

# Équipe des actions quantitatives mondiales Mackenzie

Les placements mondiaux alimentés par la science  
des données et l'intuition humaine

**Nous sommes un groupe tissé serré de gestionnaires de portefeuille, d'analystes et de scientifiques des données qui utilisent des modèles quantitatifs et l'intelligence artificielle pour repérer des occasions à l'échelle mondiale.**

La recherche fondamentale traditionnelle dans le domaine des placements consiste à examiner les états financiers de quelques sociétés à la fois et à investir dans celles qui présentent une occasion en fonction des facteurs de croissance, de valeur ou de qualité. Bien que la recherche fondamentale demeure essentielle, l'équipe des actions quantitatives mondiales Mackenzie procède d'une façon très moderne.

Nos renseignements – de dernière heure – sur un vaste univers de sociétés couvrent les facteurs de croissance, de valeur et de qualité, les paramètres de risque et les données non traditionnelles. Nous utilisons l'apprentissage machine qui permet de prévoir les revenus et le traitement du langage naturel en interprétant des rapports annuels à grande échelle. Ces systèmes détectent des signaux qui indiquent à nos analystes où chercher.



**Nous analysons environ 20 000 titres mondiaux à la fois. Pas juste une fois par jour, mais deux.**

Cette approche révèle de façon continue les occasions offertes sur les marchés américain, mondiaux et émergents. Il s'agit d'un modèle d'efficacité, car nous pouvons négocier en mode furtif et réduire les coûts de négociation de façon algorithmique. Par-dessus tout, cette stratégie de placement va au-delà des conventions afin d'élaborer des portefeuilles d'actions de base à alpha élevé, en tenant compte des risques, sans égard au style de placement.

## L'AVANTAGE MACKENZIE

### Optimiser les capacités humaines

Nous dotons des personnes compétentes de modèles quantitatifs et de systèmes d'intelligence artificielle.

### Établir plus de liens

Nous scrutons en détail les marchés mondiaux pour faire des liens que d'autres pourraient manquer.

### Transcender les cycles de marché

Nous visons l'alpha et gérons le risque à l'échelle des styles de croissance, de valeur et de qualité.

## Mandats

FNB américain à faible volatilité Mackenzie  
FNB canadien à faible volatilité Mackenzie  
FNB mondial à faible volatilité Mackenzie  
Fonds d'actions mondiales charia Mackenzie  
Fonds d'actions mondiales Mackenzie  
Fonds de reproduction de capital-investissement Mackenzie  
Fonds des marchés émergents Mackenzie  
Fonds mondial de capital-investissement Mackenzie Northleaf



## Optimiser les capacités humaines

Nous dotons des professionnels compétents de modèles quantitatifs et de systèmes d'intelligence artificielle

Située à Boston, carrefour de premier plan de l'investissement quantitatif, l'équipe des actions quantitatives mondiales Mackenzie partage le même bassin de talents issus des écoles de l'Ivy League que les meilleures sociétés technologiques. Les gestionnaires de portefeuille et les scientifiques des données travaillent ensemble à l'élaboration et à l'amélioration de nos modèles quantitatifs et de nos capacités en intelligence artificielle, en apprentissage machine et en traitement du langage naturel.

Le rôle de notre technologie est de rehausser le jugement humain. La répartition du portefeuille est influencée par nos perspectives, que ce soit en ajustant l'exposition géographique pour éviter les régions en conflit ou en privilégiant les titres axés sur la valeur lorsque des événements mondiaux créent des occasions découlant d'évaluations erronées. Chaque opération est surveillée par un gestionnaire de portefeuille qualifié.

## Établir plus de liens

Nous scrutons en détail les marchés mondiaux pour faire des liens que d'autres pourraient manquer.

Les facteurs pouvant empêcher les investisseurs de profiter des occasions de placement les plus intéressantes au monde sont nombreux. Par exemple, le manque de connaissance des marchés étrangers, les répercussions indésirables sur les marchés moins liquides, les coûts de transaction élevés ou l'incapacité de repérer les corrélations entre d'innombrables signaux d'alpha et le rendement du cours des actions individuelles.

L'équipe des actions quantitatives mondiales Mackenzie a toutes les compétences requises pour repérer et exploiter les anomalies de prix quotidiennes sur les marchés mondiaux et émergents. Que nous repérions une société de financement d'infrastructures sous-évaluée en Inde ou que nous utilisions des analyses prédictives pour anticiper un bénéfice inattendu à Santa Clara, nous avons perfectionné notre capacité à faire des liens et à capitaliser.

## Transcender les cycles de marché

Nous visons l'alpha et gérons le risque à l'échelle des styles de croissance, de valeur et de qualité.

Notre modèle quantitatif établit un équilibre entre les facteurs de valeur, de croissance et de qualité, ce qui permet à nos portefeuilles d'anticiper n'importe quel cycle de marché et d'y réagir. Cette approche, qui fait fi des styles, ouvre la voie à de possibles rendements substantiels, indépendamment de la conjoncture du marché, et permet à l'équipe des actions quantitatives mondiales Mackenzie de se démarquer clairement des autres gestionnaires de portefeuille des marchés mondiaux et émergents.

Nous gérons des fonds de base, qui produisent leur plein effet en tant que principal placement en actions au sein d'un portefeuille de titres mondiaux ou de marchés émergents. Nous suivons le marché de façon générale, et les rendements après déduction des frais viennent s'ajouter à cela. Avec un actif de près de 10 G\$ CA et une solide feuille de route, notre thèse est éprouvée.

## Pourquoi choisir Mackenzie

Notre mission consiste à créer ensemble un monde davantage investi, afin que tous les Canadiens et Canadiennes soient en meilleure position financièrement.

## Investir dans l'avenir, ensemble

Nous établissons des relations inébranlables avec des conseillers et conseillères afin d'aider les investisseurs et investisseuses à réaliser leur potentiel au moyen d'une large gamme de solutions de placement novatrices répondant à tous les besoins des investisseurs et investisseuses. Nous avons à cœur d'investir dans un avenir responsable et durable, tout en rendant les placements plus faciles à comprendre.

## Expertise et solutions de spécialistes

Mackenzie offre un choix parmi de multiples boutiques de placement – des équipes de spécialistes qui visent des stratégies et des occasions distinctes.

## Soutenus par la force

Membre de la Société financière IGM et du groupe de sociétés de la Corporation Financière Power, chefs de file de confiance en matière de conseils. Le total de l'actif géré et de l'actif sous services-conseils (AG/ASSC) de la Société financière IGM est de plus de 252,2 G\$ (CAD) au 31 mars 2024.



## L'équipe des actions quantitatives mondiales Mackenzie



### Arup Datta, M.B.A., CFA

Vice-président principal, Gestionnaire de portefeuille, Chef d'équipe

S'est joint à Mackenzie en 2017

Expérience en placement depuis 1992

M. Datta est un investisseur « quantitatif » professionnel depuis plus de 30 ans, ayant géré des portefeuilles dans pratiquement toutes les capitalisations et régions du monde. De 1992 à 2012, il a été analyste quantitatif, gestionnaire de portefeuille, directeur général des placements américains et directeur général de la gestion de portefeuille à Man Numeric. Il a ensuite fondé Agriya Investors, qui est devenue par la suite la division mondiale et internationale d'AJO.

M. Datta est titulaire d'un baccalauréat en technologie de l'Indian Institute of Technology et d'une maîtrise en administration des affaires avec distinction de la Johnson School of Management de l'Université Cornell.



### Nicholas Tham, M.A., CFA

Vice-président, gestionnaire de portefeuille

S'est joint à Mackenzie en 2017

Expérience en placement depuis 2009

M. Tham a commencé sa carrière à titre d'analyste quantitatif et de négociateur pour un fonds de couverture de Boston.

- Il a rejoint Arup Datta à titre de gestionnaire de portefeuille à Agriya Investors (et plus tard à AJO), gérant des stratégies d'actions à capacité limitée visant les marchés émergents et les marchés développés.
- Il détient une maîtrise en statistique de l'Université Harvard et des baccalauréats en mathématiques et en physique du Massachusetts Institute of Technology.



### Denis Suvorov, M.B.A., M.S., CFA

Vice-président, gestionnaire de portefeuille

S'est joint à Mackenzie en 2018

Expérience en placement depuis 2001

M. Suvorov a codirigé le lancement et la gestion de la stratégie d'actions neutre au marché à moyen terme à Teza Technologies.

- Il a géré des portefeuilles à Man Numeric avec Arup Datta, puis chez Goldman Sachs Asset Management.
- Il détient un baccalauréat en économie du Utah State University College of Business, et une maîtrise en administration des affaires avec distinction et une maîtrise en économie appliquée de l'Université de Rochester.



### Haijie Chen, Ph. D., CFA

Vice-président, gestionnaire de portefeuille

S'est joint à Mackenzie en 2018

Expérience en placement depuis 2011

M. Chen a commencé sa carrière en tant que chercheur en analyse quantitative auprès de State Street Associates.

- Il a géré des portefeuilles avec Arup Datta à titre de gestionnaire de portefeuille à AJO, société institutionnelle d'actions quantitatives établie à Philadelphie.
- Il détient un baccalauréat en génie automobile de l'Université Tsinghua et un doctorat en génie mécanique du Massachusetts Institute of Technology.



## Codes et frais de gestion du fonds

Nom du fonds	Série	Préfixe/symbole	FA	FR	FM2	FM3	Frais de gestion	RFG*
Fonds des marchés émergents Mackenzie	A	MFC	5501	5502**	7283**	5503**	2,00 %	2,53 %
	F	MFC	5505	-	-	-	0,80 %	1,06 %
	PW	MFC	5508	-	-	-	1,80 %	2,17 %
Fonds d'actions mondiales Mackenzie	A	MFC	734	834**	7041**	3184**	2,00 %	2,51 %
	F	MFC	099	-	-	-	0,80 %	1,05 %
	PW	MFC	6119	-	-	-	1,80 %	2,15 %
Fonds mondial de capital-investissement Mackenzie Northleaf	A	MFC	9456	-	-	-	2,65 %	-
	F	MFC	9457	-	-	-	1,65 %	-
	FA	MFC	9458	-	-	-	2,35 %	-
	FF	MFC	9459	-	-	-	1,35 %	-
Fonds de reproduction de capital-investissement Mackenzie	A	MFC	8196	-	-	-	2,10 %	2,68 %
	F	MFC	8197	-	-	-	1,00 %	1,30 %
	PW	MFC	8200	-	-	-	2,00 %	2,43 %
Fonds d'actions mondiales charia Mackenzie	A	MFC	7549	7550**	7552**	7551**	2,00 %	-
	F	MFC	7554	-	-	-	0,80 %	-
	PW	MFC	7557	-	-	-	1,80 %	-
FNB américain à faible volatilité Mackenzie	-	MULV	-	-	-	-	0,45 %	-
FNB canadien à faible volatilité Mackenzie	-	MCLV	-	-	-	-	0,45 %	-
FNB mondial à faible volatilité Mackenzie	-	MWLV	-	-	-	-	0,50 %	-

\* RFG au 30 septembre 2023.

\*\*Depuis le 1<sup>er</sup> juin 2022, le mode de souscription avec frais de rachat et le mode de souscription avec frais modérés ne sont plus offerts pour l'achat de titres, y compris les achats faits au moyen d'un programme systématique comme un programme de prélèvements préautorisés. Il demeurera possible d'échanger des titres d'un fonds Mackenzie acquis selon le mode de souscription avec frais de rachat ou avec frais modérés pour des titres d'un autre fonds Mackenzie selon le même mode de souscription, jusqu'à l'expiration du barème applicable des frais de rachat.



### Pour en savoir plus sur l'équipe des actions quantitatives mondiales Mackenzie, communiquer avec votre conseiller ou conseillère.

Les placements dans les fonds communs peuvent donner lieu à des commissions de vente et de suivi, ainsi qu'à des frais de gestion et autres. Veuillez lire le prospectus avant d'investir. Les fonds communs ne sont pas des placements garantis, leur valeur varie fréquemment et leur rendement antérieur peut ne pas se reproduire.

Le contenu du présent document (y compris les faits, les perspectives, les opinions, les recommandations, les descriptions de produits ou titres ou les références à des produits ou titres) ne doit pas être pris ni être interprété comme un conseil en matière de placement ni comme une offre de vente ou une sollicitation d'offre d'achat, ou une promotion, recommandation ou commandite de toute entité ou de tout titre cité. Bien que nous nous efforcions d'en assurer l'exactitude et l'exhaustivité, nous n'assumons aucune responsabilité quant à son utilisation.

3714235 05/24