

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2020

Aperçu du portefeuille

Répartition effective du portefeuille	% de la valeur liquidative
Obligations	87,7
Obligations	87,3
Options achetées*	0,5
Positions vendeur sur contrats à terme**	(0,0)
Options vendues*	(0,1)
Trésorerie et placements à court terme	10,9
Actions	1,0
Autres éléments d'actif (de passif)	0,4
Options sur devises achetées†	0,0

Répartition régionale effective	% de la valeur liquidative
États-Unis	42,3
Canada	30,1
Trésorerie et placements à court terme	10,9
Japon	3,5
Autre	3,2
Australie	2,0
Chine	2,0
Royaume-Uni	1,8
Pays-Bas	0,9
Mexique	0,7
France	0,4
Irlande	0,4
Russie	0,4
Bésil	0,4
Autres éléments d'actif (de passif)	0,4
Luxembourg	0,3
Israël	0,3

Répartition sectorielle effective	% de la valeur liquidative
Obligations de sociétés	45,2
Obligations d'État étrangères	22,7
Trésorerie et placements à court terme	10,9
Prêts à terme	10,5
Obligations fédérales	5,5
Obligations provinciales	3,3
Autres éléments d'actif (de passif)	0,4
Autre	0,4
Énergie	0,3
Consommation discrétionnaire	0,3
Services publics	0,2
Services financiers	0,2
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,1

Exposition nette effective aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar canadien	86,6
Dollar américain	5,8
Yen japonais	3,5
Autre	2,2
Yuan chinois	1,9

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
Trésorerie et placements à court terme	10,6
Obligations du Trésor des États-Unis 1,75 % 30-06-2024	5,6
FINB Obligations à court terme canadiennes Mackenzie	4,4
Gouvernement du Japon 1,30 % 20-03-2021	3,5
Obligations du Trésor des États-Unis 2,00 % 15-02-2050	3,2
FINB Obligations toutes sociétés canadiennes Mackenzie	2,9
Gouvernement de la Chine 3,13 % 21-11-2029	1,9
FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	1,8
Gouvernement de l'Australie 1,00 % 21-12-2030	1,7
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,75 % 15-07-2028	1,7
Fonds à rendement absolu de titres de créance Mackenzie, série R	1,7
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,4
Gouvernement du Canada 1,25 % 01-06-2030	1,2
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	1,2
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,00 % 15-02-2049	1,0
Fiducie du Canada pour l'habitation, taux variable 15-03-2024	0,9
FINB Obligations de marchés émergents Mackenzie (couvert en \$ CA)	0,9
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,25 % 15-02-2050	0,7
Uber Technologies Inc. 8,00 % 01-11-2026, rachetables 2021	0,7
Inter Pipeline Ltd., taux variable 26-03-2079, rachetables 2029	0,6
Gibson Energy Inc. 5,25 % 15-07-2024, rachetables 2020	0,6
eG Global Finance PLC 6,75 % 07-02-2025, rachetables 2021	0,5
HCA Healthcare Inc. 3,50 % 01-09-2030, rachetables 2030	0,5
Province de l'Ontario 2,65 % 02-12-2050	0,5
Panther BF Aggregator 2 LP 8,50 % 15-05-2027, rachetables 2022	0,5

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **50,2**

* Les valeurs du capital théorique représentent 21,8 % de la valeur liquidative des options achetées et -19,5 % de la valeur liquidative des options vendues.

** Les valeurs du capital théorique représentent -1,2 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur euro-obligations à long terme du gouvernement italien (BTP).

† Les valeurs du capital théorique représentent 17,2 % 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
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF option de vente souscrite @ 74,00 \$ éch. 21-08-2020*	(0,1)
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF option de vente souscrite @ 70,00 \$ éch. 18-09-2020*	(0,0)
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 @ 71,00 \$ éch. 18-09-2020*	(0,0)
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF option de vente souscrite @ 72,00 \$ éch. 18-09-2020*	(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	(0,1)

Valeur liquidative totale du Fonds **2,6 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.

