

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2020

Aperçu du portefeuille

Répartition du portefeuille	% de la valeur liquidative
Obligations	96,3
Obligations	96,3
Positions vendeur sur contrats à terme*	(0,0)
Fonds/billets négociés en bourse	1,9
Trésorerie et placements à court terme	1,6
Autres éléments d'actif (de passif)	0,2
Options sur devises achetées**	0,0

Répartition régionale

Répartition régionale	% de la valeur liquidative
Canada	82,7
États-Unis	13,5
Trésorerie et placements à court terme	1,6
Royaume-Uni	0,6
Australie	0,6
Autres éléments d'actif (de passif)	0,2
Belgique	0,2
Bermudes	0,2
Irlande	0,2
Israël	0,1
Chine	0,1

Répartition sectorielle

Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative
Obligations de sociétés	49,5
Obligations provinciales	28,4
Obligations fédérales	12,5
Obligations d'État étrangères	4,2
Fonds/billets négociés en bourse	1,9
Prêts à terme	1,7
Trésorerie et placements à court terme	1,6
Autres éléments d'actif (de passif)	0,2

Exposition nette aux devises

Exposition nette aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar canadien	97,1
Dollar américain	2,9

Les 25 principales positions acheteur

Émetteur/Fonds sous-jacent	% de la valeur liquidative
Province de l'Ontario 2,05 % 02-06-2030	10,3
Province de Québec 1,90 % 01-09-2030	5,5
Gouvernement du Canada 1,25 % 01-06-2030	5,1
Province de l'Ontario 2,65 % 02-12-2050	3,1
Gouvernement du Canada 2,00 % 01-12-2051	2,9
Province de la Colombie-Britannique 2,20 % 18-06-2030	1,9
Province de Québec 3,50 % 01-12-2048	1,7
Trésorerie et placements à court terme	1,6
Province de la Colombie-Britannique 2,95 % 18-06-2050	1,6
Province de l'Ontario 2,90 % 02-06-2049	1,6
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,75 % 15-07-2028	1,4
Banque Royale du Canada 2,95 % 01-05-2023	1,4
Gouvernement du Canada 1,25 % 01-03-2025	1,2
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,1
Fiducie du Canada pour l'habitation 1,75 % 15-06-2030	1,0
Province de Québec 3,10 % 01-12-2051	1,0
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,00 % 15-02-2049	0,9
Obligations du Trésor des États-Unis 2,00 % 15-02-2050	0,9
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,50 % 15-04-2024	0,8
JPMorgan Chase & Co. 3,19 % 05-03-2021	0,7
La Banque Toronto-Dominion 2,85 % 08-03-2024	0,7
Fiducie du Canada pour l'habitation, taux variable 15-03-2024	0,6
Fédération des caisses Desjardins du Québec 3,06 % 11-09-2023	0,6
OMERS Realty Corp. 3,24 % 04-10-2027, rachetables 2027	0,6
Banque Canadienne Impériale de Commerce 2,97 % 11-07-2023	0,6

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **48,8**

* Les valeurs du capital théorique représentent -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 7,7 % 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
Contrats à terme sur euro-obligations à long terme du gouvernement italien (BTP)*	(0,0)
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(0,0)
Valeur liquidative totale du FNB	307,0 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.

