

FONDS DE STRATÉGIES ALTERNATIVES DIVERSIFIÉES MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2024

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	48,4
Obligations	46,7
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)*	1,7
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)*	–
Actions	39,7
Actions	35,6
Contrats à terme standardisés sur actions (acheteur)*	4,1
Contrats à terme standardisés sur actions (vendeur)*	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie	5,3
Autres éléments d'actif (de passif)	4,5
Marchandises	4,2
Marchandises	3,8
Contrats à terme standardisés sur marchandises (acheteur)*	0,4
Contrats à terme standardisés sur marchandises (vendeur)*	–
Fonds communs de placement	0,7
Contrats à terme standardisés sur devises (acheteur)*	0,2
Swaps**	–
Fonds/billets négociés en bourse	(3,0)

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	32,4
Canada	19,0
Autre	9,9
Autres pays d'Asie	6,8
Trésorerie et équivalents de trésorerie	5,3
Autres pays d'Europe	4,7
Autres éléments d'actif (de passif)	4,5
Chine	3,4
Inde	2,5
Royaume-Uni	2,4
Taiwan	2,1
Mexique	1,7
Corée du Sud	1,5
Brésil	1,4
Arabie saoudite	1,2
Turquie	1,2

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations d'État étrangères	27,7
Obligations de sociétés	16,9
Autre	8,2
Produits industriels	6,1
Énergie	5,4
Trésorerie et équivalents de trésorerie	5,3
Biens immobiliers	4,8
Autres éléments d'actif (de passif)	4,5
Services financiers	4,4
Matériaux	4,3
Marchandises	4,2
Technologie de l'information	3,7
Services publics	2,6
Prêts à terme	1,7
Consommation discrétionnaire	1,7
Soins de santé	1,5
Fonds/billets négociés en bourse	(3,0)

* Les valeurs théoriques représentent 1,7 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur), 4,1 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur actions (acheteur), 0,4 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur marchandises (acheteur), 0,2 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur devises (acheteur), –0,5 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur), –6,6 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur actions (vendeur) et –0,3 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur marchandises (vendeur).

** Les valeurs théoriques représentent 0,0 % 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 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
Cortland Credit Institutional LP, part	10,7
FINB TIPS américains Mackenzie (couvert en \$ CA)	9,9
Fonds alternatif fortifié marché neutre Picton Mahoney	9,2
Fonds mondial de ressources Mackenzie, série R	6,7
Fonds de petites capitalisations des marchés émergents Mackenzie, série R	6,3
iShares Global Infrastructure ETF	4,6
Fonds global macro Mackenzie, série R	4,3
Fonds de lingots d'or Mackenzie, série R	3,8
Fonds quantitatif américain de petites capitalisations Mackenzie, série R	3,7
Fonds des marchés émergents Mackenzie, série R	3,0
PowerShares DB Commodity Index Tracking Fund ETF	3,0
Four Quadrant Global Real Estate Partners	2,8
SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond ETF	2,2
iShares Emerging Markets Corporate Bond ETF	2,1
FNB de revenu à taux variable Mackenzie	1,0
Fonds toutes obligations Chine Mackenzie ChinaAMC, série R	0,9
Trésorerie et équivalents de trésorerie	0,6
iShares PHLX Semiconductor ETF	0,5
iShares Cybersecurity and Tech ETF	0,5
Sonicshares Global Shipping ETF	0,5
SPDR KBW Insurance ETF	0,5
SPDR S&P Homebuilders ETF	0,4
Condor Merger Sub Inc. 7,38 % 15-02-2030	0,3
Altice France SA 5,13 % 15-07-2029	0,2
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	92,6

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR

Émetteur	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Contrats à terme standardisés sur l'indice Mini Russell 2000	—
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Utilities Select Sector	—
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Energy Select Sector	—
Contrats à terme standardisés sur l'indice Mini MSCI Marchés émergents	—
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	—
Valeur liquidative totale du Fonds	91,7 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 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