

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2020

Aperçu du portefeuille

Répartition effective du portefeuille	% de la valeur liquidative
Obligations	46,2
<i>Obligations</i>	45,7
<i>Positions acheteur sur contrats à terme*</i>	0,5
<i>Positions vendeur sur contrats à terme**</i>	(0,0)
Actions	43,8
<i>Actions</i>	38,3
<i>Positions acheteur sur contrats à terme†</i>	5,5
<i>Positions vendeur sur contrats à terme††</i>	(0,0)
Trésorerie et placements à court terme	5,7
Fonds communs de placement	2,4
Autres éléments d'actif (de passif)	1,9
Répartition régionale effective	% de la valeur liquidative
Canada	54,6
États-Unis	24,7
Trésorerie et placements à court terme	5,7
Autre	5,5
Autres éléments d'actif (de passif)	1,9
Royaume-Uni	1,2
Japon	1,2
Chine	0,9
Allemagne	0,8
France	0,7
Suisse	0,6
Pays-Bas	0,6
Corée du Sud	0,5
Australie	0,4
Taïwan	0,4
Indonésie	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.

Répartition sectorielle effective	% de la valeur liquidative
Obligations de sociétés	23,9
Services financiers	9,7
Autre	9,3
Obligations fédérales	8,9
Obligations provinciales	6,1
Obligations d'État étrangères	5,7
Trésorerie et placements à court terme	5,7
Technologie de l'information	5,2
Produits industriels	4,3
Matières	4,1
Soins de santé	2,9
Consommation courante	2,8
Énergie	2,7
Fonds communs de placement	2,4
Services de communication	2,3
Consommation discrétionnaire	2,1
Autres éléments d'actif (de passif)	1,9
Exposition nette effective aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar canadien	81,8
Dollar américain	17,7
Livre sterling	1,4
Autre	(0,9)

* Les valeurs du capital théorique représentent 0,0 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations du Royaume-Uni et 0,3 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations canadiennes à 10 ans.

** Les valeurs du capital théorique représentent -2,0 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans, -0,1 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations du Trésor du Commonwealth à 10 ans.

† La valeur du capital théorique représentent 5,1 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur l'indice S&P/TSX 60, 0,0 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur l'indice FTSE 100, 0,4 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur l'indice Euro STOXX 50 et 0,0 % de la valeur liquidative des contrats à terme libellés en yens sur l'indice Nikkei 225.

†† Les valeurs du capital théorique représentent -0,6 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur l'indice E-Mini S&P 500 et -0,4 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur l'indice Mini MSCI Marchés émergents.

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 acheteur

Émetteur/Fonds sous-jacent	% de la valeur liquidative
Fonds d'actions canadiennes Symétrie, série R	24,8
Fonds d'obligations canadiennes Symétrie, série R	23,8
Fonds d'obligations mondiales Symétrie, série R	8,9
Fonds d'actions américaines Symétrie, série R	6,4
Fonds élargi d'actions Symétrie, série R	5,2
Fonds d'obligations de sociétés nord-américaines Mackenzie, série R	4,8
Vanguard Value ETF	3,1
iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF	2,9
Fonds d'obligations souveraines Mackenzie, série R	2,4
FINB Obligations de marchés émergents Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,9
Fonds multistratégie à rendement absolu Mackenzie, série R	1,9
Trésorerie et placements à court terme	1,7
Fonds global macro Mackenzie, série R	1,6
FINB Actions canadiennes Mackenzie	1,3
Fonds mondial lié à l'inflation Mackenzie, série R	1,2
Fonds mondial de dividendes Mackenzie, série R	1,1
Fonds de primes de risque améliorées sur titres à revenu fixe Mackenzie, série R	0,9
Fonds de petites capitalisations des marchés émergents Mackenzie, série R	0,9
Fonds quantitatif international de grandes capitalisations Mackenzie, série R	0,8
Fonds de grandes capitalisations des marchés émergents Mackenzie, série R	0,6
Fonds à faible volatilité Symétrie, série R	0,4
Fonds de perception de primes de risque diversifiées Mackenzie, série R	0,4
Fonds international de dividendes Mackenzie, série R	0,4
Fonds de primes de risque améliorées sur actions Mackenzie, série R	0,2
Fonds quantitatif américain de grandes capitalisations Mackenzie, série R	0,2
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	97,8

Les 25 principales positions vendeur

Émetteur	% de la valeur liquidative
Contrats à terme sur l'indice E-Mini S&P 500 ^{††}	(0,0)
Contrats à terme sur l'indice Mini MSCI Marchés émergents ^{††}	(0,0)
Contrats à terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans ^{**}	(0,0)
Contrats à terme sur euro-obligations ^{**}	(0,0)
Contrats à terme sur obligations du Trésor du Commonwealth à 10 ans ^{**}	(0,0)
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(0,0)
Valeur liquidative totale du Fonds	2,2 milliards \$

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.

