

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2020

Aperçu du portefeuille

Répartition effective du portefeuille % de la valeur liquidative

Obligations	97,6
Obligations	97,6
Positions vendeur sur contrats à terme*	(0,0)
Trésorerie et placements à court terme	1,2
Actions	0,7
Autres éléments d'actif (de passif)	0,5
Options sur devises achetées**	0,0

Répartition régionale effective % de la valeur liquidative

Canada	71,0
États-Unis	19,5
Royaume-Uni	2,8
Autre	1,3
Nouvelle-Zélande	1,3
Trésorerie et placements à court terme	1,2
Belgique	0,6
Autres éléments d'actif (de passif)	0,5
Irlande	0,4
Chine	0,3
Australie	0,2
Pays-Bas	0,2
Mexique	0,2
Pérou	0,2
Bermudes	0,1
Allemagne	0,1
Brésil	0,1

Répartition sectorielle effective % de la valeur liquidative

Obligations de sociétés	60,4
Obligations fédérales	17,8
Obligations provinciales	7,5
Obligations d'État étrangères	5,7
Prêts à terme	3,4
Titres adossés à des créances hypothécaires	1,5
Obligations supranationales	1,3
Trésorerie et placements à court terme	1,2
Autres éléments d'actif (de passif)	0,5
Services publics	0,3
Énergie	0,2
Services financiers	0,2

Exposition nette effective aux devises % de la valeur liquidative

Dollar canadien	97,4
Dollar américain	2,2
Yuan chinois	0,2
Yen japonais	0,1
Rouble russe	0,1

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 principales positions acheteur

Émetteur/Fonds sous-jacent % de la valeur liquidative

Fiducie du Canada pour l'habitation, taux variable 15-03-2024	13,3
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,50 % 15-04-2024	4,0
Province de l'Ontario 2,30 % 08-09-2024	2,8
Gouvernement du Canada 1,25 % 01-06-2030	2,4
Fonds à rendement absolu de titres de créance Mackenzie, série R	2,0
Fonds d'opportunités en titres de créance mondiaux Mackenzie, série R	1,9
Gouvernement du Canada 1,25 % 01-03-2025	1,8
Fonds d'obligations tactique mondial Mackenzie, série R	1,6
AltaLink, L.P. 3,67 % 06-11-2023	1,5
Heathrow Funding Ltd. 3,00 % 17-06-2023	1,4
Fédération des caisses Desjardins du Québec 2,39 % 25-08-2022	1,3
La Banque Toronto-Dominion 1,91 % 18-07-2023	1,3
Banque internationale pour la reconstruction et le développement 3,50 % 22-01-2021	1,3
Banque Canadienne Impériale de Commerce 2,97 % 11-07-2023	1,3
AltaLink, L.P. 3,40 % 06-06-2024, rachetables 2024	1,2
Province de la Colombie-Britannique 2,85 % 18-06-2025	1,1
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,1
Bank of America Corp., taux variable 25-04-2025, rachetables 2024	1,1
Banque HSBC Canada 2,17 % 29-06-2022	1,0
bCIMC Realty Corp. 3,00 % 31-03-2027, rachetables 2026	1,0
Banque Royale du Canada 2,95 % 01-05-2023	1,0
Banque de Montréal 2,70 % 11-09-2024	0,9
EPCOR Utilities Inc. 1,95 % 08-07-2022	0,9
OMERS Realty Corp. 3,24 % 04-10-2027, rachetables 2027	0,9
Charter Communications Operating LLC, taux variable 01-02-2024, rachetables 2024	0,9

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **49,0**

* Les valeurs du capital théorique représentent -0,3 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur euro-obligations à long terme du gouvernement italien (BTP).

** Les valeurs du capital théorique représentent 4,1 % 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 2020

Les 25 principales positions vendeur

Émetteur	% de la valeur liquidative
Contrats à terme sur euro-obligations à long terme du gouvernement italien (BTP)*	(0,0)
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(0,0)
Valeur liquidative totale du Fonds	259,5 millions \$

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 30 juin 2020 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.

