

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2020

Aperçu du portefeuille

Répartition du portefeuille	% de la valeur liquidative
Obligations	91,1
<i>Obligations</i>	91,1
<i>Positions vendeur sur contrats à terme*</i>	0,0
Trésorerie et placements à court terme	4,4
Fonds/billets négociés en bourse	3,9
Autres éléments d'actif (de passif)	0,6
Options sur devises achetées**	0,0

Répartition régionale

Répartition régionale	% de la valeur liquidative
Canada	78,6
États-Unis	13,3
Trésorerie et placements à court terme	4,4
Chine	1,3
Royaume-Uni	0,8
Autres éléments d'actif (de passif)	0,6
Australie	0,4
Bahamas	0,2
Mexique	0,1
Panama	0,1
Irlande	0,1
Israël	0,1

Répartition sectorielle

Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative
Obligations de sociétés	49,2
Obligations provinciales	22,4
Obligations fédérales	12,3
Obligations d'État étrangères	5,5
Trésorerie et placements à court terme	4,4
Fonds/billets négociés en bourse	3,9
Prêts à terme	1,4
Autres éléments d'actif (de passif)	0,6
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,3

Exposition nette aux devises

Exposition nette aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar canadien	98,7
Yuan chinois	1,2
Dollar américain	0,1

* Les valeurs du capital théorique représentent -3,0 % de la valeur liquidative des contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME.

** Les valeurs du capital théorique représentent 1,3 % de la valeur liquidative des options sur devises achetées.

Les 25 principales positions acheteur

Émetteur/Fonds sous-jacent	% de la valeur liquidative
Province de l'Ontario 2,05 % 02-06-2030	5,8
Trésorerie et placements à court terme	4,4
Province de l'Ontario 1,90 % 02-12-2051	4,4
Province de Québec 1,90 % 01-09-2030	3,0
Gouvernement du Canada 2,00 % 01-12-2051	2,7
FNB de revenu à taux variable Mackenzie	2,4
Gouvernement du Canada 1,25 % 01-06-2030	2,3
Province de Québec 3,10 % 01-12-2051	2,2
Province de la Colombie-Britannique 2,20 % 18-06-2030	1,9
Fiducie du Canada pour l'habitation 1,10 % 15-03-2031	1,8
Banque Royale du Canada 2,95 % 01-05-2023	1,7
Gouvernement du Canada 1,25 % 01-03-2025	1,7
Obligations du Trésor des États-Unis 1,38 % 15-08-2050	1,4
Province de l'Ontario 2,65 % 02-12-2050	1,3
Obligations du Trésor des États-Unis 0,63 % 15-08-2030	1,3
Gouvernement de la Chine 1,99 % 09-04-2025	1,2
Fiducie du Canada pour l'habitation, taux variable 15-03-2024	1,2
Province de la Colombie-Britannique 2,95 % 18-06-2050	1,1
Province de l'Ontario 2,60 % 02-06-2025	1,1
La Banque Toronto-Dominion 1,91 % 18-07-2023	0,9
Fiducie du Canada pour l'habitation 1,75 % 15-06-2030	0,7
PSP Capital Inc. 2,05 % 15-01-2030	0,7
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	0,7
OMERS Finance Trust 1,55 % 21-04-2027	0,7
La Banque de Nouvelle-Écosse 2,38 % 01-05-2023	0,6

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **47,2**

Les 25 principales positions vendeur

Émetteur	% de la valeur liquidative
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 FNB **507,6 millions \$**

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 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.

