

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2020

Aperçu du portefeuille

<i>Répartition effective du portefeuille</i>	<i>% de la valeur liquidative</i>
Obligations	92,5
<i>Obligations</i>	91,4
<i>Positions acheteur sur contrats à terme*</i>	1,1
<i>Positions vendeur sur contrats à terme**</i>	(0,0)
Trésorerie et placements à court terme	6,4
Autres éléments d'actif (de passif)	0,6
Actions	0,5
Options sur devises achetées†	0,0

<i>Répartition régionale effective</i>	<i>% de la valeur liquidative</i>
États-Unis	31,8
Canada	15,4
Autre	9,8
Chine	8,6
Trésorerie et placements à court terme	6,4
Mexique	5,9
Australie	5,7
Chili	3,5
Brésil	2,6
Russie	2,1
Israël	1,9
Bahamas	1,8
Japon	1,7
Norvège	1,1
Royaume-Uni	1,1
Autres éléments d'actif (de passif)	0,6

<i>Répartition régionale effective</i>	<i>% de la valeur liquidative</i>
Obligations d'État étrangères	53,7
Obligations de sociétés	31,9
Trésorerie et placements à court terme	6,4
Prêts à terme	5,7
Obligations fédérales	1,0
Autres éléments d'actif (de passif)	0,6
Services publics	0,3
Obligations provinciales	0,1
Énergie	0,1
Services financiers	0,1
Autre	0,1

<i>Exposition nette effective aux devises</i>	<i>% de la valeur liquidative</i>
Dollar canadien	76,2
Yuan chinois	8,8
Peso mexicain	5,4
Autre	2,8
Rouble russe	2,0
Roupie indienne	1,9
Peso chilien	1,5
Real brésilien	1,4

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



Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2020

Les 25 principales positions acheteur

Émetteur/Fonds sous-jacent	% de la valeur liquidative
Trésorerie et placements à court terme	7,5
Obligations du Trésor des États-Unis 1,38 % 15-08-2050	5,6
Obligations du Trésor des États-Unis 0,38 % 30-11-2025	4,3
Gouvernement de la Chine 3,13 % 21-11-2029	3,8
Obligations du Trésor des États-Unis 0,50 % 31-10-2027	3,6
FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	3,3
Gouvernement de l'Australie 1,00 % 21-12-2030	2,6
Gouvernement d'Israël 0,00 % 03-11-2021	1,9
Gouvernement de la Chine 3,29 % 23-05-2029	1,8
Gouvernement de la Chine 1,99 % 09-04-2025	1,7
Gouvernement du Japon 0,00 % 22-02-2021	1,6
FNB de revenu à taux variable Mackenzie	1,5
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2029	1,4
Gouvernement du Mexique 8,50 % 31-05-2029	1,4
Gouvernement de la Chine 2,68 % 21-05-2030	1,3
Obligations du Trésor des États-Unis 0,88 % 15-11-2030	1,2
Gouvernement de l'Australie-Méridionale 3,00 % 24-05-2028	1,1
Apple Inc. 2,51 % 19-08-2024, rachetables 2024	1,1
FINB Obligations américaines à rendement élevé Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,1
Gouvernement de l'Australie 2,50 % 21-05-2030	1,0
Gouvernement du Chili 4,70 % 01-09-2030	1,0
Gouvernement du Chili 4,50 % 01-03-2026	1,0
Gouvernement du Mexique 7,50 % 03-06-2027	1,0
PepsiCo Inc. 3,00 % 15-10-2027, rachetables 2027	0,9
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	0,9
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	53,6

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 FNB	175,9 millions \$

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 31 décembre 2020 en raison des opérations de portefeuille continues du FNB. 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 FNB, où elles sont disponibles dans les 90 jours.

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

** Les valeurs du capital théorique représentent -3,0 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations Euro-Buxl à 30 ans.

† Les valeurs du capital théorique représentent 15,7 % 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.

