

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2019

Aperçu du portefeuille

Répartition effective du portefeuille % de la valeur liquidative

Actions	64,1
Obligations	34,1
Obligations	34,0
Positions vendeur sur contrats à terme*	0,1
Options achetées**	0,0
Trésorerie et placements à court terme	1,1
Autres éléments d'actif (de passif)	0,7

Répartition régionale effective % de la valeur liquidative

Canada	58,9
États-Unis	26,0
Royaume-Uni	2,5
Japon	1,9
Hong Kong	1,7
Suisse	1,5
Corée du Sud	1,3
Trésorerie et placements à court terme	1,1
Autres	1,0
France	1,0
Pays-Bas	0,8
Autres éléments d'actif (de passif)	0,7
Nouvelle-Zélande	0,6
Australie	0,6
Bermudes	0,2
Luxembourg	0,2

Répartition sectorielle effective % de la valeur liquidative

Obligations de sociétés	17,8
Services financiers	16,6
Énergie	8,5
Produits industriels	7,7
Technologie de l'information	6,2
Obligations provinciales	5,6
Consommation courante	5,3
Soins de santé	5,1
Services de communication	5,0
Autres	4,3
Obligations fédérales	3,4
Immobilier	3,3
Matières	3,3
Prêts à terme	3,1
Obligations d'État étrangères	3,0
Trésorerie et placements à court terme	1,1
Autres éléments d'actif (de passif)	0,7

Exposition nette effective aux devises % de la valeur liquidative

Dollar canadien	79,8
Dollar américain	13,3
Autres	2,1
Dollar de Hong Kong	1,7
Euro	1,6
Franc suisse	1,5

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.

Les 25 principales positions acheteur

Émetteur/Fonds sous-jacent % de la valeur liquidative

Citigroup Inc.	3,4
Bank of America Corp.	3,4
La Banque de Nouvelle-Écosse	2,9
Fonds d'opportunités en titres de créance mondiaux Mackenzie, série R	2,8
Enbridge Inc.	2,7
Brookfield Asset Management Inc.	2,7
Suncor Énergie Inc.	2,5
Province de l'Ontario 2,90 % 02-06-2049	2,4
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	2,4
Nutrien Ltd.	1,9
Groupe SNC-Lavalin inc.	1,9
Province de Québec 3,50 % 01-12-2048	1,8
Fairfax Financial Holdings Ltd.	1,7
Fairfax Financial Holdings Ltd. 7,75 % 15-07-2037	1,6
Celestica Inc.	1,6
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-12-2048	1,5
Gouvernement du Canada 1,25 % 01-12-2047, rendement réel	1,5
Boardwalk Real Estate Investment Trust	1,5
Wells Fargo & Co.	1,5
Ressources Teck Ltée	1,3
Alimentation Couche-Tard inc.	1,3
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée	1,3
Samsung Electronics Co. Ltd.	1,3
Linamar Corp.	1,2
Oracle Corp.	1,2

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **49,3**

* Les valeurs du capital théorique représentent -0,5 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans et -4,1 % de la valeur liquidative des contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME.

** Les valeurs du capital théorique représentent 4,3 % 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 terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans*	0,0
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	638,9 millions \$

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.

