

FONDS MONDIAL MACRO 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)	8,9	81,4	90,3
Actions	65,0	(45,8)	19,2
<i>Contrats à terme standardisés*</i>	61,3	(45,8)	15,5
<i>Actions</i>	2,4	–	2,4
<i>Options achetées**</i>	1,3	–	1,3
Trésorerie et équivalents de trésorerie [§]	4,1	–	4,1
Swaps ^{§§}	–	–	–
Contrats à terme standardisés sur marchandises [†]	5,7	(7,2)	(1,5)
Obligations	16,9	(29,0)	(12,1)
<i>Obligations</i>	1,0	–	1,0
<i>Contrats à terme standardisés[†]</i>	15,9	(29,0)	(13,1)

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Autres éléments d'actif (de passif)	8,9	81,4	90,3
France	8,9	(1,7)	7,2
Italie	6,2	–	6,2
Mexique	5,9	–	5,9
Contrats à terme standardisés	5,7	(0,1)	5,6
Taiïwan	4,3	–	4,3
Trésorerie et équivalents de trésorerie [§]	4,1	–	4,1
Japon	4,1	–	4,1
Pologne	3,5	–	3,5
Suisse	2,5	–	2,5
Espagne	2,1	–	2,1
Singapour	1,4	–	1,4
Royaume-Uni	5,0	(4,9)	0,1
Chine	–	(1,9)	(1,9)
États-Unis	32,7	(35,0)	(2,3)
Allemagne	1,2	(4,7)	(3,5)
Thaïlande	–	(4,1)	(4,1)
Autre	2,4	(7,4)	(5,0)
Australie	1,7	(8,4)	(6,7)
Canada	–	(13,8)	(13,8)

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Autres éléments d'actif (de passif)	8,9	81,4	90,3
Contrats à terme standardisés sur actions	61,3	(45,8)	15,5
Trésorerie et équivalents de trésorerie [§]	4,1	–	4,1
Énergie	2,4	–	2,4
Autre	1,3	–	1,3
Obligations de sociétés	0,6	–	0,6
Obligations fédérales	0,4	–	0,4
Contrats à terme standardisés sur marchandises	5,7	(7,2)	(1,5)
Obligations d'État étrangères	15,9	(29,0)	(13,1)

** Les valeurs théoriques représentent 54,9 % de la valeur liquidative des options achetées.

§ 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 10,0 % 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 MONDIAL MACRO MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 30 juin 2024

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR

Émetteur/Fonds sous-jacent	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Trésorerie et équivalents de trésorerie ^s	84,7
SPDR S&P Oil & Gas Exploration & Production ETF	2,4
Indice S&P 500 – option de vente souscrite @ 5 150,00 \$ éch. 20-06-2024	0,8
Indice S&P 500 – option de vente souscrite @ 4 800,00 \$ éch. 21-03-2024	0,5
SPDR Bloomberg High Yield Bond ETF	0,4
iShares TIPS Bond ETF	0,4
iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF	0,2
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE MIB	0,1
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Energy Select Sector	0,1
Contrats à terme standardisés sur l'indice WIG20	0,1
Contrats à terme standardisés libellés en yens sur l'indice Nikkei 225	0,1
Swap sur rendement total sur SMK éch. 24-09-2024	–
Contrats à terme standardisés FTSE/JSE Top 40	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-Mini S&P 500	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE Taiwan	–
Contrats à terme standardisés sur le sucre n° 11	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-Mini S&P 500 Real Estate	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du Royaume-Uni	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Consumer Discretionary Select Sector	–
Contrats à terme standardisés sur le gazole à faible teneur en soufre	–
Contrats à terme standardisés sur le plomb LME	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice DAX	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Communication Services Select Sector	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice MSCI Singapore	–
Contrats à terme standardisés sur le pétrole brut WTI	–
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	89,8

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR

Émetteur	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor américain à 10 ans	(0,1)
Contrats à terme standardisés sur l'indice SPI 200	(0,1)
Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 10 ans	(0,1)
Contrats à terme standardisés sur le zinc LME	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE 100	–
Contrats à terme standardisés sur l'argent	–
Contrats à terme standardisés sur le blé RVH de KC	–
Contrats à terme standardisés sur le blé	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice OMXS30	–
Contrats à terme standardisés sur le coton n° 2	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Industrials Select Sector	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice CAC40	–
Contrats à terme standardisés sur l'aluminium LME	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE China A50	–
Contrats à terme sur 100 onces d'or	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Health Care Select Sector	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Consumer Staples Select Sector	–
Contrats à terme standardisés sur le gaz naturel	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice SET50	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice S&P/TSX 60	–
Contrats à terme standardisés sur le cuivre LME	0,1
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Utilities Select Sector	0,1
Contrats à terme standardisés sur euro-obligations	0,1
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini S&P Materials Select Sector	0,1
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	0,1

Valeur liquidative totale du Fonds

661,1 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 MONDIAL MACRO MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 30 juin 2024

VALEURS THÉORIQUES	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE	VALEURS THÉORIQUES	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
* Actions – Contrats à terme standardisés (acheteur)	60,3	† Obligations – Contrats à terme standardisés (acheteur)	15,7
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-Mini S&P 500	11,3	Contrats à terme standardisés sur obligations euro-OAT	9,0
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE MIB	6,1	Contrats à terme standardisés sur obligations du Royaume-Uni	5,0
Contrats à terme standardisés Bolsa Mexicana	6,0	Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor du Commonwealth à 10 ans	1,7
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-Mini S&P 500 Real Estate	5,2	Obligations – Contrats à terme standardisés (vendeur)	(28,7)
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE Taiwan	4,3	Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor américain à 10 ans	(17,7)
Contrats à terme standardisés libellés en yens sur l'indice Nikkei 225	4,0	Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 10 ans	(6,3)
Contrats à terme standardisés sur l'indice WIG20	3,4	Contrats à terme standardisés sur euro-obligations	(4,7)
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Energy Select Sector	3,3	†† Marchandises – Contrats à terme standardisés (acheteur)	5,6
Contrats à terme standardisés sur l'indice Swiss Market	2,5	Contrats à terme standardisés sur le plomb LME	1,5
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Information Technology Select Sector	2,4	Contrats à terme standardisés sur la farine de soja	0,9
Contrats à terme standardisés sur l'indice Mini Russell 2000	2,4	Contrats à terme standardisés sur le maïs	0,8
Contrats à terme standardisés sur l'indice IBEX 35	2,1	Contrats à terme standardisés sur le sucre n° 11	0,7
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Consumer Discretionary Select Sector	1,5	Contrats à terme standardisés sur l'huile de soja	0,5
Contrats à terme standardisés sur l'indice MSCI Singapore	1,3	Contrats à terme standardisés sur le pétrole brut Brent	0,3
Contrats à terme standardisés FTSE/JSE Top 40	1,2	Contrats à terme standardisés sur le pétrole brut WTI	0,3
Contrats à terme standardisés sur l'indice DAX	1,2	Contrats à terme standardisés sur le soja	0,2
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-Mini NASDAQ 100	0,8	Contrats à terme standardisés sur le gazole à faible teneur en soufre	0,2
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Communication Services Select Sector	0,6	Contrats à terme standardisés sur le pétrole brut WTI	0,1
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Financials Select Sector	0,5	Contrats à terme standardisés sur le carburant diesel à très faible teneur en soufre au port de New York	0,1
Contrats à terme standardisés sur l'indice Euro STOXX 50	0,2	Marchandises – Contrats à terme standardisés (vendeur)	(7,1)
Actions – Contrats à terme standardisés (vendeur)	(45,6)	Contrats à terme standardisés sur le cuivre LME	(2,4)
Contrats à terme standardisés sur l'indice SPI 200	(8,4)	Contrats à terme standardisés sur le zinc LME	(1,1)
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini S&P Materials Select Sector	(8,4)	Contrats à terme sur 100 onces d'or Contrats à terme standardisés	(0,8)
Contrats à terme standardisés sur l'indice S&P/TSX 60	(7,5)	Contrats à terme standardisés sur le blé RVH de KC	(0,7)
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE 100	(4,7)	Contrats à terme standardisés sur l'aluminium LME	(0,6)
Contrats à terme standardisés sur l'indice SET50	(4,1)	Contrats à terme standardisés sur l'argent	(0,6)
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Health Care Select Sector	(3,9)	Contrats à terme standardisés sur le coton n° 2	(0,6)
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Utilities Select Sector	(3,3)	Contrats à terme standardisés sur le gaz naturel	(0,2)
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE China A50	(1,9)	Contrats à terme standardisés sur le blé	(0,1)
Contrats à terme standardisés sur l'indice CAC40	(1,7)		
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Consumer Staples Select Sector	(1,3)		
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Industrials Select Sector	(0,4)		
Contrats à terme standardisés sur l'indice OMXS30	–		

