

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2011

Aperçu du portefeuille

Répartition du portefeuille	% de la valeur liquidative
Titres à revenu fixe	55,5 %
Actions	33,1 %
Trésorerie et équivalents de trésorerie	9,0 %
Fiducies de revenu	1,7 %
Autres éléments d'actif (de passif)	0,7 %

Répartition régionale	% de la valeur liquidative
Canada	79,7 %
Trésorerie et équivalents de trésorerie	9,0 %
États-Unis	7,6 %
Royaume-Uni	1,2 %
Australie	0,7 %
Autres éléments d'actif (de passif)	0,7 %
Suisse	0,6 %
Norvège	0,2 %
Israël	0,2 %
Corée du Sud	0,1 %

Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative
Obligations de sociétés	23,5 %
Services financiers	12,9 %
Obligations provinciales	10,5 %
Trésorerie et équivalents de trésorerie	9,0 %
Adossées à des créances hypothécaires	9,2 %
Obligations fédérales	7,7 %
Énergie	7,1 %
Autres	6,9 %
Matières	5,0 %
Services de télécommunications	3,0 %
Adossées à des créances mobilières	2,3 %
Soins de santé	2,2 %
Autres éléments d'actif (de passif)	0,7 %

Exposition nette aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar canadien	97,6 %
Dollar américain	2,1 %
Franc suisse	0,3 %
Shekel israélien	0,2 %
Livre sterling	0,1 %
Euro	(0,3 %)

Les 25 principaux titres

Émetteur	% de la valeur liquidative
Trésorerie et équivalents de trésorerie	9,0 %
Province d'Ontario 4,20 % 02-06-2020	2,7 %
Province de Québec 4,50 % 01-12-2020	2,5 %
Province d'Ontario 4,65 % 02-06-2041	2,2 %
La Banque Toronto-Dominion	1,9 %
La Banque de Nouvelle-Écosse	1,9 %
Gouvernement du Canada 4,00 % 01-06-2041	1,8 %
Fiducie du Canada pour l'habitation 2,75 % 15-06-2016	1,8 %
Banque Royale du Canada	1,7 %
Banque Canadienne Impériale de Commerce	1,6 %
Banque de Montréal	1,5 %
Société aurifère Barrick	1,5 %
BCE Inc.	1,4 %
Province de Québec 5,00 % 01-12-2041	1,4 %
Power Corporation du Canada ¹⁾	1,2 %
Cenovus Energy Inc.	1,0 %
Rogers Communications Inc.	0,9 %
Potash Corp. of Saskatchewan Inc.	0,9 %
TransCanada Corp.	0,9 %
Gouvernement du Canada 3,00 % 01-12-2036, rendement réel	0,8 %
Real Estate Asset Liquidity Trust 4,872 % 12-03-2038	0,8 %
Teranet Holdings LP 5,754 % 17-12-2040	0,8 %
Microsoft Corp.	0,8 %
La Banque de Nouvelle-Écosse 6,45 % 01-01-2025	0,8 %
Royal Office Finance LP 5,209 % 12-11-2032	0,8 %

Principales positions acheteur en tant que
pourcentage de la valeur liquidative totale **42,6 %**

Valeur liquidative totale du Fonds **1,3 milliard \$**

1) L'émetteur de ce titre est affilié à Corporation Financière Mackenzie.

Le Fonds ne détenait aucune position vendeur à la fin de la période.

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 31 décembre 2011 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 au 31 mars, la date de fin d'exercice du Fonds, où elles sont disponibles dans les 90 jours.