

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

## Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2023

### Aperçu du portefeuille

#### RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE

	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Trésorerie et équivalents de trésorerie*	31,4	–	31,4
Autres éléments d'actif (de passif)	4,0	23,1	27,1
Actions	56,8	(34,5)	22,3
<i>Actions</i>	52,4	(32,4)	20,0
<i>Contrats à terme standardisés**</i>	4,1	(2,0)	2,1
<i>Options achetées†</i>	0,3	–	0,3
<i>Options vendues††</i>	–	(0,1)	(0,1)
Obligations	40,1	(22,5)	17,6
<i>Obligations</i>	30,0	(1,7)	28,3
<i>Contrats à terme standardisés††</i>	10,1	(20,8)	(10,7)
<i>Options achetées§</i>	–	–	–
<i>Options vendues§</i>	–	–	–
Contrats à terme standardisés sur marchandises§§	1,5	(0,3)	1,2
Fonds privés	0,3	–	0,3
Swaps¶	0,1	–	0,1
Fonds/billets négociés en bourse	0,3	(0,3)	–
Options sur swaps achetées¶¶	–	–	–

#### RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE

	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Trésorerie et équivalents de trésorerie*	31,4	–	31,4
Autres éléments d'actif (de passif)	4,0	23,1	27,1
Canada	30,5	(9,1)	21,4
États-Unis	41,7	(28,8)	12,9
Chine	12,2	(0,1)	12,1
Brésil	1,8	–	1,8
Australie	2,1	(0,4)	1,7
France	1,5	(0,2)	1,3
Autre	3,0	(2,0)	1,0
Italie	1,0	(0,1)	0,9
Pays-Bas	0,9	(0,1)	0,8
Bermudes	0,4	–	0,4
Royaume-Uni	1,9	(1,5)	0,4
Espagne	0,2	–	0,2
Afrique du Sud	0,2	–	0,2
Allemagne	0,2	–	0,2
Luxembourg	0,2	–	0,2
Suisse	0,7	(0,5)	0,2
Japon	0,6	(14,8)	(14,2)

#### RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE

	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Trésorerie et équivalents de trésorerie*	31,4	–	31,4
Autres éléments d'actif (de passif)	4,0	23,1	27,1
Obligations de sociétés	26,6	(1,7)	24,9
Énergie	22,6	(15,0)	7,6
Consommation discrétionnaire	6,1	(2,8)	3,3
Soins de santé	5,1	(1,8)	3,3
Obligations d'État étrangères	2,9	–	2,9
Services de communication	3,0	(0,7)	2,3
Technologie de l'information	4,7	(2,6)	2,1
Contrats à terme standardisés sur actions	4,1	(2,0)	2,1
Consommation de base	2,3	(0,9)	1,4
Contrats à terme standardisés sur marchandises	1,5	(0,3)	1,2
Services publics	1,6	(0,7)	0,9
Services financiers	3,1	(2,8)	0,3
Biens immobiliers	0,5	(0,2)	0,3
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,3	–	0,3
Matériaux	1,3	(1,3)	–
Fonds/billets négociés en bourse	0,3	(0,3)	–
Produits industriels	3,6	(3,7)	(0,1)
Autre	(0,6)	–	(0,6)
Obligations – Contrats à terme standardisés	10,1	(20,8)	(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 14,8 % de la valeur liquidative des options achetées et –1,8 % de la valeur liquidative des options vendues.

§ Les valeurs théoriques représentent 11,8 % de la valeur liquidative des options achetées et –10,7 % de la valeur liquidative des options vendues.

¶ Les valeurs théoriques représentent 13,3 % de la valeur liquidative des swaps.

¶¶ Les valeurs théoriques représentent 93,6 % de la valeur liquidative des options sur swaps achetées.

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

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 MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

## Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 30 juin 2023

### LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR

% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

#### Émetteur/Fonds sous-jacent

Trésorerie et équivalents de trésorerie	40,5
Fonds du marché monétaire canadien Mackenzie, série R	8,9
Fonds toutes actions Chine Mackenzie ChinaAMC, série R	6,2
Obligations du Trésor des États-Unis 1,88 % 28-02-2027	2,6
PDC Energy Inc.	1,1
SPDR S&P Oil & Gas Exploration & Production ETF	1,0
MEG Energy Corp.	0,9
BP PLC	0,9
Shell PLC	0,9
Total SA	0,9
Northern Oil and Gas Inc.	0,9
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 15-09-2023	0,9
Advantage Energy Ltd.	0,9
Corporation Pétroles Parkland	0,8
Chesapeake Energy Corp.	0,8
Plains GP Holdings LP	0,8
The Williams Companies Inc.	0,8
Parex Resources Inc.	0,7
Devon Energy Corp.	0,7
Neoenergia SA	0,7
ARC Resources Ltd.	0,7
Baker Hughes Co.	0,7
Tourmaline Oil Corp.	0,7
ShawCor Ltd.	0,7
Whitecap Resources Inc.	0,7

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale

75,4

Pour le prospectus et d'autres renseignements concernant le ou les fonds sous-jacents du portefeuille, veuillez consulter les adresses suivantes : [www.placementsmackenzie.com](http://www.placementsmackenzie.com) ou [www.sedarplus.com](http://www.sedarplus.com).

### LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR

% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

#### Émetteur

Birchcliff Energy Ltd.	(0,8)
Hess Corp.	(0,7)
Enerplus Corp.	(0,7)
Occidental Petroleum Corp.	(0,7)
Compagnie Pétrolière Impériale Ltée	(0,6)
Exxon Mobil Corp.	(0,6)
EOG Resources Inc.	(0,6)
The Children's Place Retail Stores Inc.	(0,6)
Matador Resources Co.	(0,6)
ONEOK Inc.	(0,5)
MongoDB Inc.	(0,5)
Chart Industries Inc.	(0,5)
Marathon Oil Corp.	(0,5)
America's Car-Mart Inc.	(0,5)
Equinor ASA	(0,5)
Intrepid Potash Inc.	(0,5)
Celsius Holdings Inc.	(0,5)
Wolfspeed Inc.	(0,5)
Baytex Energy Corp.	(0,5)
Boot Barn Holdings Inc.	(0,5)
Montrose Environmental Group Inc.	(0,5)
Pioneer Natural Resources Co.	(0,4)
Bill.com Holdings Inc.	(0,4)
Metropolitan Bank Holding Corp.	(0,4)
SiTime Corp.	(0,4)

Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale

(13,5)

Valeur liquidative totale du Fonds

61,4 millions \$

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 30 juin 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 30 juin 2023

<u>VALEURS THÉORIQUES</u>	<u>% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE</u>	<u>VALEURS THEORIQUES</u>	<u>% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE</u>
<b>** Actions – Positions acheteur sur contrats</b>		<b>§§ Marchandises – Contrats à terme standardisés (acheteur)</b>	<b>1,5</b>
à terme standardisés	4,0	Contrats à terme sur 100 onces d'or Contrats	
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-Mini S&P 500	2,4	à terme standardisés	1,3
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE MIB	0,7	Contrats à terme standardisés sur la farine de soja	0,2
Contrats à terme standardisés sur l'indice IBEX 35	0,2		
Contrats à terme standardisés sur l'indice Euro STOXX 50	0,2	<b>Marchandises – Contrats à terme standardisés (vendeur)</b>	<b>(0,3)</b>
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE 100	0,2	Contrats à terme standardisés sur le plomb LME	(0,1)
Contrats à terme standardisés FTSE/JSE Top 40	0,2	Contrats à terme standardisés sur le gaz naturel	(0,1)
Contrats à terme standardisés sur l'indice OMXS30	0,1	Contrats à terme standardisés sur le sucre n° 11	(0,1)
<b>Actions – Contrats à terme standardisés (vendeur)</b>	<b>(2,0)</b>		
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-Mini NASDAQ 100	(0,7)		
Contrats à terme standardisés sur l'indice S&P/TSX 60	(0,4)		
Contrats à terme standardisés Bolsa Mexicana	(0,3)		
Contrats à terme standardisés sur l'indice Swiss Market	(0,3)		
Contrats à terme standardisés libellés en yens sur l'indice Nikkei 225	(0,2)		
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE China A50	(0,1)		
<b>†† Obligations – Contrats à terme standardisés (acheteur)</b>	<b>10,1</b>		
Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 2 ans	7,0		
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor du Commonwealth à 10 ans	1,8		
Contrats à terme standardisés à très long terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans	0,8		
Contrats à terme standardisés sur obligations américaines à 5 ans	0,5		
<b>Obligations – Contrats à terme standardisés (vendeur)</b>	<b>(20,8)</b>		
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans	(13,3)		
Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 10 ans	(3,6)		
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor américain à 10 ans	(1,9)		
Contrats à terme standardisés sur obligations du Royaume-Uni	(1,3)		
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans de moindre valeur	(0,4)		
Contrats à terme standardisés sur euro-obligations	(0,3)		

