

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2020

Aperçu du portefeuille

Répartition effective du portefeuille % de la valeur liquidative

Titres à revenu fixe	103,2
Obligations	87,2
Positions acheteur sur contrats à terme*	16,0
Options achetées**	0,0
Options vendues**	(0,0)
Positions vendeur sur contrats à terme†	(0,0)
Autres éléments d'actif (de passif)	1,4
Actions	0,5
Options sur devises achetées††	0,0
Swaps§	0,0
Trésorerie et placements à court terme	(5,1)

Répartition régionale effective % de la valeur liquidative

États-Unis	44,1
Canada	16,6
Autre	8,2
Australie	7,5
Chine	6,3
Mexique	4,1
Bahamas	2,4
Israël	2,4
Chili	2,2
Bermudes	2,1
Allemagne	1,9
Japon	1,9
Russie	1,5
Autres éléments d'actif (de passif)	1,4
Norvège	1,3
Royaume-Uni	1,2
Trésorerie et placements à court terme	(5,1)

La répartition effective présente l'exposition du FNB par portefeuille, région ou secteur ou l'exposition nette aux devises calculée en combinant les placements directs et indirects du FNB.

Répartition régionale effective % de la valeur liquidative

Obligations d'État étrangères	64,8
Obligations de sociétés	29,2
Prêts à terme	6,2
Obligations provinciales	2,0
Autres éléments d'actif (de passif)	1,4
Obligations fédérales	1,0
Services publics	0,3
Énergie	0,1
Services financiers	0,1
Trésorerie et placements à court terme	(5,1)

Exposition nette effective aux devises % de la valeur liquidative

Dollar canadien	82,2
Autre	6,6
Yuan chinois	6,3
Yen japonais	2,3
Rouble russe	1,4
Dollar australien	1,2

* Les valeurs du capital théorique représentent 12,6 % de la valeur liquidative des contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans, 2,0 % 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 3,7 % de la valeur liquidative des options achetées et -3,3 % de la valeur liquidative des options vendues.

† Les valeurs du capital théorique représentent -3,2 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations Euro-Buxl à 30 ans, -4,9 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur euro-obligations et -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 35,0 % 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.

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
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,01 % 15-02-2048	7,4
Trésorerie et placements à court terme	4,9
Gouvernement de la Chine 3,13 % 21-11-2029	4,2
Gouvernement de l'Australie 1,00 % 21-12-2030	3,8
FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	3,6
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,00 % 15-02-2049	3,3
Commonwealth of Bahamas 5,75 % 16-01-2024	2,1
Banque d'Israël 0 % 02-12-2020	2,0
Gouvernement de la Chine 3,29 % 23-05-2029	2,0
Deutsche Bundesrepublik, obligations indexées sur l'inflation 0,50 % 15-04-2030	1,9
Gouvernement du Japon 0 % 22-02-2021	1,9
Province de l'Ontario 2,60 % 02-06-2025	1,8
Province de la Colombie-Britannique 0,00 % 07-10-2020	1,7
Province de l'Ontario 0,00 % 07-10-2020	1,7
FNB de revenu à taux variable Mackenzie	1,6
Gouvernement du Mexique 8,50 % 31-05-2029	1,4
Obligations du Trésor des États-Unis 2,00 % 15-02-2050	1,3
Apple Inc. 2,51 % 19-08-2024, rachetables 2024	1,2
Gouvernement de l'Australie-Méridionale 3,00 % 24-05-2028	1,2
PepsiCo Inc. 3,00 % 15-10-2027, rachetables 2027	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
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 du Mexique 7,50 % 03-06-2027	1,0
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	55,3

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 FNB	158,9 millions \$

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 30 juin 2020 en raison des opérations de portefeuille continues du FNB. 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 FNB, où elles sont disponibles dans les 90 jours.

