

FONDS DE STRATÉGIES ALTERNATIVES DIVERSIFIÉES MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2023

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE

	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	38,0
<i>Obligations</i>	38,0
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)*</i>	–
Actions	37,0
Trésorerie et équivalents de trésorerie	16,7
Marchandises	7,6
Autres éléments d'actif (de passif)	1,3
Fonds/billets négociés en bourse	(0,6)

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE

	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	45,9
Trésorerie et équivalents de trésorerie	16,7
Canada	14,4
Autre	11,3
Chine	1,7
Corée du Sud	1,4
Autres éléments d'actif (de passif)	1,3
Luxembourg	1,1
Indonésie	1,1
Pérou	1,0
Mexique	0,9
Malaisie	0,8
Royaume-Uni	0,6
Philippines	0,6
Brésil	0,6
Allemagne	0,6

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE

	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Trésorerie et équivalents de trésorerie	16,7
Prêts à terme	14,0
Obligations de sociétés	12,9
Services publics	11,4
Obligations fédérales	11,1
Biens immobiliers	9,9
Services financiers	9,5
Marchandises	7,6
Produits industriels	2,2
Autres éléments d'actif (de passif)	1,3
Énergie	1,0
Technologie de l'information	0,8
Soins de santé	0,7
Consommation de base	0,5
Matériaux	0,5
Consommation discrétionnaire	0,3
Autre	0,2
Fonds/billets négociés en bourse	(0,6)

* Les valeurs théoriques représentent –1,0 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

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



MACKENZIE
Placements

FONDS DE STRATÉGIES ALTERNATIVES DIVERSIFIÉES MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 30 juin 2023

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR

	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur/Fonds sous-jacent	
FNB de revenu à taux variable Mackenzie	15,8
SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond ETF	11,2
Trésorerie et équivalents de trésorerie	10,7
Utilities Select Sector SPDR Fund	10,0
Cortland Credit Institutional LP, part	7,5
Fonds alternatif fortifié marché neutre Picton Mahoney	6,3
Vanguard FNB indiciel FTSE FPI canadien plafonné	4,0
SPDR Gold Shares ETF	3,8
Vanguard Real Estate ETF	3,6
iShares Global Infrastructure ETF	3,2
Fonds de lingots d'or Mackenzie, série R	2,5
Four Quadrant Global Real Estate Partners	2,0
Franklin Responsibly Sourced Gold ETF	1,3
Ares Capital Corp.	1,3
iShares MSCI India ETF	0,6
Crescent Capital BDC Inc.	0,5
Solar Capital Ltd.	0,5
AGCO Corp.	0,4
Oaktree Specialty Lending Corp.	0,3
Vonovia SE	0,3
TCG BDC Inc.	0,3
Saratoga Investment Corp.	0,3
Fidus Investment Corp.	0,3
Apollo Investment Corp.	0,3
Owl Rock Capital Corp.	0,3

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **87,3**

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR

	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans	—
Contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME	—
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	—
Valeur liquidative totale du Fonds	295,5 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.sedarplus.com.

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 30 juin 2023 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.



MACKENZIE
Placements