

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2023

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Trésorerie et équivalents de trésorerie*	36,5	–	36,5
Autres éléments d'actif (de passif)	4,0	20,6	24,6
Actions	49,2	(26,1)	23,1
<i>Actions</i>	41,9	(22,4)	19,5
<i>Contrats à terme standardisés</i> [†]	7,0	(3,6)	3,4
<i>Options achetées</i> [‡]	0,3	–	0,3
<i>Options vendues</i> [‡]	–	(0,1)	(0,1)
Obligations	32,2	(18,4)	13,8
<i>Obligations</i>	25,9	(1,5)	24,4
<i>Contrats à terme standardisés</i> **	6,3	(16,9)	(10,6)
<i>Options achetées</i> [†]	–	–	–
Contrats à terme standardisés sur marchandises [§]	2,1	(0,6)	1,5
Fonds privés	0,4	–	0,4
Swaps [¶]	0,1	–	0,1
Options sur swaps achetées ^{¶¶}	–	–	–
Options sur swaps vendues ^{¶¶}	–	–	–

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Trésorerie et équivalents de trésorerie*	36,5	–	36,5
Autres éléments d'actif (de passif)	4,0	20,6	24,6
États-Unis	33,6	(16,2)	17,4
Chine	12,0	–	12,0
Canada	21,0	(10,3)	10,7
Allemagne	1,6	(0,1)	1,5
Royaume-Uni	1,8	(0,3)	1,5
Brésil	1,4	–	1,4
Australie	2,0	(0,8)	1,2
France	1,4	(0,3)	1,1
Pays-Bas	1,0	(0,2)	0,8
Espagne	0,7	–	0,7
Italie	0,7	(0,1)	0,6
Ghana	0,5	–	0,5
Israël	0,5	–	0,5
Argentine	0,4	–	0,4
Luxembourg	0,4	–	0,4
Singapour	0,3	(0,1)	0,2
Suisse	0,7	(0,5)	0,2
Autre	4,0	(16,2)	(12,2)

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Trésorerie et équivalents de trésorerie*	36,5	–	36,5
Autres éléments d'actif (de passif)	4,0	20,6	24,6
Obligations de sociétés	25,2	(1,5)	23,7
Énergie	20,7	(14,2)	6,5
Contrats à terme standardisés sur actions	7,0	(3,6)	3,4
Consommation discrétionnaire	4,1	(0,8)	3,3
Consommation de base	2,4	(0,5)	1,9
Services de communication	2,3	(0,4)	1,9
Services publics	2,3	(0,4)	1,9
Contrats à terme standardisés sur marchandises	2,1	(0,6)	1,5
Produits industriels	3,3	(1,8)	1,5
Technologie de l'information	2,3	(1,0)	1,3
Services financiers	2,7	(1,7)	1,0
Soins de santé	1,2	(0,6)	0,6
Fonds privés	0,4	–	0,4
Biens immobiliers	0,6	(0,3)	0,3
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,3	–	0,3
Swaps	0,1	–	0,1
Matériaux	0,5	(0,5)	–
Autre	6,5	(17,2)	(10,7)

* 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.

† Les valeurs théoriques représentent 11,1 % de la valeur liquidative des options achetées.

‡ Les valeurs théoriques représentent 16,4 % de la valeur liquidative des options achetées et –1,7 % de la valeur liquidative des options vendues.

¶ Les valeurs théoriques représentent 8,5 % de la valeur liquidative des swaps.

¶¶ Les valeurs théoriques représentent 8,7 % de la valeur liquidative des options sur swaps achetées et –0,4 % de la valeur liquidative des options sur swaps vendues.

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 31 décembre 2023

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR

	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur/Fonds sous-jacent	
Trésorerie et équivalents de trésorerie*	50,6
Fonds toutes actions Chine Mackenzie ChinaAMC, série R	6,2
SPDR S&P Oil & Gas Exploration & Production ETF	1,4
BP PLC	1,0
Shell PLC	1,0
Total SA	0,9
The Williams Companies Inc.	0,8
Plains GP Holdings LP	0,7
Neoenergia SA	0,7
Baker Hughes Co.	0,7
Pembina Pipeline Corp.	0,7
ARC Resources Ltd.	0,7
Advantage Energy Ltd.	0,7
Parex Resources Inc.	0,7
Petróleo Brasileiro SA	0,7
Tencent Holdings Ltd.	0,6
Tourmaline Oil Corp.	0,6
Targa Resources Corp.	0,6
Corporation Pétroles Parkland	0,6
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-01-2025	0,6
Whitecap Resources Inc.	0,6
Coinbase Global Inc. 3,63 % 01-10-2031	0,5
Sitio Royalties Corp.	0,5
Topaz Energy Corp.	0,5
Coterra Energy Inc.	0,5

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **73,1**

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 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR

	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Chevron Corp.	(0,8)
ONEOK Inc.	(0,7)
Matador Resources Co.	(0,6)
EOG Resources Inc.	(0,6)
Exxon Mobil Corp.	(0,6)
Valero Energy Corp.	(0,6)
Chord Energy Corp.	(0,6)
Occidental Petroleum Corp.	(0,5)
Equinor ASA	(0,5)
NOV Inc.	(0,5)
Enerplus Corp.	(0,5)
Southwestern Energy Co.	(0,5)
Athabasca Oil Corp.	(0,5)
Enbridge Inc.	(0,5)
Baytex Energy Corp.	(0,5)
NOW Inc.	(0,5)
Credit Acceptance Corp. 6,63 % 15-03-2026	(0,5)
TRI Pointe Group Inc. 5,70 % 15-06-2028	(0,5)
Suncor Énergie Inc.	(0,4)
SM Energy Co.	(0,4)
ConocoPhillips	(0,4)
CNX Resources Corp.	(0,4)
NuVista Energy Ltd.	(0,4)
Compagnie Pétrolière Impériale Ltée	(0,4)
Birchcliff Energy Ltd.	(0,4)

Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **(12,8)**

Valeur liquidative totale du Fonds **57,7 millions \$**

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 31 décembre 2023 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 31 décembre 2023

VALEURS THÉORIQUES	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE	VALEURS THEORIQUES	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
** Obligations – Contrats à terme standardisés (acheteur)	6,2	§§ Marchandises – Contrats à terme standardisés (acheteur)	2,1
Contrats à terme standardisés sur obligations américaines à 5 ans	2,5	Contrats à terme sur 100 onces d'or standardisés	1,5
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor du Commonwealth à 10 ans	1,5	Contrats à terme standardisés sur le blé	0,4
Contrats à terme standardisés sur euro-obligations	1,4	Contrats à terme standardisés sur l'aluminium LME	0,1
Contrats à terme standardisés à très long terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans	0,8	Contrats à terme standardisés sur le maïs	0,1
Obligations – Contrats à terme standardisés (vendeur)	(16,5)	Marchandises – Contrats à terme standardisés (vendeur)	(0,6)
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans	(11,9)	Contrats à terme standardisés sur le zinc LME	(0,3)
Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 10 ans	(4,1)	Contrats à terme standardisés sur le blé RVH de KC	(0,2)
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans de moindre valeur	(0,5)	Contrats à terme standardisés sur l'huile de soja	(0,1)
†† Actions – Contrats à terme standardisés (acheteur)	6,8		
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-Mini S&P 500	3,9		
Contrats à terme standardisés sur l'indice Mini Russell 2000	0,7		
Contrats à terme standardisés sur l'indice IBEX 35	0,5		
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Consumer Discretionary Select Sector	0,4		
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Energy Select Sector	0,4		
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE MIB	0,4		
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE Taiwan	0,1		
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-Mini S&P 500 Real Estate	0,1		
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE China A50	0,1		
Contrats à terme standardisés sur l'indice MSCI Singapore	0,1		
Contrats à terme standardisés sur l'indice WIG20	0,1		
Actions – Contrats à terme standardisés (vendeur)	(3,5)		
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-Mini NASDAQ 100	(0,8)		
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini S&P Materials Select Sector	(0,6)		
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Consumer Staples Select Sector	(0,3)		
Contrats à terme standardisés sur l'indice Swiss Market	(0,3)		
Contrats à terme standardisés sur l'indice SPI 200	(0,3)		
Contrats à terme standardisés sur l'indice OMXS30	(0,3)		
Contrats à terme standardisés FTSE/JSE Top 40	(0,3)		
Contrats à terme standardisés Bolsa Mexicana	(0,2)		
Contrats à terme standardisés sur l'indice Euro STOXX 50	(0,2)		
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Utilities Select Sector	(0,1)		
Contrats à terme standardisés sur l'indice SET50	(0,1)		

