'État étrangères | 7,0 |
| Autres | 5,6 |
| Obligations provinciales | 4,5 |
| Produits industriels | 4,3 |
| Technologie de l'information | 3,6 |
| Énergie | 3,3 |
| Matières | 2,7 |
| Soins de santé | 2,5 |
| Prêts à terme | 2,4 |
| Consommation discrétionnaire | 2,3 |
| Consommation courante | 2,1 |
| Services de communication | 1,5 |
| Trésorerie et placements à court terme§§ | 1,2 |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 0,2 |
| Exposition nette effective aux devises | % de la valeur liquidative |
| Dollar canadien | 75,2 |
| Dollar américain | 17,9 |
| Autres | 2,6 |
| Euro | 1,8 |
| Livre sterling | 0,9 |
| Dollar de Hong Kong | 0,8 |
| Yen japonais | 0,8 |

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

Les 25 principaux titres acheteur du Fonds sous-jacent*

| Émetteur/Fonds sous-jacents | % de la valeur liquidative |
|---|----------------------------|
| Fonds d'obligations canadiennes Symétrie, série R | 35,5 |
| Fonds d'obligations mondiales Symétrie, série R | 13,2 |
| Fonds d'actions canadiennes Symétrie, série R | 13,0 |
| Fonds du marché monétaire canadien Mackenzie, série R | 12,2 |
| Fonds élargi d'actions Symétrie, série R | 12,1 |
| Fonds d'actions américaines Symétrie, série R | 3,3 |
| Fonds multistratégie à rendement absolu Mackenzie, série R | 2,8 |
| Trésorerie et placements à court terme | 1,4 |
| Fonds d'actions EAFE Symétrie, série R | 1,1 |
| Fonds d'obligations souveraines Mackenzie, série R | 1,0 |
| FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA) | 0,9 |
| Fonds à faible volatilité Symétrie, série R | 0,6 |
| Fonds mondial lié à l'inflation Mackenzie, série R | 0,6 |
| FINB Diversification maximale Canada Mackenzie | 0,5 |
| Fonds de grandes capitalisations des marchés émergents Mackenzie, série R | 0,4 |
| Fonds de petites capitalisations des marchés émergents Mackenzie, série R | 0,4 |
| FINB Diversification maximale Marchés développés mondiaux ex Amérique du Nord Mackenzie | 0,3 |
| Fonds d'obligations de sociétés Mackenzie, série R | 0,2 |
| WisdomTree CBOE S&P 500 PutWrite Strategy Fund | 0,2 |
| Contrats à terme sur obligations canadiennes à 10 ans** | 0,2 |
| iShares MSCI EAFE Small Cap Index Fund ETF | 0,0 |
| Fonds canadien d'obligations Mackenzie, série R | 0,0 |
| Contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME** | 0,0 |
| Contrats à terme sur obligations du Trésor du Commonwealth à 10 ans** | 0,0 |
| Contrats à terme sur euro-obligations** | 0,0 |

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **99,9**

* Le Fonds est actuellement entièrement investi dans le Portefeuille prudent Symétrie (le « Fonds sous-jacent »). Pour le prospectus et d'autres renseignements concernant le Fonds sous-jacent, veuillez consulter les adresses suivantes : www.placementsmackenzie.com ou www.sedar.com.

** Les valeurs du capital théorique représentent 5,7 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations canadiennes à 10 ans, 1,8 % de la valeur liquidative des contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME, 0,8 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations du Trésor du Commonwealth à 10 ans, 1,9 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur euro-obligations et 0,4 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations du Royaume-Uni.

† Les valeurs du capital théorique représentent -1,8 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans.

†† Les valeurs du capital théorique représentent 0,1 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur l'indice Mini MSCI Marchés émergents, 0,3 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur l'indice Mini Russell 2000 et 0,7 % de la valeur liquidative des contrats à terme libellés en yens sur l'indice Nikkei 225.



MACKENZIE
Placements

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2018

Les 25 principaux titres vendeur du Fonds sous-jacent*

| Émetteur | % de la valeur liquidative |
|--|----------------------------|
| Contrats à terme sur l'indice E-Mini S&P 500 [§] | 0,1 |
| Contrats à terme sur l'indice Euro STOXX 50 [§] | 0,0 |
| Contrats à terme sur l'indice S&P/TSX 60 [§] | 0,0 |
| Contrats à terme sur l'indice FTSE 100 [§] | (0,0) |
| 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 | 0,1 |
|--|------------|

| | |
|---|------------------------|
| Valeur liquidative totale du Fonds sous-jacent | 1,7 milliard \$ |
|---|------------------------|

| | |
|---|--------------------------|
| Valeur liquidative totale du Fonds | 544,4 millions \$ |
|---|--------------------------|

[§] Les valeurs du capital théorique représentent -2,9 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur l'indice E-Mini S&P 500, -0,1 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur l'indice Euro STOXX 50, -0,3 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur l'indice S&P/TSX 60 et -0,3 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur l'indice FTSE 100.

^{§§} Une portion de la répartition effective de la trésorerie du Fonds sous-jacent est investie dans des titres de série R d'un fonds du marché monétaire géré par Mackenzie.

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 31 décembre 2018 en raison des opérations de portefeuille continues du Fonds et du Fonds sous-jacent. 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.

