

# Fonds de stratégies alternatives diversifiées Mackenzie Série F

## Actifs Alternatifs

### Rendement annualisé composé 30/04/2023

1 mois	0,6 %
3 mois	-2,7 %
Année à ce jour	0,5 %
1 an	-4,2 %
2 ans	0,3 %
3 ans	4,5 %
5 ans	1,9 %
Depuis le lancement (oct. 2015)	3,4 %

### Répartition régionale 31/03/2023

#### TRÉSORERIE ET ÉQUIV.

Trésorerie et équivalents	12,7 %
---------------------------	--------

#### ACTIONS

États-Unis	29,7 %
Canada	18,8 %
Royaume-Uni	1,5 %
Pérou	0,4 %
Autres	0,5 %

#### REVENU FIXE

Canada	23,8 %
États-Unis	11,7 %
Luxembourg	0,3 %
Suisse	0,1 %
Autres	0,5 %

### Répartition sectorielle 31/03/2023

Titres à revenu fixe	36,4 %	Santé	0,5 %
FNB	36,0 %	Immobilier	0,4 %
Trésorerie et équivalents	12,7 %	Services de	0,1 %
Finance	9,7 %	communications	
Produits de base	3,9 %	Autres	-0,2 %
Technologie de l'information	0,5 %		

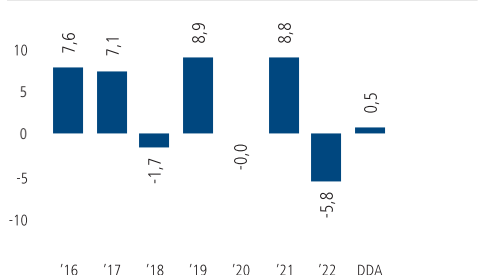
### Répartition par cote\*\*\*\* 31/03/2023

AAA	0,3 %	B	10,3 %
AA	0,0 %	CCC et moins	2,3 %
A	0,4 %	Oblig. non évaluées	9,4 %
BBB	1,8 %	Trésorerie et équivalents	13,5 %
BB	4,1 %	Actions	58,0 %

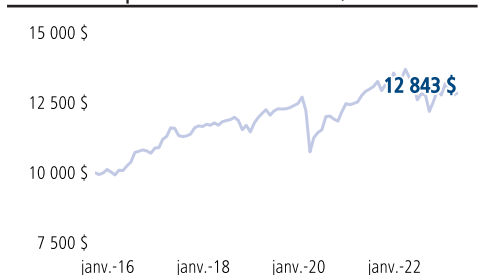
### Gestionnaires de portefeuille

Équipe des stratégies systématiques Mackenzie  
Matthew Cardillo

### Rendement pour l'année civile (%) 30/04/2023



### Valeur d'un placement de 10 000 \$ 30/04/2023



### Principaux titres\*\*\* 31/03/2023

Les principaux titres représentent 62,5 % du fonds

#### ACTIONS

Utilities Select Sector SPDR Fund	9,8 %
Vanguard Real Estate ETF	6,7 %
FNB indiciel FTSE FPI canadien plafonné Vanguard	6,2 %
Fonds alternatif fortifié marché neutre Picton Mahoney	5,8 %
Energy Select Sector SPDR Fund	3,5 %

#### REVENU FIXE

FNB de revenu à taux variable Mackenzie	14,4 %
SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond ETF	8,6 %
Cortland Credit Institutional LP Unit	6,8 %
Invesque Inc. 5,00 % 31-01-2025, conv.	0,3 %
Fonds toutes obligations Chine Mackenzie ChinaAMC, série R	0,2 %

NOMBRE TOTAL DE PLACEMENTS EN ACTIONS : 130

NOMBRE TOTAL DE PLACEMENTS EN TITRES À REVENU FIXE : 172

### Évaluation du risque du fonds (3 ans) 31/03/2023

Écart-type ann.	7,76	Bêta	0,64
Écart-type ann. ind. de réf.	10,07	R-carré	0,70
Alpha	0,65	Ratio de Sharpe	0,62

Source : Placements Mackenzie

### Données clés sur le fonds

Actif total du fonds : 314,4 millions \$

Valeur liquidative par titre (28/04/2023) : 10,33 \$CA

RFG (sept. 2022) : F : 1,03 % A : 2,39 %

Frais de gestion : F : 0,70 % A : 1,85 %

60 % MSCI Monde + 40 % BofA Merrill

Indice de référence\*\* : Lynch Global Broad Market (couvert en \$ CA)

Dernière distribution :

SÉRIE	FRÉQUENCE	MONTANT	DATE
F	Mensuelle	0,0343	4/21/2023
A	Mensuelle	0,0282	4/21/2023
FB	Mensuelle	0,0325	4/21/2023
PW	Mensuelle	0,0297	4/21/2023
PWFB	Mensuelle	0,0318	4/21/2023

Codes du fonds :

SÉRIE (\$ CA)	PRÉFIXE	FA	FR *	FM2 *	FM3 *
F	MFC	4859	—	—	—
A	MFC	4855	4856	7251	4857
FB	MFC	4861	—	—	—
PW	MFC	6549	—	—	—
PWFB	MFC	6847	—	—	—

D'autres séries de fonds sont disponibles à l'adresse [placementsmackenzie.com/codesdefonds](http://placementsmackenzie.com/codesdefonds)

### Pourquoi investir dans ce fonds?

- Donne accès à un portefeuille diversifié de catégories d'actif non traditionnelles.
- Vise à compléter un portefeuille équilibré traditionnel, améliorer potentiellement le rendement corrigé du risque et fournir une diversification additionnelle.
- Les catégories d'actif non traditionnelles étaient historiquement utilisées par les investisseurs institutionnels en vue d'atteindre les objectifs de rendement et de diversification.

### Tolérance au risque

FAIBLE	MOYENNE	ÉLEVÉE
--------	---------	--------



\* À compter du 1er juin 2022, le mode de souscription avec frais de rachat et le mode de souscription avec frais modérés ne seront 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.

\*\* L'indice mixte est composé à 60 % de l'indice MSCI Monde et à 40 % de l'indice BofAML Global Broad Market (couvert en \$ CA).

\*\*\* Les principaux titres en portefeuille de ce fonds peuvent, mais non nécessairement, représenter les plus importants titres du fonds. Plutôt, les principaux titres sont sélectionnés pour leur signification générale dans l'évaluation du portefeuille de placement.

\*\*\*\* Les notes de crédit et les catégories de crédit sont basées sur les notes d'une agence de notation désignée.