

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2020

Aperçu du portefeuille

Répartition du portefeuille	% de la valeur liquidative
Actions	73,0
Obligations	22,6
Obligations	18,5
Positions acheteur sur contrats à terme*	4,1
Options achetées**	0,0
Options vendues**	(0,0)
Positions vendeur sur contrats à terme†	(0,0)
Fonds/billets négociés en bourse	2,5
Fonds communs de placement	2,0
Autres éléments d'actif (de passif)	1,1
Options sur devises achetées††	0,0
Swaps§	0,0
Trésorerie et placements à court terme	(1,2)
Répartition régionale	% de la valeur liquidative
États-Unis	46,9
Canada	10,1
Japon	6,7
Royaume-Uni	6,4
Australie	5,5
Chine	5,1
Autre	4,3
Allemagne	4,1
Suisse	2,7
Danemark	2,1
Espagne	1,7
Hong Kong	1,5
Corée du Sud	1,1
Autres éléments d'actif (de passif)	1,1
Taïwan	1,0
Suède	0,9
Trésorerie et placements à court terme	(1,2)

Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative
Consommation courante	20,5
Obligations d'État étrangères	14,6
Soins de santé	11,0
Produits industriels	10,0
Technologie de l'information	8,2
Consommation discrétionnaire	7,5
Services de communication	6,6
Obligations de sociétés	5,9
Services financiers	5,5
Matières	3,3
Fonds/billets négociés en bourse	2,5
Fonds communs de placement	2,0
Prêts à terme	1,4
Autres éléments d'actif (de passif)	1,1
Autre	0,7
Obligations provinciales	0,4
Trésorerie et placements à court terme	(1,2)

Exposition nette aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar canadien	42,6
Dollar américain	27,8
Dollar de Hong Kong	5,2
Yen japonais	5,0
Autre	4,0
Dollar australien	3,9
Euro	3,7
Livre sterling	3,1
Franc suisse	2,6
Couronne danoise	2,1

* Les valeurs du capital théorique représentent 3,2 % de la valeur liquidative des contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans, 0,5 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations américaines à long terme et 0,4 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations du Trésor du Commonwealth à 10 ans.

** Les valeurs du capital théorique représentent 0,9 % de la valeur liquidative des options achetées et -0,8 % de la valeur liquidative des options vendues.

† Les valeurs du capital théorique représentent -0,7 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations Euro-Buxl à 30 ans, -1,2 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur euro-obligations et -0,3 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur euro-obligations à long terme du gouvernement italien (BTP).

†† Les valeurs du capital théorique représentent 12,1 % de la valeur liquidative des options sur devises achetées.

§ Les valeurs du capital théorique représentent 0,3 % de la valeur liquidative des swaps sur paniers d'actions.

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 30 juin 2020

Les 25 principales positions acheteur

Émetteur/Fonds sous-jacent	% de la valeur liquidative
Trésorerie et placements à court terme	2,9
Johnson & Johnson	2,7
Seven & i Holdings Co. Ltd.	2,7
Reckitt Benckiser Group PLC	2,7
Amcor PLC	2,5
Comcast Corp.	2,5
The Procter & Gamble Co.	2,5
W.W. Grainger Inc.	2,5
Admiral Group PLC	2,4
Costco Wholesale Corp.	2,3
Kao Corp.	2,2
Henkel AG & Co. KGaA	2,2
Danaher Corp.	2,2
PepsiCo Inc.	2,1
Vestas Wind Systems AS	2,1
Oracle Corp.	2,0
Catégorie Mackenzie Lingot d'or, série R	2,0
Tencent Holdings Ltd.	1,9
Colgate Palmolive Co.	1,9
Les Laboratoires Abbott	1,8
Alibaba Group Holding Ltd.	1,8
Industria de Diseño Textil SA (Inditex)	1,7
United Parcel Service Inc. (UPS)	1,7
CK Hutchison Holdings Ltd.	1,5
Roche Holding AG	1,4
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	54,2

Les 25 principales positions vendeur

Émetteur	% de la valeur liquidative
Contrats à terme sur obligations Euro-Buxl à 30 ans [†]	(0,0)
Contrats à terme sur euro-obligations [†]	(0,0)
Contrats à terme sur euro-obligations à long terme du gouvernement italien (BTP) [†]	(0,0)
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF option de vente souscrite @ 74,00 \$ éch. 17-07-2020**	(0,0)
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(0,0)
Valeur liquidative totale du Fonds	1,7 milliard \$

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 30 juin 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.