

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2020

Aperçu du portefeuille du Fonds sous-jacent *

| Répartition effective du portefeuille | % de la valeur liquidative |
|---|----------------------------|
| Actions | 52,6 |
| Obligations | 45,4 |
| Obligations | 45,4 |
| Options achetées** | 0,0 |
| Positions vendeur sur contrats à terme† | 0,0 |
| Options vendues** | (0,0) |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 1,0 |
| Trésorerie et placements à court terme | 0,9 |
| Fonds/billets négociés en bourse | 0,1 |
| Options sur devises achetées†† | 0,0 |

| Répartition régionale effective | % de la valeur liquidative |
|--|----------------------------|
| Canada | 41,9 |
| États-Unis | 32,5 |
| Autre | 4,6 |
| Chine | 4,0 |
| Royaume-Uni | 2,7 |
| Japon | 2,1 |
| France | 2,1 |
| Suisse | 1,9 |
| Pays-Bas | 1,8 |
| Allemagne | 1,3 |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 1,0 |
| Trésorerie et placements à court terme | 0,9 |
| Irlande | 0,8 |
| Taïwan | 0,6 |
| Russie | 0,6 |
| Brésil | 0,6 |
| Mexique | 0,6 |

| Répartition sectorielle effective | % de la valeur liquidative |
|--|----------------------------|
| Obligations de sociétés | 29,1 |
| Services financiers | 14,6 |
| Obligations d'État étrangères | 7,1 |
| Prêts à terme | 6,8 |
| Technologie de l'information | 6,7 |
| Consommation courante | 5,4 |
| Produits industriels | 4,5 |
| Services de communication | 4,1 |
| Consommation discrétionnaire | 3,8 |
| Soins de santé | 3,5 |
| Matières | 3,4 |
| Énergie | 3,2 |
| Services publics | 2,4 |
| Autre | 2,1 |
| Obligations provinciales | 1,4 |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 1,0 |
| Trésorerie et placements à court terme | 0,9 |

| Exposition nette effective aux devises | % de la valeur liquidative |
|--|----------------------------|
| Dollar canadien | 66,6 |
| Dollar américain | 16,7 |
| Euro | 4,7 |
| Autre | 4,5 |
| Yuan chinois | 3,0 |
| Yen japonais | 2,1 |
| Franc suisse | 1,7 |
| Livre sterling | 0,7 |

Les 25 principales positions acheteur du Fonds sous-jacent*

| Émetteur/Fonds sous-jacent | % de la valeur liquidative |
|--|----------------------------|
| FNB de revenu fixe à rendement élevé mondial Mackenzie | 6,7 |
| La Banque Toronto-Dominion | 2,2 |
| Banque Royale du Canada | 1,9 |
| La Banque de Nouvelle-Écosse | 1,7 |
| Société Financière Manuvie | 1,5 |
| Gouvernement de la Chine 3,13 % 21-11-2029 | 1,4 |
| Enbridge Inc. | 1,1 |
| Shaw Communications Inc. | 1,0 |
| Brookfield Asset Management Inc. | 1,0 |
| Gouvernement de la Chine 1,99 % 09-04-2025 | 1,0 |
| Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada | 1,0 |
| Fonds à rendement absolu de titres de créance Mackenzie, série R | 1,0 |
| Open Text Corp. | 0,9 |
| Apple Inc. | 0,9 |
| Microsoft Corp. | 0,9 |
| Corporation TC Énergie | 0,8 |
| Gouvernement du Canada 1,25 % 01-06-2030 | 0,8 |
| Alimentation Couche-Tard inc. | 0,8 |
| FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA) | 0,8 |
| Amazon.com Inc. | 0,8 |
| Fortis Inc. | 0,7 |
| TELUS Corp. | 0,7 |
| FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie | 0,7 |
| Nestlé SA | 0,7 |
| Banque de Montréal | 0,7 |

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **31,7**

* Le Fonds est actuellement entièrement investi dans le Fonds de revenu stratégique Mackenzie (le « Fonds sous-jacent »). Pour le prospectus et d'autres renseignements concernant le Fonds sous-jacent, veuillez consulter les adresses suivantes : www.placementsmackenzie.com ou www.sedar.com.

** Les valeurs du capital théorique représentent 1,0 % de la valeur liquidative des options achetées et -0,9 % de la valeur liquidative des options vendues.

† Les valeurs du capital théorique représentent -1,3 % de la valeur liquidative des contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME.

†† Les valeurs du capital théorique représentent 4,1 % de la valeur liquidative des options sur devises achetées.

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



Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2020

Les 25 principales positions vendeur du Fonds sous-jacent*

| Émetteur | % de la valeur liquidative |
|---|----------------------------|
| iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF option de vente souscrite @ 70,00 \$ éch. 15-01-2021** | (0,0) |
| iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF option de vente souscrite @ 80,00 \$ éch. 15-01-2021** | (0,0) |
| iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF, option de vente souscrite @ 81,00 \$ éch. 15-01-2021** | (0,0) |
| iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF option de vente souscrite @ 77,00 \$ éch. 19-03-2021** | (0,0) |
| iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF option de vente souscrite @ 78,00 \$ éch. 19-03-2021** | (0,0) |
| Contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME† | 0,0 |
| Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale | 0,0 |
| Valeur liquidative totale du Fonds sous-jacent | 2,2 milliards \$ |
| Valeur liquidative totale du Fonds | 166,2 millions \$ |

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 31 décembre 2020 en raison des opérations de portefeuille continues du Fonds et du Fonds sous-jacent. 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.

