

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2019

Aperçu du portefeuille

Répartition effective du portefeuille	% de la valeur liquidative
Obligations	95,9
<i>Obligations</i>	95,8
<i>Positions vendeur sur contrats à terme*</i>	0,1
<i>Options achetées**</i>	0,0
Trésorerie et placements à court terme	2,9
Autres éléments d'actif (de passif)	0,8
Actions	0,4

Répartition régionale effective

Répartition régionale effective	% de la valeur liquidative
Canada	70,8
États-Unis	21,1
Trésorerie et placements à court terme	2,9
Royaume-Uni	1,2
Australie	1,0
Autres éléments d'actif (de passif)	0,8
Belgique	0,4
Autres	0,4
Bermudes	0,3
Pays-Bas	0,2
Luxembourg	0,2
Nouvelle-Zélande	0,2
Irlande	0,2
Mexique	0,2
Allemagne	0,1

Répartition sectorielle effective

Répartition sectorielle effective	% de la valeur liquidative
Obligations de sociétés	40,8
Obligations provinciales	22,3
Obligations fédérales	17,8
Obligations d'État étrangères	10,4
Prêts à terme	3,9
Trésorerie et placements à court terme	2,9
Autres éléments d'actif (de passif)	0,8
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,3
Obligations supranationales	0,2
Services publics	0,2
Énergie	0,1
Obligations municipales	0,1
Autres	0,1
Services financiers	0,1

Exposition nette effective aux devises

Exposition nette effective aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar canadien	96,0
Dollar américain	3,9
Yen japonais	0,1

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
Province de l'Ontario 2,70 % 02-06-2029	5,1
Obligations du Trésor des États-Unis 2,38 % 15-05-2029	4,4
Gouvernement du Canada 2,25 % 01-06-2029	3,8
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-12-2048	3,7
Province de l'Ontario 2,65 % 02-12-2050	3,6
Fonds d'opportunités en titres de créance mondiaux Mackenzie, série R	3,4
Province de l'Ontario 2,90 % 02-06-2028	3,3
Gouvernement du Canada 1,50 % 01-09-2024	3,2
Province de Québec 3,50 % 01-12-2048	3,1
Province de l'Ontario 2,90 % 02-06-2049	2,6
Trésorerie et placements à court terme	2,5
Obligations du Trésor des États-Unis 1,75 % 30-06-2024	2,2
Gouvernement du Canada 2,00 % 01-06-2028	2,1
Gouvernement du Canada 1,25 % 01-12-2047, rendement réel	1,6
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,4
Banque Royale du Canada 2,95 % 01-05-2023	1,3
Fiducie du Canada pour l'habitation, taux variable 15-03-2024	1,3
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,75 % 15-07-2028	1,2
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,50 % 15-04-2024	1,2
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	0,9
Fiducie du Canada pour l'habitation 1,80 % 15-12-2024	0,8
Province de l'Ontario, taux variable 21-08-2023	0,6
JPMorgan Chase & Co. 3,19 % 05-03-2021	0,6
Province de l'Ontario 0,00 % 02-12-2023	0,6

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **55,5**

* Les valeurs du capital théorique représentent -2,7 % de la valeur liquidative des contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME.

** Les valeurs du capital théorique représentent 4,6 % 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.

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.



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	334,8 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.

