

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2020

Aperçu du portefeuille

Répartition effective du portefeuille	% de la valeur liquidative
Obligations	86,1
Obligations	84,4
Positions acheteur sur contrats à terme*	1,7
Positions vendeur sur contrats à terme**	(0,0)
Trésorerie et placements à court terme	13,0
Autres éléments d'actif (de passif)	0,7
Actions	0,2
Options sur devises achetées†	0,0

Répartition régionale effective	% de la valeur liquidative
États-Unis	39,7
Trésorerie et placements à court terme	13,0
Canada	9,7
Chine	8,7
Israël	4,7
Mexique	4,5
Australie	4,2
Autre	3,4
Chili	2,8
Brésil	2,6
Russie	1,8
Bahamas	1,0
Bermudes	0,9
Afrique du Sud	0,8
Japon	0,8
Royaume-Uni	0,7
Autres éléments d'actif (de passif)	0,7

Répartition sectorielle effective	% de la valeur liquidative
Obligations d'État étrangères	63,5
Obligations de sociétés	17,2
Trésorerie et placements à court terme	13,0
Prêts à terme	3,5
Obligations supranationales	1,6
Autres éléments d'actif (de passif)	0,7
Obligations fédérales	0,2
Services publics	0,1
Obligations provinciales	0,1
Services financiers	0,1

Exposition nette effective aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar américain	76,3
Yuan chinois	8,8
Peso mexicain	4,3
Real brésilien	2,6
Autre	2,4
Peso chilien	2,2
Rouble russe	1,7
Roupie indienne	1,7

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
Obligations du Trésor des États-Unis 0,50 % 31-10-2027	15,9
Trésorerie et placements à court terme	14,6
Gouvernement d'Israël 0,00 % 03-11-2021	4,7
Obligations du Trésor des États-Unis 0,38 % 30-11-2025	4,0
Gouvernement de la Chine 3,13 % 21-11-2029	3,9
Obligations du Trésor des États-Unis 1,13 % 28-02-2027	3,3
Obligations du Trésor des États-Unis 1,38 % 15-08-2050	3,3
Gouvernement de l'Australie 1,00 % 21-12-2030	2,0
FINB Obligations toutes sociétés canadiennes Mackenzie	2,0
Gouvernement de la Chine 3,29 % 23-05-2029	1,8
Gouvernement de la Chine 2,68 % 21-05-2030	1,8
FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	1,7
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2029	1,6
Gouvernement du Mexique 8,50 % 31-05-2029	1,4
FNB de revenu à taux variable Mackenzie	1,2
Gouvernement de la Chine 1,99 % 09-04-2025	1,2
Apple Inc. 2,51 % 19-08-2024, rachetables 2024	1,2
Gouvernement de la Russie 7,65 % 10-04-2030	1,2
Obligations du Trésor des États-Unis 0,88 % 15-11-2030	1,1
Bonos (Mexique) 7,75 % 29-05-2031	0,9
Gouvernement du Chili 4,70 % 01-09-2030	0,9
Gouvernement du Chili 4,50 % 01-03-2026	0,9
FINB Obligations américaines à rendement élevé Mackenzie (couvert en \$ CA)	0,9
Commonwealth of Bahamas 5,75 % 16-01-2024	0,9
Gouvernement des Bermudes 3,38 % 20-08-2050, rachetables 2050	0,9

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **73,3**

* Les valeurs du capital théorique représentent 1,7 % de la valeur liquidative des contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME.

** Les valeurs du capital théorique représentent -2,2 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations Euro-Buxl à 30 ans.

† Les valeurs du capital théorique représentent 13,6 % 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 31 décembre 2020

Les 25 principales positions vendeur

Émetteur	% de la valeur liquidative
Contrats à terme sur obligations Euro-Buxl à 30 ans**	(0,0)

Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(0,0)
--	--------------

Valeur liquidative totale du Fonds **25,0 millions \$ US**

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 31 décembre 2020 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.

