

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2019

Aperçu du portefeuille

Répartition du portefeuille	% de la valeur liquidative
Obligations	94,6
Obligations	94,5
Positions vendeur sur contrats à terme*	0,1
Options achetées**	0,0
Trésorerie et placements à court terme	3,5
Fonds/billets négociés en bourse	1,3
Autres éléments d'actif (de passif)	0,6

Répartition régionale	% de la valeur liquidative
Canada	79,3
États-Unis	13,6
Trésorerie et placements à court terme	3,5
Royaume-Uni	1,0
Australie	0,8
Autres éléments d'actif (de passif)	0,6
Nouvelle-Zélande	0,6
Belgique	0,2
Irlande	0,2
Allemagne	0,1
Autres	0,1

Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative
Obligations de sociétés	45,4
Obligations provinciales	21,9
Obligations fédérales	16,3
Obligations d'État étrangères	8,4
Trésorerie et placements à court terme	3,5
Titres adossés à des créances hypothécaires	1,5
Fonds/billets négociés en bourse	1,3
Obligations supranationales	0,7
Autres éléments d'actif (de passif)	0,6
Titres adossés à des créances mobilières	0,2
Autres	0,1
Obligations municipales	0,1

Exposition nette aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar canadien	98,0
Dollar américain	2,0

Les 25 principales positions acheteur

Émetteur/Fonds sous-jacent	% de la valeur liquidative
Gouvernement du Canada 1,50 % 01-09-2024	5,2
Province de Québec 3,50 % 01-12-2048	3,8
Trésorerie et placements à court terme	3,5
Province de l'Ontario 2,90 % 02-06-2028	3,3
Province de l'Ontario 2,65 % 02-12-2050	3,2
Province de l'Ontario 2,90 % 02-06-2049	2,9
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-12-2048	2,8
Province de l'Ontario 2,70 % 02-06-2029	2,7
Fiducie du Canada pour l'habitation 1,80 % 15-12-2024	2,7
Gouvernement du Canada 1,25 % 01-12-2047, rendement réel	2,7
Obligations du Trésor des États-Unis 2,38 % 15-05-2029	2,3
Obligations du Trésor des États-Unis 1,75 % 30-06-2024	2,2
Banque Royale du Canada 2,95 % 01-05-2023	1,5
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,75 % 15-07-2028	1,4
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,50 % 15-04-2024	1,4
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,3
Gouvernement du Canada 1,75 % 01-05-2021	1,3
La Banque Toronto-Dominion 1,91 % 18-07-2023	1,1
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,00 % 15-02-2049	1,0
Gouvernement du Canada 2,00 % 01-06-2028	0,9
Province de l'Ontario 0,00 % 02-06-2024	0,9
Banque de Montréal 2,70 % 11-09-2024	0,8
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	0,8
OMERS Realty Corp. 3,24 % 04-10-2027, rachetables 2027	0,7
Banque Nationale du Canada 1,96 % 30-06-2022	0,7

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **51,1**

* Les valeurs du capital théorique représentent -2,9 % de la valeur liquidative des contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME.

** Les valeurs du capital théorique représentent 1,3 % de la valeur liquidative des options 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 31 décembre 2019

Les 25 principales positions vendeur

Émetteur	% de la valeur liquidative
Contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME*	0,1
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	0,1
Valeur liquidative totale du Fonds	1,5 milliard \$

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 31 décembre 2019 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.

