

FONDS GLOBAL MACRO 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
Autres éléments d'actif (de passif)	6,3	63,9	70,2
Trésorerie et équivalents de trésorerie*	20,1	–	20,1
Actions	19,9	(8,4)	11,5
Contrats à terme standardisés**	15,2	(8,4)	6,8
Actions	3,7	–	3,7
Options achetées†	1,0	–	1,0
Marchandises	5,8	(1,6)	4,2
Marchandises	4,9	–	4,9
Contrats à terme standardisés sur marchandises††	0,9	(1,6)	(0,7)
Swaps§§	0,1	–	0,1
Obligations	47,9	(54,0)	(6,1)
Obligations	22,6	–	22,6
Contrats à terme standardisés§	25,3	(54,0)	(28,7)

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Autres éléments d'actif (de passif)	6,3	63,9	70,2
Canada	47,0	(13,9)	33,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie*	20,1	–	20,1
États-Unis	18,8	(9,7)	9,1
Italie	2,4	–	2,4
Allemagne	0,8	–	0,8
Espagne	0,7	–	0,7
Afrique du Sud	0,6	–	0,6
Autre	2,3	(1,7)	0,6
Suède	0,4	–	0,4
France	0,2	–	0,2
Swaps	0,1	–	0,1
Chine	–	(0,3)	(0,3)
Australie	–	(0,8)	(0,8)
Suisse	–	(1,2)	(1,2)
Mexique	–	(1,3)	(1,3)
Royaume-Uni	0,4	(4,2)	(3,8)
Japon	–	(30,9)	(30,9)

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Autres éléments d'actif (de passif)	6,3	63,9	70,2
Obligations de sociétés	20,7	–	20,7
Trésorerie et équivalents de trésorerie*	20,1	–	20,1
Contrats à terme standardisés sur actions	15,2	(8,4)	6,8
Marchandises	4,9	–	4,9
Énergie	3,7	–	3,7
Obligations provinciales	1,5	–	1,5
Autre	1,1	–	1,1
Obligations fédérales	0,4	–	0,4
Contrats à terme standardisés sur marchandises	0,9	(1,6)	(0,7)
Obligations – Contrats à terme standardisés	25,3	(54,0)	(28,7)

* 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 52,1 % de la valeur liquidative des options achetées.

§§ Les valeurs théoriques représentent 10,2 % de la valeur liquidative des swaps.

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 GLOBAL MACRO MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 30 juin 2023

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR

Émetteur/Fonds sous-jacent	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Fonds du marché monétaire canadien Mackenzie, série R	70,2
Trésorerie et équivalents de trésorerie	13,4
Fonds de lingots d'or Mackenzie, série R	4,9
SPDR S&P Oil & Gas Exploration & Production ETF	3,7
Indice S&P 500 – option de vente souscrite @ 4 000,00 \$ éch. 21-06-2024	0,7
SPDR Bloomberg High Yield Bond ETF	0,4
Indice S&P 500 – option de vente souscrite @ 3 500,00 \$ éch. 15-03-2024	0,3
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-Mini S&P 500	0,3
Swap sur rendement total sur SMK éch. 20-10-2023	0,1
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE MIB	0,1
Contrats à terme standardisés sur euro-obligations	0,1
Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 2 ans	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice IBEX 35	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice Euro STOXX 50	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice DAX	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice CAC40	–
Contrats à terme standardisés sur le carburant diesel à très faible teneur en soufre au port de New York	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice OMXS30	–
Contrats à terme standardisés sur le soja	–
Contrats à terme standardisés sur le coton n° 2	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice SPI 200	–
Contrats à terme standardisés sur le gazole à faible teneur en soufre	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE 100	–
Contrats à terme standardisés sur l'aluminium LME	–
Contrats à terme standardisés sur le blé	–

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **94,2**

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR

Émetteur	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-Mini NASDAQ 100	(0,1)
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans	(0,1)
Contrats à terme standardisés libellés en yens sur l'indice Nikkei 225	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice S&P/TSX 60	–
Contrats à terme standardisés sur l'huile de soja	–
Contrats à terme standardisés sur l'argent	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice Swiss Market	–
Contrats à terme standardisés sur le pétrole brut Brent	–
Contrats à terme standardisés sur le plomb LME	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE China A50	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice Mini Russell 2000	–
Contrats à terme standardisés sur le zinc LME	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice Mini MSCI Marchés émergents	–
Contrats à terme standardisés sur le pétrole brut WTI	–
Contrats à terme standardisés sur le gaz naturel	–
Contrats à terme sur 100 onces d'or	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor du Commonwealth à 10 ans	–
Contrats à terme standardisés sur le sucre n° 11	–
Contrats à terme standardisés Bolsa Mexicana	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du Royaume-Uni	–
Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 10 ans	0,1
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor américain à 10 ans	0,1

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

Valeur liquidative totale du Fonds **543,7 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.com.

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 GLOBAL MACRO MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 30 juin 2023

VALEURS THÉORIQUES	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE	VALEURS THÉORIQUES	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
** Actions – Contrats à terme standardisés (acheteur)	14,8	†† Marchandises – Contrats à terme standardisés (acheteur)	0,9
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-Mini S&P 500	8,5	Contrats à terme standardisés sur la farine de soja	0,6
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE MIB	2,4	Contrats à terme standardisés sur le blé RVH de KC	0,1
Contrats à terme standardisés sur l'indice Euro STOXX 50	0,8	Contrats à terme standardisés sur le carburant diesel	
Contrats à terme standardisés sur l'indice DAX	0,8	à très faible teneur en soufre au port de New York	0,1
Contrats à terme standardisés sur l'indice IBEX 35	0,7	Contrats à terme standardisés sur l'aluminium LME	0,1
Contrats à terme standardisés FTSE/JSE Top 40	0,6	Contrats à terme standardisés sur le maïs	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE 100	0,4	Contrats à terme standardisés sur le soja	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice OMXS30	0,4	Contrats à terme standardisés sur le blé	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice CAC40	0,2	Contrats à terme standardisés sur le gazole à faible teneur	
Contrats à terme standardisés sur l'indice SPI 200	–	en soufre	–
		Contrats à terme standardisés sur le coton n° 2	–
Actions – Contrats à terme standardisés (vendeur)	(8,2)	Marchandises – Contrats à terme standardisés (vendeur)	(1,6)
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-Mini NASDAQ 100	(3,2)	Contrats à terme standardisés sur le plomb LME	(0,4)
Contrats à terme standardisés sur l'indice S&P/TSX 60	(1,4)	Contrats à terme standardisés sur l'argent	(0,3)
Contrats à terme standardisés Bolsa Mexicana	(1,3)	Contrats à terme sur 100 onces d'or Contrats à terme	
Contrats à terme standardisés sur l'indice Swiss Market	(1,2)	standardisés	(0,2)
Contrats à terme standardisés libellés en yens sur l'indice		Contrats à terme standardisés sur le sucre no 11	(0,2)
Nikkei 225	(0,8)	Contrats à terme standardisés sur l'huile de soja	(0,1)
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE China A50	(0,3)	Contrats à terme standardisés sur le gaz naturel	(0,1)
Contrats à terme standardisés sur l'indice Mini Russell 2000	–	Contrats à terme standardisés sur le pétrole brut Brent	(0,1)
Contrats à terme standardisés sur l'indice Mini MSCI Marchés		Contrats à terme standardisés sur le pétrole brut WTI	(0,1)
émergents	–	Contrats à terme standardisés sur le zinc LME	(0,1)
		§ Obligations – Contrats à terme standardisés (acheteur)	25,2
		Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes	
		à 2 ans	25,1
		Contrats à terme standardisés sur euro-obligations	0,1
		Obligations – Contrats à terme standardisés (vendeur)	(54,1)
		Contrats à terme standardisés sur obligations	
		du gouvernement du Japon à 10 ans	(30,1)
		Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes	
		à 10 ans	(12,5)
		Contrats à terme standardisés sur obligations du	
		Trésor américain à 10 ans	(6,5)
		Contrats à terme standardisés sur obligations du Royaume-Uni	(4,2)
		Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor du	
		Commonwealth à 10 ans	(0,8)

