

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2020

Aperçu du portefeuille

Répartition effective du portefeuille	% de la valeur liquidative
Obligations	98,5
Obligations	82,3
Positions acheteur sur contrats à terme*	16,2
Options achetées**	0,0
Options vendues**	(0,0)
Positions vendeur sur contrats à terme†	(0,0)
Actions	1,1
Autres éléments d'actif (de passif)	0,8
Options sur devises achetées††	0,0
Swaps§	0,0
Trésorerie et placements à court terme	(0,4)

Répartition régionale effective	% de la valeur liquidative
États-Unis	45,4
Canada	17,8
Autre	7,7
Chine	6,9
Australie	5,9
Mexique	3,6
Israël	2,2
Japon	1,7
Bermudes	1,7
Allemagne	1,5
Russie	1,3
Bahamas	1,2
Chili	0,9
Grèce	0,9
Brésil	0,9
Autres éléments d'actif (de passif)	0,8
Trésorerie et placements à court terme	(0,4)

Répartition sectorielle effective	% de la valeur liquidative
Obligations d'État étrangères	58,6
Obligations de sociétés	27,6
Prêts à terme	7,5
Obligations provinciales	2,0
Autre	1,9
Obligations fédérales	0,8
Autres éléments d'actif (de passif)	0,8
Services publics	0,5
Énergie	0,4
Services financiers	0,2
Obligations supranationales	0,1
Trésorerie et placements à court terme	(0,4)

Exposition nette effective aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar canadien	84,3
Yuan chinois	7,0
Dollar américain	3,5
Yen japonais	2,3
Autre	1,9
Rouble russe	1,0

* Les valeurs du capital théorique représentent 13,0 % de la valeur liquidative des contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans, 1,9 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations américaines à long terme et 1,4 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations du Trésor du Commonwealth à 10 ans.

** Les valeurs du capital théorique représentent 3,6 % de la valeur liquidative des options achetées et -3,3 % de la valeur liquidative des options vendues.

† Les valeurs du capital théorique représentent -2,5 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations Euro-Buxl à 30 ans, -1,2 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur euro-obligations à long terme du gouvernement italien (BTP) et -2,5 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur euro-obligations.

†† Les valeurs du capital théorique représentent 47,2 % de la valeur liquidative des options sur devises achetées.

§ Les valeurs du capital théorique représentent 1,1 % de la valeur liquidative des swaps sur paniers d'actions.

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.

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
Trésorerie et placements à court terme	15,6
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,01 % 15-02-2048	5,5
Gouvernement de la Chine 3,13 % 21-11-2029	3,8
Gouvernement de l'Australie 1,00 % 21-12-2030	3,7
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,00 % 15-02-2049	3,4
Gouvernement de la Chine 3,29 % 23-05-2029	3,0
FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	2,9
Obligations du Trésor des États-Unis 2,00 % 15-02-2050	2,4
Banque d'Israël 0 % 02-12-2020	1,8
Province de l'Ontario 2,60 % 02-06-2025	1,7
Gouvernement du Mexique 7,50 % 03-06-2027	1,7
Gouvernement du Japon 0 % 22-02-2021	1,7
FNB de revenu fixe à rendement élevé mondial Mackenzie	1,6
FNB de revenu à taux variable Mackenzie	1,5
Deutsche Bundesrepublik, obligations indexées sur l'inflation 0,50 % 15-04-2030	1,5
Apple Inc. 2,51 % 19-08-2024, rachetables 2024	1,3
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	1,2
Gouvernement des Bermudes 4,85 % 06-02-2024	1,1
FINB Obligations américaines à rendement élevé Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,1
Gouvernement de l'Australie 2,50 % 21-05-2030	1,1
Gouvernement de l'Australie-Méridionale 3,00 % 24-05-2028	1,0
Commonwealth of Bahamas 5,75 % 16-01-2024	1,0
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,0
FINB Obligations de marchés émergents Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,0
Gouvernement de la Grèce 3,88 % 12-03-2029	0,9
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	62,5

Les 25 principales positions vendeur

Émetteur	% de la valeur liquidative
Contrats à terme sur obligations Euro-Buxl à 30 ans [†]	(0,0)
Contrats à terme sur euro-obligations à long terme du gouvernement italien (BTP) [†]	(0,0)
Contrats à terme sur euro-obligations [†]	(0,0)
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF option de vente souscrite @ 74,00 \$ éch. 17-07-2020**	(0,0)
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(0,0)
Valeur liquidative totale du Fonds	215,9 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.

