

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2020

Aperçu du portefeuille

Répartition effective du portefeuille	% de la valeur liquidative
Obligations	93,2
Obligations	89,3
Positions acheteur sur contrats à terme*	3,9
Positions vendeur sur contrats à terme**	(0,0)
Fonds communs de placement	2,8
Actions	1,7
Actions	1,6
Positions acheteur sur contrats à terme†	0,1
Autres éléments d'actif (de passif)	1,2
Trésorerie et placements à court terme††	1,1

Répartition régionale effective	% de la valeur liquidative
Canada	66,2
États-Unis	19,2
Allemagne	3,9
Royaume-Uni	1,8
Japon	1,7
Autre	1,6
France	1,4
Autres éléments d'actif (de passif)	1,2
Trésorerie et placements à court terme†	1,1
Marges de compte	0,5
Belgique	0,3
Australie	0,3
Pays-Bas	0,3
Chine	0,2
Corée du Sud	0,1
Mexique	0,1
Nouvelle-Zélande	0,1

Répartition sectorielle effective	% de la valeur liquidative
Obligations de sociétés	42,9
Obligations fédérales	21,0
Obligations provinciales	13,5
Obligations d'État étrangères	11,8
Autre	3,1
Fonds communs de placement	2,8
Autres éléments d'actif (de passif)	1,2
Trésorerie et placements à court terme†	1,1
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,7
Prêts à terme	0,5
Titres adossés à des créances mobilières	0,5
Services financiers	0,3
Technologie de l'information	0,3
Produits industriels	0,1
Soins de santé	0,1
Matières	0,1

Exposition nette effective aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar canadien	98,7
Dollar américain	3,4
Autre	(2,1)

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
Fonds d'obligations canadiennes Symétrie, série R	54,1
Fonds d'obligations souveraines Mackenzie, série R	12,7
Fonds mondial lié à l'inflation Mackenzie, série R	9,6
iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF	6,0
Fonds d'obligations de sociétés nord-américaines Mackenzie, série R	4,3
Fonds du marché monétaire canadien Mackenzie, série R	3,1
Fonds de primes de risque améliorées sur titres à revenu fixe Mackenzie, série R	1,8
FINB Obligations toutes sociétés canadiennes Mackenzie	1,6
Fonds global macro Mackenzie, série R	1,2
Trésorerie et placements à court terme	1,0
Fonds multistratégie à rendement absolu Mackenzie, série R	0,9
FINB Obligations de marchés émergents Mackenzie (couvert en \$ CA)	0,8
Fonds d'actions canadiennes Symétrie, série R	0,5
Fonds d'actions américaines Symétrie, série R	0,3
Fonds élargi d'actions Symétrie, série R	0,3
SPDR Bloomberg Barclays Capital High Yield Bond ETF	0,3
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	0,2
Fonds de petites capitalisations des marchés émergents Mackenzie, série R	0,2
Fonds de grandes capitalisations des marchés émergents Mackenzie, série R	0,2
Fonds mondial de dividendes Mackenzie, série R	0,1
Fonds d'obligations mondiales Symétrie, série R	0,1
iShares Core S&P 500 ETF	0,1
Fonds de perception de primes de risque diversifiées Mackenzie, série R	0,0
Fonds quantitatif américain de grandes capitalisations Mackenzie, série R	0,0
Fonds quantitatif américain de petites capitalisations Mackenzie, série R	0,0

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **99,4**

* Les valeurs du capital théorique représentent 1,6 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations canadiennes à 10 ans, 2,1 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations du Royaume-Uni et 0,2 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur euro-obligations.

** Les valeurs du capital théorique représentent -2,7 % 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 S&P/TSX 60.

†† Une portion de la répartition effective de la trésorerie du Fonds est investie dans des titres de série R d'un fonds du marché monétaire géré par Mackenzie.

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 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 **295,3 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.

