

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2024

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE

	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Autres éléments d'actif (de passif)	3,5	23,2	26,7
Trésorerie et équivalents de trésorerie [†]	26,4	–	26,4
Obligations	36,1	(11,2)	24,9
Obligations	26,5	(1,3)	25,2
Contrats à terme standardisés*	9,6	(9,9)	(0,3)
Actions	57,7	(35,5)	22,2
Actions	42,5	(23,7)	18,8
Contrats à terme standardisés**	14,9	(11,8)	3,1
Options achetées [†]	0,3	–	0,3
Contrats à terme standardisés sur marchandises ^{††}	1,3	(1,5)	(0,2)
Swaps [§]	–	–	–
Fonds/billets négociés en bourse	0,4	(0,4)	–
Options sur swaps achetées ^{§§}	–	–	–
Options sur swaps vendues ^{§§}	–	–	–

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE

	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Autres éléments d'actif (de passif)	3,5	23,2	26,7
Trésorerie et équivalents de trésorerie [†]	26,4	–	26,4
Chine	13,2	(0,5)	12,7
États-Unis	35,2	(23,5)	11,7
Canada	22,2	(11,3)	10,9
France	3,4	(0,6)	2,8
Autre	4,3	(1,8)	2,5
Mexique	2,1	–	2,1
Royaume-Uni	3,0	(1,2)	1,8
Italie	1,8	(0,3)	1,5
Taiwan	1,1	–	1,1
Pologne	0,9	–	0,9
Brésil	0,8	–	0,8
Suisse	1,0	(0,2)	0,8
Espagne	0,7	–	0,7
Pays-Bas	0,8	(0,2)	0,6
Australie	3,1	(2,6)	0,5
Suède	0,2	(0,1)	0,1
Finlande	–	(0,1)	(0,1)
Norvège	–	(0,6)	(0,6)
Thaïlande	–	(1,0)	(1,0)
Allemagne	–	(1,4)	(1,4)
Japon	1,7	(3,2)	(1,5)

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE

	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Autres éléments d'actif (de passif)	3,5	23,2	26,7
Trésorerie et équivalents de trésorerie [†]	26,4	–	26,4
Obligations de sociétés	25,3	(1,3)	24,0
Énergie	20,8	(14,6)	6,2
Contrats à terme standardisés sur actions	14,9	(11,8)	3,1
Consommation discrétionnaire	4,0	(1,0)	3,0
Obligations d'État étrangères	10,6	(8,2)	2,4
Services financiers	3,8	(1,7)	2,1
Consommation de base	2,4	(0,5)	1,9
Services de communication	2,2	(0,4)	1,8
Produits industriels	3,0	(1,9)	1,1
Services publics	1,6	(1,0)	0,6
Matériaux	1,0	(0,4)	0,6
Technologie de l'information	1,9	(1,3)	0,6
Biens immobiliers	0,5	(0,3)	0,2
Soins de santé	0,6	(0,6)	–
Fonds/billets négociés en bourse	0,4	(0,4)	–
Contrats à terme standardisés sur marchandises	1,3	(1,5)	(0,2)
Autre	1,2	(1,7)	(0,5)

[†] Les valeurs théoriques représentent 15,4 % de la valeur liquidative des options achetées.

[§] Les valeurs théoriques représentent 6,0 % de la valeur liquidative des swaps.

^{§§} Les valeurs théoriques représentent 8,3 % de la valeur liquidative des options sur swaps achetées et –8,0 % de la valeur liquidative des options sur swaps vendues.

^{††} Une portion de la répartition effective de la trésorerie du Fonds est investie dans des titres de série R d'un fonds du marché monétaire géré par Mackenzie.

La répartition effective présente l'exposition du Fonds par portefeuille, région ou secteur calculée en combinant les placements directs et indirects du Fonds.

Les notes restantes sont présentées à la suite de l'aperçu du portefeuille.



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 30 juin 2024

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur/Fonds sous-jacent	
Trésorerie et équivalents de trésorerie [†]	52,0
Fonds toutes actions Chine Mackenzie ChinaAMC, série R	7,1
Enerflex Ltd.	1,1
Sitio Royalties Corp.	1,0
EOG Resources Inc.	0,9
BP PLC	0,9
Whitecap Resources Inc.	0,9
Tencent Holdings Ltd.	0,8
Tourmaline Oil Corp.	0,8
Shell PLC	0,8
Plains GP Holdings LP	0,7
SPDR S&P Oil & Gas Exploration & Production ETF	0,6
Advantage Energy Ltd.	0,6
Chesapeake Energy Corp.	0,6
Coinbase Global Inc. 3,63 % 01-10-2031	0,6
Total SA	0,6
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-01-2025	0,6
Halliburton Co.	0,6
ARC Resources Ltd.	0,6
Obligation fédérale 2,10 % 12-04-2029	0,5
Saturn Oil & Gas Inc.	0,5
Compagnie Crédit Ford du Canada 2,96 % 16-09-2026	0,5
Paramount Resources Ltd.	0,5
Topaz Energy Corp.	0,5
Tamarack Valley Energy Ltd.	0,5
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	74,8

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
NuVista Energy Ltd.	(0,8)
Suncor Énergie Inc.	(0,8)
Diamondback Energy Inc.	(0,7)
Athabasca Oil Corp.	(0,7)
ONEOK Inc.	(0,7)
Exxon Mobil Corp.	(0,7)
Innergex énergie renouvelable inc.	(0,6)
Obsidian Energy Ltd.	(0,6)
SM Energy Co.	(0,6)
Matador Resources Co.	(0,6)
Chevron Corp.	(0,6)
Occidental Petroleum Corp.	(0,6)
NOW Inc.	(0,6)
Chord Energy Corp.	(0,6)
Baytex Energy Corp.	(0,5)
TRI Pointe Group Inc. 5,70 % 15-06-2028	(0,5)
Credit Acceptance Corp. 6,63 % 15-03-2026	(0,5)
Range Resources Corp.	(0,5)
Veren Inc.	(0,5)
Compagnie Pétrolière Impériale Ltée	(0,5)
Enbridge Inc.	(0,5)
Equinor ASA	(0,5)
CNX Resources Corp.	(0,5)
NOV Inc.	(0,5)
Kelt Exploration Ltd.	(0,4)
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(14,6)

Valeur liquidative totale du Fonds

55,6 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

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 30 juin 2024

VALEURS THÉORIQUES	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE	VALEURS THÉORIQUES	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
* Obligations – Contrats à terme standardisés (acheteur)	9,5	Actions – Contrats à terme standardisés (vendeur)	(11,8)
Contrats à terme standardisés sur obligations américaines à 5 ans	2,6	Contrats à terme standardisés sur l'indice SPI 200	(2,2)
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor du Commonwealth à 10 ans	2,6	Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini S&P Materials Select Sector	(2,1)
Contrats à terme standardisés sur obligations euro-OAT	2,3	Contrats à terme standardisés sur l'indice S&P/TSX 60	(1,9)
Contrats à terme standardisés sur obligations du Royaume-Uni	1,2	Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Health Care Select Sector	(1,1)
Contrats à terme standardisés à très long terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans	0,8	Contrats à terme standardisés sur l'indice SET50	(1,0)
		Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE 100	(1,0)
Obligations – Contrats à terme standardisés (vendeur)	(9,9)	Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Utilities Select Sector	(0,9)
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor américain à 10 ans	(4,6)	Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE China A50	(0,5)
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans	(2,2)	Contrats à terme standardisés sur l'indice CAC40	(0,4)
Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 10 ans	(1,7)	Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Consumer Staples Select Sector	(0,4)
Contrats à terme standardisés sur euro-obligations	(1,4)	Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Industrials Select Sector	(0,3)
** Actions – Contrats à terme standardisés (acheteur)	14,8	†† Marchandises – Contrats à terme standardisés (acheteur)	1,3
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-Mini S&P 500	2,7	Contrats à terme standardisés sur le plomb LME	0,4
Contrats à terme standardisés Bolsa Mexicana	1,6	Contrats à terme standardisés sur la farine de soja	0,3
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-Mini S&P 500 Real Estate	1,4	Contrats à terme standardisés sur le maïs	0,2
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE MIB	1,3	Contrats à terme standardisés sur le sucre n° 11	0,2
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE Taiwan	1,1	Contrats à terme standardisés sur le soja	0,1
Contrats à terme standardisés libellés en yens sur l'indice Nikkei 225	0,9	Contrats à terme standardisés sur l'huile de soja	0,1
Contrats à terme standardisés sur l'indice WIG20	0,9	Marchandises – Contrats à terme standardisés (vendeur)	(1,5)
Contrats à terme standardisés sur l'indice Mini Russell 2000	0,8	Contrats à terme standardisés sur le cuivre LME	(0,6)
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Energy Select Sector	0,7	Contrats à terme standardisés sur le zinc LME	(0,4)
Contrats à terme standardisés sur l'indice Swiss Market	0,7	Contrats à terme standardisés sur le coton n° 2	(0,2)
Contrats à terme standardisés sur l'indice IBEX 35	0,6	Contrats à terme standardisés sur l'aluminium LME	(0,2)
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Information Technology Select Sector	0,6	Contrats à terme standardisés sur le blé RVH de KC	(0,1)
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Consumer Discretionary Select Sector	0,5		
Contrats à terme standardisés FTSE/JSE Top 40	0,4		
Contrats à terme standardisés sur l'indice MSCI Singapore	0,3		
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Communication Services Select Sector	0,3		

