

# Équipe des actions quantitatives mondiales Mackenzie

Les placements mondiaux alimentés par la science des données et l'intuition humaine

Nous sommes une équipe de gestion de portefeuille de base qui conçoit des modèles quantitatifs sophistiqués pour découvrir des occasions mondiales.

La recherche fondamentale traditionnelle dans le domaine des placements consiste à examiner les états financiers de quelques sociétés à la fois et à investir dans celles qui présentent une occasion en fonction des facteurs de croissance, de valeur ou de qualité. Bien que la recherche fondamentale demeure essentielle, l'équipe des actions quantitatives mondiales Mackenzie adopte une approche moderne.

Nos renseignements – de dernière heure – sur un vaste univers de sociétés couvrent les facteurs de croissance, de valeur et de qualité, les paramètres de risque et les données non traditionnelles. Nous utilisons l'apprentissage machine qui permet de prévoir les revenus et le traitement du langage naturel en interprétant des rapports annuels à grande échelle. Ces systèmes détectent des signaux que l'analyse qualitative pourrait négliger.



Nous classons environ 10 000 titres mondiaux et 8 000 titres des marchés émergents selon plus de 20 facteurs, quotidiennement.

Cette approche révèle de façon continue les occasions offertes sur les marchés américain, mondiaux et émergents. Il s'agit d'un modèle d'efficacité, car nous utilisons des modèles algorithmiques pour aider à réduire les coûts de négociation. Par-dessus tout, cette stratégie de placement va au-delà des conventions afin d'élaborer des portefeuilles d'actions de base à alpha élevé, en tenant compte des risques, sans égard au style de placement.

#### **NOTRE APPROCHE**

#### Optimiser les capacités humaines

Nous dotons des personnes compétentes de modèles quantitatifs avancés et en constante évolution.

#### Établir plus de liens

Nous scrutons en détail les marchés mondiaux pour faire des liens que d'autres pourraient manquer.

#### Transcender les cycles de marché

Nous visons l'alpha et gérons le risque à l'échelle des styles de croissance, de valeur et de qualité.

#### **Mandats**

FNB américain à faible volatilité Mackenzie FNB canadien à faible volatilité Mackenzie FNB d'actions internationales Mackenzie FNB d'actions mondiales Mackenzie FNB mondial à faible volatilité Mackenzie Fonds d'actions mondiales charia Mackenzie Fonds d'actions mondiales Mackenzie Fonds de petites capitalisations américaines Mackenzie Fonds de reproduction de capital-investissement Mackenzie Fonds des marchés émergents Mackenzie Fonds mondial à faible volatilité Mackenzie Fonds mondial équilibré Mackenzie GQE Fonds canadien équilibré Mackenzie GQE Fonds d'actions canadiennes Mackenzie GQE Fonds américain d'extension d'alpha Mackenzie GQE

## Optimiser les capacités humaines

Nous dotons des professionnels compétents de modèles quantitatifs avancés et en constante évolution.

Située à Boston, carrefour de premier plan de l'investissement quantitatif, l'équipe des actions quantitatives mondiales Mackenzie partage le même bassin de talents issus des écoles de l'Ivy League que les meilleures sociétés technologiques. Les gestionnaires de portefeuille et les analystes travaillent ensemble à l'élaboration et à l'amélioration de nos modèles quantitatifs, en apprentissage machine et en traitement du langage naturel.

Le rôle de notre technologie est de rehausser le jugement humain. La répartition du portefeuille est influencée par nos perspectives, que ce soit en ajustant l'exposition géographique pour éviter les régions en conflit ou en privilégiant les titres axés sur la valeur lorsque des événements mondiaux créent des occasions découlant d'évaluations erronées. Chaque opération est surveillée par une ou un gestionnaire de portefeuille qualifié.

## Établir plus de liens

Nous scrutons en détail les marchés mondiaux pour faire des liens que d'autres pourraient manquer.

Les facteurs pouvant empêcher les investisseurs et investisseuses de profiter des occasions de placement les plus intéressantes au monde sont nombreux. Par exemple, le manque de connaissance des marchés étrangers, les répercussions indésirables sur les marchés moins liquides, les coûts de transaction élevés ou l'incapacité de repérer les corrélations entre d'innombrables signaux d'alpha et le rendement du cours des actions individuelles.

L'équipe des actions quantitatives mondiales Mackenzie a toutes les compétences requises pour repérer et exploiter les anomalies de prix quotidiennes sur les marchés mondiaux et émergents. Que nous repérions une société de financement d'infrastructures sous-évaluée en Inde ou que nous utilisions des analyses prédictives pour anticiper un bénéfice inattendu à Santa Clara, nous avons perfectionné notre capacité à faire des liens et à capitaliser.

## Transcender les cycles de marché

Nous visons l'alpha et gérons le risque à l'échelle des styles de croissance, de valeur et de qualité.

Notre modèle quantitatif établit un équilibre entre les facteurs de valeur, de croissance et de qualité, ce qui permet à nos portefeuilles d'anticiper n'importe quel cycle de marché et d'y réagir. Cette approche, qui fait fi des styles, ouvre la voie à de possibles rendements substantiels, indépendamment de la conjoncture du marché, et permet à l'équipe des actions quantitatives mondiales Mackenzie de se démarquer clairement des autres gestionnaires de portefeuille des marchés mondiaux et émergents.

Nous gérons des fonds de base, qui produisent leur plein effet en tant que principal placement en actions au sein d'un portefeuille de titres mondiaux ou de marchés émergents. Nous suivons le marché de façon générale, et les rendements après déduction des frais viennent s'ajouter à cela. Avec un actif de près de 10 G\$ CA et une solide feuille de route, notre thèse est éprouvée.

#### Pourquoi choisir Mackenzie

Notre mission consiste à créer ensemble un monde davantage investi, afin que tous les Canadiens et Canadiennes soient en meilleure position financièrement.

# Investir dans l'avenir, ensemble

Nous établissons des relations inébranlables avec des conseillers et conseillères afin d'aider les investisseurs et investisseuses à réaliser leur potentiel au moyen d'une large gamme de solutions de placement novatrices répondant à tous leurs besoins. Nous avons à cœur d'investir dans un avenir responsable et durable, tout en rendant les placements plus faciles à comprendre.

# **Expertise et solutions de spécialistes**

Mackenzie offre un choix parmi de multiples boutiques de placement – des équipes de spécialistes qui visent des stratégies et des occasions distinctes.

## Soutenus par la force

Membre de la Société financière IGM et du groupe de sociétés de la Corporation Financière Power, chefs de file de confiance en matière de conseils. Le total de l'actif géré et de l'actif sous services-conseils (AG/ASSC) de la Société financière IGM est de plus de 270,4 G\$ (CAD) au 31 décembre 2024.

## L'équipe des actions quantitatives mondiales Mackenzie



Arup Datta, M.B.A., CFA

Vice-président principal, Gestionnaire de portefeuille, Chef d'équipe

S'est joint à Mackenzie en 2017 Expérience en placement depuis 1992

M. Datta est un investisseur « quantitatif » professionnel depuis plus de 30 ans, ayant géré des portefeuilles dans pratiquement toutes les capitalisations et régions du monde. De 1992 à 2012, il a été analyste quantitatif, gestionnaire de portefeuille, directeur général des placements américains et directeur général de la gestion de portefeuille à Man Numeric. Il a ensuite fondé Agriya Investors, qui est devenue par la suite la division mondiale et internationale d'AJO.

M. Datta est titulaire d'un baccalauréat en technologie de l'Indian Institute of Technology et d'une maîtrise en administration des affaires avec distinction de la Johnson School of Management de l'Université Cornell.



**Nicholas Tham, M.A., CFA** Vice-président, gestionnaire de portefeuille

S'est joint à Mackenzie en 2017 Expérience en placement depuis 2009

M. Tham a commencé sa carrière à titre d'analyste quantitatif et de négociateur pour un fonds de couverture de Boston.

- Il a rejoint Arup Datta à titre de gestionnaire de portefeuille à Agriya Investors (et plus tard à AJO), gérant des stratégies d'actions à capacité limitée visant les marchés émergents et les marchés développés.
- Il détient une maîtrise en statistique de l'Université Harvard et des baccalauréats en mathématiques et en physique du Massachusetts Institute of Technology.



**Denis Suvorov, M.B.A., M.S., CFA** Vice-président, gestionnaire de portefeuille

S'est joint à Mackenzie en 2018 Expérience en placement depuis 2001

M. Suvorov a codirigé le lancement et la gestion de la stratégie d'actions neutre au marché à moyen terme à Teza Technologies.

- Il a géré des portefeuilles à Man Numeric avec Arup Datta, puis chez Goldman Sachs Asset Management.
- Il détient un baccalauréat en économie du Utah State University College of Business, et une maîtrise en administration des affaires avec distinction et une maîtrise en économie appliquée de l'Université de Rochester.



Haijie Chen, Ph. D., CFA Vice-président, gestionnaire de portefeuille

S'est joint à Mackenzie en 2018 Expérience en placement depuis 2011

M. Chen a commencé sa carrière en tant que chercheur en analyse quantitative auprès de State Street Associates.

- Il a géré des portefeuilles avec Arup Datta à titre de gestionnaire de portefeuille à AJO, société institutionnelle d'actions quantitatives établie à Philadelphie.
- Il détient un baccalauréat en génie automobile de l'Université Tsinghua et un doctorat en génie mécanique du Massachusetts Institute of Technology.

# Codes et frais de gestion du fonds

Nom du fonds	Série	Préfixe/symbole	FA	FR	FM3	Frais de gestion	RFG*
FNB américain à faible volatilité Mackenzie	-	MULV	_	-	-	0,45 %	-
FNB canadien à faible volatilité Mackenzie	_	MCLV	_	_	-	0,45 %	_
FNB d'actions internationales Mackenzie	-	MIQE	_	-	_	0,80 %	_
FNB d'actions mondiales Mackenzie	_	MGQE	_	-	-	0,80 %	-
FNB mondial à faible volatilité Mackenzie	_	MWLV	_	_	-	0,50 %	0,57 %
Fonds d'actions mondiales charia Mackenzie	А	MFC	7549	7550**	7551**	2,00 %	2,64 %
	F	MFC	7554	_	_	0,80 %	1,16 %
	PW	MFC	7557	-	_	1,80 %	2,27 %
Fonds d'actions mondiales Mackenzie	А	MFC	734	834**	3184**	2,00 %	2,51 %
	F	MFC	099	_	_	0,80 %	1,05 %
	PW	MFC	6119	_	_	1,80 %	2,15 %
Fonds de petites capitalisations américaines Mackenzie	А	MFC	7656	7657**	7658**	2,00 %	_
	F	MFC	7663	_	_	0,80 %	_
	PW	MFC	7670	_	_	1,80 %	_
Fonds de reproduction de capital-investissement Mackenzie	А	MFC	8196	_	_	2,10 %	2,69 %
	F	MFC	8197	_	_	1,00 %	1,31 %
	PW	MFC	8200	_	_	2,00 %	2,45 %
Fonds des marchés émergents Mackenzie	А	MFC	5501	5502**	5503**	2,00 %	2,54 %
	F	MFC	5505	_	_	0,80 %	1,06 %
	PW	MFC	5508	_	_	1,80 %	2,17 %
Fonds mondial à faible volatilité Mackenzie	А	MFC	7537	7538**	7539**	1,55 %	1,91 %
	F	MFC	7542	_	_	0,50 %	0,74 %
	PW	MFC	7545	_	_	1,50 %	1,81 %
Fonds mondial équilibré Mackenzie GQE	А	MFC	7725	7726**	7727**	1,85 %	_
	F	MFC	7729	_	_	0,70 %	_
	PW	MFC	7735	_	_	1,70 %	_
Fonds canadien équilibré Mackenzie GQE	А	MFC	7773	7774**	7775**	1,85 %	_
	F	MFC	7777	_	_	0,70 %	_
	PW	MFC	7783	_	_	1,70 %	_
Fonds d'actions canadiennes Mackenzie GQE	А	MFC	7749	7750**	7751**	2,00 %	_
	F	MFC	7753	_	_	0,75 %	_
	PW	MFC	7759	_	_	1,75 %	_
Fonds américain d'extension d'alpha Mackenzie GQE	А	MFC	7714	_	_	2,25 %	_
	F	MFC	7716	_	_	1,15 %	_
	PW	MFC	7720	_	_	2,15 %	_

<sup>\*</sup> RFG au 31 mars 2024

<sup>\*\*</sup> Depuis le 1<sup>er</sup> juin 2022, le mode de souscription avec frais de rachat et le mode de souscription avec frais modérés ne sont plus offerts pour l'achat de titres, y compris les achats faits au moyen d'un programme systématique comme un programme de prélèvements préautorisés. Il demeurera possible d'échanger des titres d'un fonds Mackenzie acquis selon le mode de souscription avec frais de rachat ou avec frais modérés pour des titres d'un autre fonds Mackenzie selon le même mode de souscription, jusqu'à l'expiration du barème applicable des frais de rachat.



# Pour en savoir plus sur <u>l'équipe des actions quantitatives mondiales Mackenzie</u>, communiquer avec votre conseiller ou conseillère.

Les placements dans les fonds communs peuvent donner lieu à des commissions de vente et de suivi, ainsi qu'à des frais de gestion et autres. Veuillez lire le prospectus avant d'investir. Les placements dans les fonds communs ne sont pas garantis, leur valeur varie fréquemment et leur rendement antérieur peut ne pas se reproduire.

Le contenu du présent document (y compris les faits, les perspectives, les opinions, les recommandations, les descriptions de produits ou titres ou les références à des produits ou titres) ne doit pas être pris ni être interprété comme un conseil en matière de placement ni comme une offre de vente ou une sollicitation d'offre d'achat, ou une promotion, recommandation ou commandite de toute entité ou de tout titre cité. Bien que nous nous efforcions d'en assurer l'exactitude et l'exhaustivité, nous n'assumons aucune responsabilité quant à son utilisation.

4136153 10/24