

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2020

Aperçu du portefeuille

Répartition effective du portefeuille % de la valeur liquidative

	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Obligations	116,2	(17,7)	98,5
Contrats à terme*	92,5	(17,7)	74,8
Obligations	23,7	0,0	23,7
Actions	16,1	(4,7)	11,4
Contrats à terme**	16,1	(4,7)	11,4
Actions	0,0	0,0	0,0
Contrats à terme sur marchandises [†]	4,5	(2,1)	2,4
Trésorerie et placements à court terme ^{††}	0,0	0,0	0,0
Autres éléments d'actif (de passif)	(36,5)	24,2	(12,3)

Répartition régionale effective % de la valeur liquidative

	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
États-Unis	100,9	(2,0)	98,9
Canada	19,7	(0,1)	19,6
Allemagne	8,8	0,0	8,8
Autre	6,5	(4,8)	1,7
Belgique	0,1	0,0	0,1
Pays-Bas	0,1	0,0	0,1
Suisse	0,1	0,0	0,1
Trésorerie et placements à court terme ^{††}	0,0	0,0	0,0
France	0,0	(2,8)	(2,8)
Royaume-Uni	0,4	(6,4)	(6,0)
Italie	0,2	(8,4)	(8,2)
Autres éléments d'actif (de passif)	(36,5)	24,2	(12,3)

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

	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Obligations d'État étrangères	79,7	(6,2)	73,5
Obligations de sociétés	15,9	0,0	15,9
Contrats à terme sur actions	16,1	(4,7)	11,4
Obligations fédérales	11,2	0,0	11,2
Contrats à terme sur marchandises	4,5	(2,1)	2,4
Trésorerie et placements à court terme ^{††}	0,0	0,0	0,0
Autre	9,7	(11,8)	(2,1)
Autres éléments d'actif (de passif)	(36,5)	24,2	(12,3)

Exposition nette effective aux devises % de la valeur liquidative

Dollar canadien	89,8
Dollar américain	23,2
Dollar australien	15,7
Couronne suédoise	13,6
Autre	12,1
Peso mexicain	10,9
Yen japonais	(5,0)
Shekel israélien	(11,9)
Roupie indienne	(13,2)
Euro	(16,6)
Dollar de Singapour	(23,6)

^{††} Une portion de la répartition effective de la trésorerie du Fonds est investie dans des titres de série R d'un fonds du marché monétaire géré par Mackenzie.

Pour toutes les notes additionnelles, se reporter à la fin de l'Aperçu du portefeuille.



Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 30 juin 2020

Les 25 principales positions acheteur

Émetteur/Fonds sous-jacent	% de la valeur liquidative
Fonds du marché monétaire canadien Mackenzie, série R	68,8
Trésorerie et placements à court terme	10,1
FINB TIPS américains Mackenzie (couvert en \$ CA)	6,0
FINB Obligations américaines à rendement élevé Mackenzie (couvert en \$ CA)	2,6
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	2,6
iShares TIPS Bond ETF	1,3
iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF	0,7
SPDR Bloomberg Barclays Capital High Yield Bond ETF	0,3
Contrats à terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans*	0,2
Contrats à terme sur le pétrole brut WTI†	0,1
Contrats à terme sur l'indice E-Mini S&P 500**	0,1
Contrats à terme sur euro-obligations*	0,1
Contrats à terme sur l'huile de soja†	0,0
Contrats à terme sur le maïs†	0,0
Contrats à terme sur le coton n° 2†	0,0
Contrats à terme sur 100 onces d'or†	0,0
Contrats à terme sur le plomb LME†	0,0
Contrats à terme sur le gazole à faible teneur en soufre†	0,0
Contrats à terme sur le soja†	0,0
Contrats à terme sur le sucre n° 11†	0,0
Contrats à terme sur le blé†	0,0
Contrats à terme sur obligations canadiennes à 10 ans*	0,0
Contrats à terme sur l'indice Mini MSCI Marchés émergents**	0,0
Contrats à terme sur le HSCEI**	0,0
Contrats à terme FTSE/JSE Top 40**	0,0

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **92,9**

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.

Les 25 principales positions vendeur

Émetteur	% de la valeur liquidative
Contrats à terme sur euro-obligations à long terme du gouvernement italien (BTP)*	(0,2)
Contrats à terme sur obligations euro-OAT*	(0,1)
Contrats à terme sur l'argent†	(0,0)
Contrats à terme sur obligations du Trésor du Commonwealth à 10 ans*	(0,0)
Contrats à terme sur l'indice OMXS30**	(0,0)
Contrats à terme sur obligations du Royaume-Uni*	(0,0)
Contrats à terme sur le carburant diesel à très faible teneur en soufre au port de New York†	(0,0)
Contrats à terme sur le zinc LME†	(0,0)
Contrats à terme sur la farine de soja†	(0,0)
Contrats à terme sur l'aluminium LME†	(0,0)
Contrats à terme sur le gaz naturel†	(0,0)
Contrats à terme sur le nickel LME†	(0,0)
Contrats à terme sur l'essence RBOB†	(0,0)
Contrats à terme sur l'indice FTSE 100**	(0,0)
Contrats à terme Bolsa Mexicana**	0,0
Contrats à terme sur le pétrole brut Brent†	0,0
Contrats à terme sur l'indice CAC40**	0,0
Contrats à terme sur l'indice S&P/TSX 60**	0,0
Contrats à terme sur l'indice Swiss Market**	0,0
Contrats à terme sur l'indice SPI 200**	0,0
Contrats à terme libellés en yens sur l'indice Nikkei 225**	0,0

Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **(0,3)**

Valeur liquidative totale du Fonds **206,9 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.

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 30 juin 2020

<u>Valeurs du capital théorique</u>	<u>% de la valeur liquidative</u>	<u>Valeurs du capital théorique</u>	<u>% de la valeur liquidative</u>
* Obligations – Positions acheteur sur contrats à terme	91,9	† Marchandises – Positions acheteur sur contrats à terme	4,5
Contrats à terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans	73,8	Contrats à terme sur 100 onces d'or	0,8
Contrats à terme sur obligations canadiennes à 10 ans	9,3	Contrats à terme sur le coton n° 2	0,8
Contrats à terme sur euro-obligations	8,8	Contrats à terme sur le pétrole brut WTI	0,7
		Contrats à terme sur le plomb LME	0,5
Obligations – Positions vendeur sur contrats à terme	(17,4)	Contrats à terme sur le gazole à faible teneur en soufre	0,4
Contrats à terme sur euro-obligations à long terme du gouvernement italien (BTP)	(8,4)	Contrats à terme sur le maïs	0,3
Contrats à terme sur obligations du Trésor du Commonwealth à 10 ans	(4,9)	Contrats à terme sur le sucre n° 11	0,3
Contrats à terme sur obligations euro-OAT	(2,8)	Contrats à terme sur le blé	0,3
Contrats à terme sur obligations du Royaume-Uni	(1,3)	Contrats à terme sur l'huile de soja	0,3
		Contrats à terme sur le soja	0,1
** Actions – Positions acheteur sur contrats à terme	16,1	Marchandises – Positions vendeur sur contrats à terme	(2,4)
Contrats à terme sur l'indice E-Mini S&P 500	9,0	Contrats à terme sur l'argent	(0,6)
Contrats à terme sur l'indice Mini MSCI Marchés émergents	1,8	Contrats à terme sur la farine de soja	(0,6)
Contrats à terme sur le HSCEI	1,4	Contrats à terme sur le carburant diesel à très faible teneur en soufre au port de New York	(0,3)
Contrats à terme FTSE/JSE Top 40	1,1	Contrats à terme sur le zinc LME	(0,3)
Contrats à terme sur l'indice E-Mini NASDAQ 100	0,8	Contrats à terme sur l'aluminium LME	(0,3)
Contrats à terme sur l'indice FTSE MIB	0,8	Contrats à terme sur le gaz naturel	(0,1)
Contrats à terme sur l'indice Hang Seng	0,4	Contrats à terme sur le nickel LME	(0,1)
Contrats à terme sur l'indice IBEX 35	0,3	Contrats à terme sur l'essence RBOB	(0,1)
Contrats à terme sur l'indice Euro STOXX 50	0,2	Contrats à terme sur le pétrole brut Brent	0,0
Contrats à terme sur l'indice DAX	0,2		
Contrats à terme sur l'indice FTSE China A50	0,1		
Contrats à terme sur l'indice Mini Russell 2000	0,0		
Actions – Positions vendeur sur contrats à terme	(4,7)		
Contrats à terme sur l'indice Swiss Market	(1,5)		
Contrats à terme sur l'indice SPI 200	(1,1)		
Contrats à terme libellés en yens sur l'indice Nikkei 225	(0,9)		
Contrats à terme sur l'indice OMXS30	(0,6)		
Contrats à terme sur l'indice CAC40	(0,3)		
Contrats à terme sur l'indice FTSE 100	(0,2)		
Contrats à terme sur l'indice S&P/TSX 60	(0,1)		
Contrats à terme Bolsa Mexicana	0,0		

