

FONDS DE STRATÉGIES ALTERNATIVES DIVERSIFIÉES MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2023

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	48,1
Obligations	48,0
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)*	0,1
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)*	–
Actions	30,2
Actions	29,4
Contrats à terme standardisés sur actions (acheteur)*	0,8
Contrats à terme standardisés sur actions (vendeur)*	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie	12,3
Marchandises	5,2
Marchandises	5,1
Contrats à terme standardisés sur marchandises (acheteur)*	0,1
Contrats à terme standardisés sur marchandises (vendeur)*	–
Autres éléments d'actif (de passif)	2,4
Fonds communs de placement	0,9
Fonds/billets négociés en bourse	0,8
Swaps**	0,1

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	39,1
Canada	14,6
Autre	14,4
Trésorerie et équivalents de trésorerie	12,3
Autres éléments d'actif (de passif)	2,4
Chine	2,0
Inde	1,8
Corée du Sud	1,7
Brésil	1,6
Taiwan	1,5
Mexique	1,1
Indonésie	0,9
Royaume-Uni	0,9
France	0,8
Afrique du Sud	0,8
Turquie	0,8
Arabie saoudite	0,7
Malaisie	0,7
Allemagne	0,7
Luxembourg	0,6
Colombie	0,6

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	15,7
Trésorerie et équivalents de trésorerie	12,3
Obligations fédérales	12,3
Obligations d'État étrangères	9,5
Prêts à terme	8,9
Marchandises	5,2
Énergie	5,0
Matériaux	4,8
Autre	4,3
Services publics	4,1
Produits industriels	4,0
Biens immobiliers	3,1
Services financiers	2,5
Autres éléments d'actif (de passif)	2,4
Soins de santé	1,7
Technologie de l'information	1,3
Consommation de base	1,3
Fonds communs de placement	0,9
Services de communication	0,7

* Les valeurs théoriques représentent 0,1 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur), 0,8 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur actions (acheteur), 0,1 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur marchandises (acheteur), –2,1 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur), –0,4 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur actions (vendeur) et –0,1 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur marchandises (vendeur).

** Les valeurs théoriques représentent 4,3 % de la valeur liquidative des swaps.

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 31 décembre 2023

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR

% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

Émetteur/Fonds sous-jacent	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
iShares J.P. Morgan USD Emerging Markets Bond ETF	9,8
FINB TIPS américains Mackenzie (couvert en \$ CA)	9,5
FNB de revenu à taux variable Mackenzie	9,5
Fonds mondial de ressources Mackenzie, série R	7,7
Fonds alternatif fortifié marché neutre Picton Mahoney	7,4
Fonds de petites capitalisations des marchés émergents Mackenzie, série R	6,7
Cortland Credit Institutional LP, part	5,1
Fonds global macro Mackenzie, série R	3,5
VanEck Vectors Fallen Angel High Yield Bond ETF	3,4
Fonds de lingots d'or Mackenzie, série R	3,2
SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond ETF	3,0
iShares Global Infrastructure ETF	2,8
PowerShares DB Commodity Index Tracking Fund ETF	2,7
Trésorerie et équivalents de trésorerie	2,7
iShares Core S&P Small-Cap ETF	2,6
Utilities Select Sector SPDR Fund	2,1
SPDR Gold Shares ETF	1,9
Four Quadrant Global Real Estate Partners	1,7
Fonds des marchés émergents Mackenzie, série R	1,4
Vanguard Real Estate ETF	0,8
Fonds mondial toutes capitalisations de l'environnement Mackenzie Greenchip, série R	0,6
Global X Aging Population ETF	0,5
Global X Cloud Computing ETF	0,5
VanEck India Growth Leaders ETF	0,5
VanEck Vectors Agribusiness ETF	0,5
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	90,1

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR

% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

Émetteur	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans	—
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	—
Valeur liquidative totale du Fonds	253,8 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.ca.

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 31 décembre 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