

FONDS DE STRATÉGIES ALTERNATIVES DIVERSIFIÉES MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2024

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	46,2
Obligations	45,4
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)*	0,8
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)*	–
Actions	34,8
Actions	29,0
Contrats à terme standardisés sur actions (acheteur)*	5,5
Options achetées	0,2
Options vendues	0,1
Contrats à terme standardisés sur actions (vendeur)*	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie	7,2
Marchandises	6,0
Marchandises	5,0
Contrats à terme standardisés sur marchandises (acheteur)*	1,0
Contrats à terme standardisés sur marchandises (vendeur)*	–
Autres éléments d'actif (de passif)	4,5
Fonds communs de placement	0,8
Fonds/billets négociés en bourse	0,5

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	40,4
Canada	14,8
Trésorerie et équivalents de trésorerie	7,2
Autre	7,1
Autres pays d'Asie	5,9
Autres éléments d'actif (de passif)	4,5
Autres pays d'Europe	3,7
Chine	2,7
Inde	2,2
Autres pays d'Amérique	2,2
Taiwan	2,1
Corée du Sud	1,7
France	1,3
Arabie saoudite	1,2
Turquie	1,0
Brésil	1,0
Royaume-Uni	1,0

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations fédérales	17,9
Obligations de sociétés	13,0
Obligations d'État étrangères	11,1
Autre	9,7
Trésorerie et équivalents de trésorerie	7,2
Énergie	5,7
Produits industriels	5,1
Marchandises	5,0
Technologie de l'information	4,8
Autres éléments d'actif (de passif)	4,5
Matériaux	4,2
Prêts à terme	3,7
Services financiers	2,6
Services publics	2,1
Biens immobiliers	1,7
Consommation discrétionnaire	1,7

* Les valeurs théoriques représentent 0,8 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur), 5,5 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur actions (acheteur), 1,0 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur marchandises (acheteur), –1,5 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur), –6,1 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur actions (vendeur) et –0,4 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur marchandises (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 2024

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR

Émetteur/Fonds sous-jacent	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
iShares J.P. Morgan USD Emerging Markets Bond ETF	14,9
FINB TIPS américains Mackenzie (couvert en \$ CA)	10,1
Fonds mondial de ressources Mackenzie, série R	8,0
Fonds de petites capitalisations des marchés émergents Mackenzie, série R	7,2
Cortland Credit Institutional LP, part	6,4
Fonds alternatif fortifié marché neutre Picton Mahoney	5,4
Fonds global macro Mackenzie, série R	5,3
Fonds quantitatif américain de petites capitalisations Mackenzie, série R	4,0
Fonds de lingots d'or Mackenzie, série R	3,7
iShares Global Infrastructure ETF	3,3
FNB de revenu à taux variable Mackenzie	3,2
PowerShares DB Commodity Index Tracking Fund ETF	3,0
SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond ETF	2,5
Four Quadrant Global Real Estate Partners	2,2
Trésorerie et équivalents de trésorerie	2,2
iShares Emerging Markets Corporate Bond ETF	2,0
Fonds des marchés émergents Mackenzie, série R	1,8
ProShares UltraShort Lehman 7-10 Year Treasury	0,6
iShares Cybersecurity and Tech ETF	0,5
iShares PHLX Semiconductor ETF	0,5
SPDR S&P Homebuilders ETF	0,5
Fonds toutes obligations Chine Mackenzie ChinaAMC, série R	0,5
Global X Uranium ETF	0,5
SonicShares Global Shipping ETF	0,5
SPDR Gold Shares ETF	0,3
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	89,1

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR

Émetteur	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Energy Select Sector	—
Contrats à terme standardisés sur l'indice Mini MSCI Marchés émergents	—
Contrats à terme standardisés sur l'indice Mini Russell 2000	—
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Utilities Select Sector	—
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	—
Valeur liquidative totale du Fonds	147,1 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 30 juin 2024 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