

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2020

Aperçu du portefeuille

Répartition du portefeuille	% de la valeur liquidative
Actions	55,8
Obligations	40,1
Obligations	32,9
Positions acheteur sur contrats à terme*	7,2
Options achetées**	0,0
Options vendues**	(0,0)
Positions vendeur sur contrats à terme†	(0,0)
Fonds/billets négociés en bourse	3,3
Autres éléments d'actif (de passif)	0,5
Fonds communs de placement	0,4
Options sur devises achetées††	0,0
Swaps§	0,0
Trésorerie et placements à court terme	(0,1)

Répartition régionale	% de la valeur liquidative
États-Unis	46,3
Canada	9,1
Autre	5,9
Chine	4,7
Allemagne	4,1
Royaume-Uni	4,0
Suisse	3,7
Japon	3,6
France	3,4
Autres pays d'Europe	3,4
Australie	3,2
Pays-Bas	2,6
Hong Kong	1,4
Suède	1,4
Mexique	1,4
Irlande	1,3
Autres éléments d'actif (de passif)	0,5

Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative
Obligations d'État étrangères	26,4
Technologie de l'information	11,5
Obligations de sociétés	10,6
Services financiers	9,9
Produits industriels	8,4
Consommation courante	7,7
Soins de santé	7,2
Matières	4,9
Consommation discrétionnaire	3,9
Fonds/billets négociés en bourse	3,3
Prêts à terme	1,7
Services de communication	1,3
Obligations provinciales	1,0
Autre	0,9
Immobilier	0,9
Autres éléments d'actif (de passif)	0,5
Trésorerie et placements à court terme	(0,1)

Exposition nette aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar américain	66,8
Euro	11,5
Franc suisse	3,8
Yen japonais	3,7
Yuan chinois	3,5
Livre sterling	2,9
Autre	2,5
Dollar de Hong Kong	2,4
Dollar canadien	1,8
Couronne danoise	1,1

* Les valeurs du capital théorique représentent 5,6 % de la valeur liquidative des contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans, 1,0 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations américaines à long terme et 0,6 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations du Trésor du Commonwealth à 10 ans.

** Les valeurs du capital théorique représentent 1,6 % de la valeur liquidative des options achetées et -1,5 % de la valeur liquidative des options vendues.

† Les valeurs du capital théorique représentent -0,9 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations Euro-Buxl à 30 ans, -2,1 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur euro-obligations et -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 21,2 % de la valeur liquidative des options sur devises achetées.

§ Les valeurs du capital théorique représentent 0,5 % de la valeur liquidative des swaps sur paniers d'actions.

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	7,2
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,01 % 15-02-2048	2,1
Microsoft Corp.	2,1
Gouvernement de la Chine 3,29 % 23-05-2029	1,7
Gouvernement de la Chine 3,13 % 21-11-2029	1,7
Gouvernement de l'Australie 1,00 % 21-12-2030	1,6
Apple Inc.	1,6
Nestlé SA	1,5
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,00 % 15-02-2049	1,5
Deutsche Börse AG	1,5
Becton, Dickinson and Co.	1,4
Roche Holding AG	1,4
JPMorgan Chase & Co.	1,3
FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	1,3
The Blackstone Group Inc.	1,3
Johnson & Johnson	1,2
Philip Morris International Inc.	1,2
The Sherwin-Williams Co.	1,1
Novo Nordisk AS	1,1
Obligations du Trésor des États-Unis 2,00 % 15-02-2050	1,1
Visa Inc.	1,0
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	1,0
Texas Instruments Inc.	1,0
Koninklijke Philips NV	1,0
Moody's Corp.	1,0
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	39,9

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 [†]	(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 @ 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

55,8 millions \$ US

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.

