

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2020

Aperçu du portefeuille du Fonds sous-jacent*

| Répartition effective du portefeuille | % de la valeur liquidative |
|---|----------------------------|
| Actions | 51,0 |
| Obligations | 45,8 |
| Obligations | 45,8 |
| Options achetées** | 0,0 |
| Options vendues** | (0,0) |
| Positions vendeur sur contrats à terme [†] | (0,0) |
| Trésorerie et placements à court terme | 2,9 |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 0,3 |
| Options sur devises achetées ^{††} | 0,0 |

| Répartition régionale effective | % de la valeur liquidative |
|--|----------------------------|
| Canada | 44,2 |
| États-Unis | 32,7 |
| Autre | 3,4 |
| Royaume-Uni | 3,1 |
| Trésorerie et placements à court terme | 2,9 |
| France | 2,0 |
| Japon | 2,0 |
| Chine | 1,9 |
| Pays-Bas | 1,9 |
| Suisse | 1,8 |
| Allemagne | 1,3 |
| Irlande | 0,8 |
| Danemark | 0,5 |
| Taiwan | 0,4 |
| Australie | 0,4 |
| Suède | 0,4 |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 0,3 |

| Répartition sectorielle effective | % de la valeur liquidative |
|--|----------------------------|
| Obligations de sociétés | 29,9 |
| Services financiers | 13,9 |
| Prêts à terme | 7,2 |
| Technologie de l'information | 5,8 |
| Produits industriels | 5,2 |
| Consommation courante | 4,9 |
| Services de communication | 4,6 |
| Obligations d'État étrangères | 4,5 |
| Consommation discrétionnaire | 3,5 |
| Matières | 3,4 |
| Autre | 3,3 |
| Soins de santé | 3,2 |
| Énergie | 3,2 |
| Trésorerie et placements à court terme | 2,9 |
| Obligations fédérales | 2,2 |
| Obligations provinciales | 2,0 |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 0,3 |

| Exposition nette effective aux devises | % de la valeur liquidative |
|--|----------------------------|
| Dollar canadien | 69,0 |
| Dollar américain | 17,6 |
| Euro | 4,8 |
| Autre | 2,5 |
| Yen japonais | 2,0 |
| Franc suisse | 1,8 |
| Livre sterling | 1,3 |
| Yuan chinois | 1,0 |

Les 25 principales positions acheteur du Fonds sous-jacent*

| Émetteur/Fonds sous-jacent | % de la valeur liquidative |
|---|----------------------------|
| FNB de revenu fixe à rendement élevé mondial Mackenzie | 6,5 |
| Trésorerie et placements à court terme | 2,5 |
| La Banque Toronto-Dominion | 2,2 |
| Banque Royale du Canada | 2,0 |
| La Banque de Nouvelle-Écosse | 1,6 |
| Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,75 % 15-07-2028 | 1,6 |
| Fairfax Financial Holdings Ltd. 5,84 % 14-10-2022 | 1,1 |
| Enbridge Inc. | 1,1 |
| iShares S&P/TSX 60 Index ETF | 1,1 |
| Fonds à rendement absolu de titres de créance Mackenzie, série R | 1,0 |
| Gouvernement du Canada 1,25 % 01-06-2030 | 0,9 |
| TELUS Corp. | 0,9 |
| Gouvernement du Canada 2,00 % 01-12-2051 | 0,9 |
| Microsoft Corp. | 0,9 |
| Open Text Corp. | 0,9 |
| FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA) | 0,8 |
| Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada | 0,8 |
| Deutsche Börse AG | 0,8 |
| Banque de Montréal | 0,7 |
| Nestlé SA | 0,7 |
| Amazon.com Inc. | 0,7 |
| Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,00 % 15-02-2049 | 0,7 |
| Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027 | 0,7 |
| George Weston ltée | 0,6 |
| Restaurant Brands International Inc. | 0,6 |

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **32,3**

* Le Fonds est actuellement entièrement investi dans le Fonds de revenu stratégique Mackenzie (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 1,3 % de la valeur liquidative des options achetées et -1,2 % de la valeur liquidative des options vendues.

† Les valeurs du capital théorique représentent -0,6 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur euro-obligations à long terme du gouvernement italien (BTP).

†† Les valeurs du capital théorique représentent 9,3 % de la valeur liquidative des options sur devises achetées.

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.



Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 30 juin 2020

Les 25 principales positions vendeur du Fonds sous-jacent*

| Émetteur | % de la valeur liquidative |
|--|----------------------------|
| Contrats à terme sur euro-obligations à long terme du gouvernement italien (BTP) [†] | (0,0) |
| iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF option de vente souscrite @ 70,00 \$ éch. 18-09-2020** | (0,0) |
| iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF option de vente souscrite @ 71,00 \$ éch. 18-09-2020** | (0,0) |
| iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF option de vente souscrite @ 74,00 \$ éch. 21-08-2020** | (0,0) |
| iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF option de vente souscrite @ 65,00 \$ éch. 21-08-2020** | (0,0) |
| Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale | (0,0) |
| Valeur liquidative totale du Fonds sous-jacent | 2,1 milliards \$ |
| Valeur liquidative totale du Fonds | 169,5 millions \$ |

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

