

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2020

Aperçu du portefeuille

Répartition du portefeuille	% de la valeur liquidative
Obligations	82,0
Obligations	69,7
Positions acheteur sur contrats à terme*	12,3
Options achetées**	0,0
Options vendues**	(0,0)
Positions vendeur sur contrats à terme [†]	(0,0)
Trésorerie et placements à court terme	13,9
Fonds/billets négociés en bourse	3,0
Autres éléments d'actif (de passif)	1,1
Options sur devises achetées ^{††}	0,0

Répartition régionale	% de la valeur liquidative
États-Unis	30,7
Trésorerie et placements à court terme	13,9
Canada	13,4
Autre	8,3
Israël	7,4
Chine	6,5
Australie	5,7
Mexique	2,1
Pays-Bas	2,0
Bermudes	1,9
Trinité-et-Tobago	1,5
Japon	1,5
Bahamas	1,4
Allemagne	1,4
Royaume-Uni	1,2
Autres éléments d'actif (de passif)	1,1

Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative
Obligations d'État étrangères	56,4
Obligations de sociétés	20,9
Trésorerie et placements à court terme	13,9
Fonds/billets négociés en bourse	3,0
Prêts à terme	2,3
Obligations provinciales	1,8
Autres éléments d'actif (de passif)	1,1
Obligations fédérales	0,7
Obligations supranationales	0,1
Autre	(0,2)

Exposition nette aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar canadien	86,5
Yuan chinois	6,6
Dollar américain	3,1
Yen japonais	1,9
Autre	1,9

Les 25 principales positions acheteur

Émetteur/Fonds sous-jacent	% de la valeur liquidative
Trésorerie et placements à court terme	26,4
Banque d'Israël 0 % 02-12-2020	7,4
Gouvernement de l'Australie 1,00 % 21-12-2030	3,6
Gouvernement de la Chine 3,13 % 21-11-2029	3,5
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,01 % 15-02-2048	3,1
Gouvernement de la Chine 3,29 % 23-05-2029	3,0
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,00 % 15-02-2049	2,8
FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	2,7
Rabobank Nederland (New York) 2,50 % 19-01-2021	2,0
Obligations du Trésor des États-Unis 2,00 % 15-02-2050	2,0
Province de l'Ontario 2,60 % 02-06-2025	1,7
Gouvernement des Bermudes 4,13 % 03-01-2023	1,7
Gouvernement de Trinité-et-Tobago 4,50 % 26-06-2030, rachetables 2030	1,5
Gouvernement du Japon 0 % 22-02-2021	1,5
Commonwealth of Bahamas 5,75 % 16-01-2024	1,4
Deutsche Bundesrepublik, obligations indexées sur l'inflation 0,50 % 15-04-2030	1,4
Gouvernement du Mexique 7,50 % 03-06-2027	1,2
Heathrow Funding Ltd. 3,79 % 04-09-2030, rachetables 2030	1,2
Gouvernement de l'Australie 2,50 % 21-05-2030	1,1
Gouvernement de l'Australie-Méridionale 3,00 % 24-05-2028	1,0
Gouvernement de Belgique 0,80 % 22-06-2028	1,0
Gouvernement de la Grèce 3,88 % 12-03-2029	0,9
Calpine Corp. 5,25 % 01-06-2026, rachetables 2021	0,9
Ville d'Oslo, taux variable 06-05-2026	0,8
République dominicaine 7,45 % 30-04-2044	0,8

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **74,6**

* Les valeurs du capital théorique représentent 11,1 % de la valeur liquidative des contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans et 1,4 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations américaines à long terme.

** Les valeurs du capital théorique représentent 3,8 % de la valeur liquidative des options achetées et -3,5 % de la valeur liquidative des options vendues.

† Les valeurs du capital théorique représentent -3,9 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations Euro-Buxl à 30 ans et -4,7 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur euro-obligations.

†† Les valeurs du capital théorique représentent 47,0 % 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 30 juin 2020

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)
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	17,4 millions \$

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.