

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2020

Aperçu du portefeuille

Répartition effective du portefeuille	% de la valeur liquidative
Obligations	84,8
Obligations	84,4
Options achetées*	0,4
Options vendues*	(0,0)
Positions vendeur sur contrats à terme**	(0,0)
Trésorerie et placements à court terme	13,4
Actions	0,9
Autres éléments d'actif (de passif)	0,9
Options sur devises achetées†	0,0

Répartition régionale effective	% de la valeur liquidative
États-Unis	41,4
Canada	28,2
Trésorerie et placements à court terme	13,4
Autre	3,7
Japon	3,5
Chine	1,9
Australie	1,9
Royaume-Uni	1,7
Autres éléments d'actif (de passif)	0,9
Pays-Bas	0,8
Mexique	0,7
France	0,4
Irlande	0,4
Colombie	0,4
Russie	0,4
Brésil	0,3

Répartition sectorielle effective	% de la valeur liquidative
Obligations de sociétés	43,5
Obligations d'État étrangères	22,2
Trésorerie et placements à court terme	13,4
Prêts à terme	9,6
Obligations fédérales	5,6
Obligations provinciales	3,5
Autres éléments d'actif (de passif)	0,9
Consommation discrétionnaire	0,4
Autre	0,4
Services publics	0,2
Services financiers	0,2
Énergie	0,1

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

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.

Les 25 principales positions acheteur

Émetteur/Fonds sous-jacent	% de la valeur liquidative
Trésorerie et placements à court terme	13,4
FINB Obligations à court terme canadiennes Mackenzie	5,7
Obligations du Trésor des États-Unis 1,75 % 30-06-2024	5,4
Gouvernement du Japon 1,30 % 20-03-2021	3,5
Obligations du Trésor des États-Unis 2,00 % 15-02-2050	3,3
FINB Obligations toutes sociétés canadiennes Mackenzie	2,7
Gouvernement de la Chine 3,13 % 21-11-2029	1,8
FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	1,8
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,75 % 15-07-2028	1,7
Gouvernement de l'Australie 1,00 % 21-12-2030	1,6
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,4
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	1,3
Gouvernement du Canada 1,25 % 01-06-2030	1,0
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,00 % 15-02-2049	1,0
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
Gouvernement du Canada 2,00 % 01-12-2051	0,7
Gibson Energy Inc. 5,25 % 15-07-2024, rachetables 2020	0,6
Uber Technologies Inc. 8,00 % 01-11-2026, rachetables 2021	0,5
HCA Healthcare Inc. 3,50 % 01-09-2030, rachetables 2030	0,5
eG Global Finance PLC 6,75 % 07-02-2025, rachetables 2021	0,5
Inter Pipeline Ltd., taux variable 26-03-2079, rachetables 2029	0,5
Panther BF Aggregator 2 LP 8,50 % 15-05-2027, rachetables 2022	0,5
The Goldman Sachs Group Inc. 2,43 % 26-04-2023, rachetables	0,4
Bell Canada Inc. 2,70 % 27-02-2024, rachetables 2023	0,4

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **51,8**

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

** Les valeurs du capital théorique représentent 20,5 % de la valeur liquidative des options achetées et -18,3 % de la valeur liquidative des options vendues.

† Les valeurs du capital théorique représentent 16,6 % 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 @ 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 @ 74,00 \$ éch. 21-08-2020*	(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	(0,0)

Valeur liquidative totale du FNB **688,4 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.

