

États financiers intermédiaires non audités

Pour la période de six mois close le 30 septembre 2023

Les présents états financiers intermédiaires non audités ne contiennent pas le rapport intermédiaire de la direction sur le rendement du Fonds (« RDRF ») du fonds d'investissement. Vous pouvez obtenir un exemplaire du RDRF intermédiaire gratuitement en communiquant avec nous d'une des façons indiquées à la rubrique Constitution du Fonds et renseignements sur les séries ou en visitant le site Web de SEDAR+ à l'adresse www.sedarplus.ca. Des exemplaires des états financiers annuels ou du RDRF annuel peuvent aussi être obtenus gratuitement des façons décrites ci-dessus.

Les porteurs de titres peuvent également communiquer avec nous de ces façons pour demander un exemplaire des politiques et procédures de vote par procuration, du dossier de divulgation des votes par procuration ou de la présentation d'informations trimestrielles sur le portefeuille du fonds d'investissement.

AVIS DE NON-AUDIT DES ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES

Corporation Financière Mackenzie, le gestionnaire du Fonds de revenu stratégique mondial en dollars US Mackenzie (le « Fonds »), nomme des auditeurs indépendants pour auditer les états financiers annuels du Fonds. Conformément aux lois sur les valeurs mobilières du Canada (Règlement 81-106), si un auditeur n'a pas revu les états financiers intermédiaires, cela doit être divulgué dans un avis complémentaire.

Les auditeurs indépendants du Fonds n'ont pas revu les présents états financiers intermédiaires conformément aux normes établies par l'Institut Canadien des Comptables Agréés.



FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

au (en milliers de \$ US, sauf les montants par titre)

	30 sept. 2023	31 mars 2023 (Audité)
	\$	\$
ACTIF		
Actifs courants		
Placements à la juste valeur	75 175	81 161
Trésorerie et équivalents de trésorerie	489	1 628
Intérêts courus à recevoir	275	223
Dividendes à recevoir	107	81
Sommes à recevoir pour placements vendus	878	60
Sommes à recevoir pour titres émis	142	69
Marge sur instruments dérivés	126	1 202
Actifs dérivés	399	205
Total de l'actif	77 591	84 629
PASSIF		
Passifs courants		
Sommes à payer pour placements achetés	514	195
Sommes à payer pour titres rachetés	104	28
Sommes à payer au gestionnaire	10	8
Obligation pour options vendues	–	10
Passifs dérivés	71	585
Total du passif	699	826
Actif net attribuable aux porteurs de titres	76 892	83 803

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

Pour les périodes closes les 30 septembre
(en milliers de \$ US, sauf les montants par titre)

	2023 \$	2022 \$
Revenus		
Dividendes	664	829
Revenus d'intérêts aux fins de distribution	954	1 045
Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets		
Profit (perte) net(te) réalisé(e)	234	28
Profit (perte) net(te) latent(e)	(2 787)	(16 272)
Revenu tiré du prêt de titres	4	3
Revenu provenant des rabais sur les frais	3	4
Total des revenus (pertes)	(928)	(14 363)
Charges (note 6)		
Frais de gestion	570	690
Rabais sur les frais de gestion	(1)	(1)
Frais d'administration	71	85
Intérêts débiteurs	1	1
Commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille	15	20
Frais du comité d'examen indépendant	–	–
Charges avant les montants absorbés par le gestionnaire	656	795
Charges absorbées par le gestionnaire	–	–
Charges nettes	656	795
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, avant impôt	(1 584)	(15 158)
Charge (économie) d'impôt étranger retenu à la source	61	84
Charge d'impôt étranger sur le résultat (recouvrée)	3	(7)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation	(1 648)	(15 235)

Actif net attribuable aux porteurs de titres (note 3)

	par titre		par série	
	30 sept. 2023	31 mars 2023 (Audité)	30 sept. 2023	31 mars 2023 (Audité)
Série A	8,47	8,90	8 794	9 926
Série D	8,69	9,08	465	306
Série F	9,20	9,60	29 208	31 315
Série F8	11,50	12,18	80	82
Série FB	9,38	9,81	17	49
Série PW	8,62	9,05	32 843	35 573
Série PWFB	9,18	9,58	2 049	2 607
Série PWT8	10,32	11,00	1 165	1 673
Série PWX	9,85	10,23	1 691	1 732
Série PWX8	12,99	13,70	1	1
Série T8	8,88	9,48	579	539
			76 892	83 803

Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation (note 3)

	par titre		par série	
	2023	2022	2023	2022
Série A	(0,20)	(1,47)	(217)	(1 805)
Série D	(0,33)	(1,44)	(13)	(23)
Série F	(0,17)	(1,44)	(557)	(5 366)
Série F8	(0,21)	(1,98)	(1)	(8)
Série FB	(0,10)	(1,57)	–	(6)
Série PW	(0,20)	(1,52)	(767)	(6 930)
Série PWFB	(0,12)	(1,52)	(30)	(442)
Série PWT8	(0,18)	(1,87)	(24)	(270)
Série PWX	(0,13)	(1,56)	(24)	(284)
Série PWX8	(0,18)	(2,15)	–	–
Série T8	(0,25)	(1,64)	(15)	(101)
			(1 648)	(15 235)

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE LA SITUATION FINANCIÈRE

Pour les périodes closes les 30 septembre
(en milliers de \$ US, sauf les montants par titre)

	Total		Série A		Série D		Série F		Série F8					
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022				
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES														
À l'ouverture	83 803	108 316	9 926	12 662	306	148	31 315	39 748	82	58				
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(1 648)	(15 235)	(217)	(1 805)	(13)	(23)	(557)	(5 366)	(1)	(8)				
Distributions aux porteurs de titres :														
Revenu de placement	(865)	(1 033)	(66)	(71)	(4)	(2)	(425)	(524)	(1)	(1)				
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–				
Remboursement de capital	(1 162)	(1 801)	(166)	(252)	(4)	(2)	(328)	(516)	(2)	(2)				
Rabais sur les frais de gestion	(1)	(1)	–	–	–	–	–	–	–	–				
Total des distributions aux porteurs de titres	(2 028)	(2 835)	(232)	(323)	(8)	(4)	(753)	(1 040)	(3)	(3)				
Opérations sur les titres :														
Produit de l'émission de titres	6 236	7 455	790	1 484	191	12	3 110	3 176	–	–				
Réinvestissement des distributions	1 507	2 191	201	280	8	4	455	721	2	2				
Paiements au rachat de titres	(10 978)	(16 611)	(1 674)	(2 468)	(19)	–	(4 362)	(8 009)	–	–				
Total des opérations sur les titres	(3 235)	(6 965)	(683)	(704)	180	16	(797)	(4 112)	2	2				
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	(6 911)	(25 035)	(1 132)	(2 832)	159	(11)	(2 107)	(10 518)	(2)	(9)				
À la clôture	76 892	83 281	8 794	9 830	465	137	29 208	29 230	80	49				
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) :														
Titres en circulation, à l'ouverture			Titres	1 115	1 265	Titres	34	15	Titres	3 260	3 730	Titres	7	4
Émis				89	162		21	1		322	324		–	–
Réinvestissement des distributions				23	31		1	–		48	75		–	–
Rachetés				(189)	(268)		(2)	–		(456)	(828)		–	–
Titres en circulation, à la clôture				1 038	1 190		54	16		3 174	3 301		7	4

	Série FB		Série PW		Série PWFB		Série PWT8		Série PWX					
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022				
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES														
À l'ouverture	49	51	35 573	48 086	2 607	3 016	1 673	1 849	1 732	2 003				
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	–	(6)	(767)	(6 930)	(30)	(442)	(24)	(270)	(24)	(284)				
Distributions aux porteurs de titres :														
Revenu de placement	(1)	(1)	(286)	(334)	(34)	(41)	(11)	(13)	(33)	(37)				
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–				
Remboursement de capital	–	(1)	(562)	(884)	(25)	(40)	(44)	(66)	(11)	(17)				
Rabais sur les frais de gestion	–	–	(1)	(1)	–	–	–	–	–	–				
Total des distributions aux porteurs de titres	(1)	(2)	(849)	(1 219)	(59)	(81)	(55)	(79)	(44)	(54)				
Opérations sur les titres :														
Produit de l'émission de titres	–	–	1 981	2 624	–	74	4	26	84	56				
Réinvestissement des distributions	1	1	712	1 015	59	81	29	32	35	43				
Paiements au rachat de titres	(32)	–	(3 807)	(6 041)	(528)	(16)	(462)	(37)	(92)	(23)				
Total des opérations sur les titres	(31)	1	(1 114)	(2 402)	(469)	139	(429)	21	27	76				
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	(32)	(7)	(2 730)	(10 551)	(558)	(384)	(508)	(328)	(41)	(262)				
À la clôture	17	44	32 843	37 535	2 049	2 632	1 165	1 521	1 691	1 741				
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) :														
Titres en circulation, à l'ouverture	5	5	Titres	3 931	4 740	Titres	272	284	Titres	152	145	Titres	169	178
Émis	–	–		222	279		–	8		–	2		9	5
Réinvestissement des distributions	–	–		79	111		6	8		3	3		3	4
Rachetés	(3)	–		(423)	(653)		(55)	(2)		(42)	(3)		(9)	(2)
Titres en circulation, à la clôture	2	5		3 809	4 477		223	298		113	147		172	185

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE LA SITUATION FINANCIÈRE (suite)

Pour les périodes closes les 30 septembre
(en milliers de \$ US, sauf les montants par titre)

	Série PWX8		Série T8	
	2023	2022	2023	2022
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES				
À l'ouverture	1	1	539	694
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	–	–	(15)	(101)
Distributions aux porteurs de titres :				
Revenu de placement	–	–	(4)	(9)
Gains en capital	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	(20)	(21)
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	–	–	(24)	(30)
Opérations sur les titres :				
Produit de l'émission de titres	–	–	76	3
Réinvestissement des distributions	–	–	5	12
Paievements au rachat de titres	–	–	(2)	(17)
Total des opérations sur les titres	–	–	79	(2)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	–	–	40	(133)
À la clôture	1	1	579	561
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) :	Titres		Titres	
Titres en circulation, à l'ouverture	–	–	57	63
Émis	–	–	7	–
Réinvestissement des distributions	–	–	1	1
Rachetés	–	–	–	(1)
Titres en circulation, à la clôture	–	–	65	63

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

Pour les périodes closes les 30 septembre (en milliers de \$ US)

	2023	2022
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation	(1 648)	(15 235)
Ajustements pour :		
Perte (profit) net(te) réalisé(e) sur les placements	(162)	1 837
Variation de la perte (du profit) net(te) latent(e) sur les placements	2 787	16 272
Achat de placements	(19 519)	(21 344)
Produit de la vente et de l'échéance de placements	21 664	22 643
(Augmentation) diminution des sommes à recevoir et autres actifs	998	12
Augmentation (diminution) des sommes à payer et autres passifs	2	(9)
Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités d'exploitation	4 122	4 176
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de titres	5 110	5 620
Paievements au rachat de titres	(9 849)	(14 539)
Distributions versées, déduction faite des réinvestissements	(521)	(644)
Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités de financement	(5 260)	(9 563)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie	(1 138)	(5 387)
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à l'ouverture	1 628	7 733
Incidence des fluctuations des taux de change sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie	(1)	(145)
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture	489	2 201
Trésorerie	489	2 201
Équivalents de trésorerie	–	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture	489	2 201
Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :		
Dividendes reçus	638	824
Impôts étrangers payés	64	77
Intérêts reçus	902	1 032
Intérêts versés	1	1

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS

au 30 septembre 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$ US)	Juste valeur (en milliers de \$ US)
OBLIGATIONS					
407 International Inc. 1,80 % 22-05-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	41 000 CAD	31	28
407 International Inc. 4,22 % 14-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	51 000 CAD	39	36
407 International Inc. 3,14 % 06-03-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
407 International Inc. 3,43 % 01-06-2033, série MTN	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	6
407 International Inc. 4,19 % 25-04-2042, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	13 000 CAD	12	8
407 International Inc. 3,60 % 21-05-2047, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	23	17
407 International Inc. 3,67 % 08-03-2049, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	68 000 CAD	44	39
407 International Inc. 4,86 % 31-07-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	41 000 CAD	31	28
AerCap Ireland Capital DAC 3,00 % 29-10-2028	Irlande	Sociétés – Non convertibles	20 000	17	17
Aéroports de Montréal 3,92 % 12-06-2045, rachetables 2044	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 000 CAD	2	2
AES Panama Generation Holdings SRL 4,38 % 31-05-2030, rachetables 2030	Panama	Sociétés – Non convertibles	198 209	198	169
AIMCo Realty Investors LP 2,20 % 04-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	39 000 CAD	31	26
AIMCo Realty Investors LP 2,71 % 01-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 000 CAD	3	3
Albertsons Cos. Inc. 4,63 % 15-01-2027, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	30 000	29	28
Algonquin Power & Utilities Corp. 4,60 % 29-01-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 000 CAD	4	3
Algonquin Power & Utilities Corp. 2,85 % 15-07-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	243 000 CAD	154	145
Algonquin Power & Utilities Corp., taux variable 18-01-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000 CAD	40	29
Alimentation Couche-Tard inc. 2,95 % 25-01-2030, rachetables 2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	17
Alimentation Couche-Tard inc. 5,59 % 25-09-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	89 000 CAD	66	65
AltaGas Ltd. 4,64 % 15-05-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	22 000 CAD	16	16
AltaGas Ltd. 2,17 % 16-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	17 000 CAD	14	11
AltaGas Ltd., taux variable 11-01-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	32 000 CAD	25	19
AltaGas Ltd., taux variable 17-08-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	8 000 CAD	6	6
AltaLink, L.P. 1,51 % 11-09-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	6
Amazon.com Inc. 4,70 % 01-12-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	69 000	69	66
América Móvil SAB de CV 9,50 % 27-01-2031	Mexique	Sociétés – Non convertibles	5 490 000 MXN	321	297
American Tower Corp. 1,88 % 15-10-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	15
Anglian Water Services Financing PLC 4,53 % 26-08-2032	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	35 000 CAD	27	23
Apple Inc. 3,35 % 10-01-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	90 000 AUD	66	58
Apple Inc. 2,65 % 11-05-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	216 000	163	133
ARC Resources Ltd. 2,35 % 10-03-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	21 000 CAD	17	14
Ardagh Packaging Finance PLC 5,25 % 15-08-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	12 000	10	10
Ascend Wellness Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 27-08-2025	États-Unis	Prêts à terme	18 000	18	15
Athene Global Funding, taux variable 09-04-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	63 000 CAD	50	46
Athene Global Funding 3,13 % 10-03-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	38 000 CAD	30	27
Athene Global Funding 2,10 % 24-09-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	23	20
Bank of America Corp., taux variable 15-09-2027 (taux variable différé)	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Bank of America Corp., taux variable 16-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	48 000 CAD	37	33
Bank of America Corp., taux variable 04-04-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	25 000 CAD	20	16
Banque de Montréal 2,70 % 11-09-2024, série DPNT	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Banque de Montréal 4,71 % 07-12-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 000 CAD	1	1
Banque de Montréal, taux variable 27-10-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 000 CAD	2	1
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000 CAD	91	86
La Banque de Nouvelle-Écosse 2,16 % 03-02-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	71 000 CAD	50	50
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 27-07-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	19 000 CAD	14	13
BCE Inc. 2,20 % 29-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	37 000 CAD	31	23
BCE Inc. 3,00 % 17-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	29 000 CAD	19	18
BCE Inc. 5,85 % 10-11-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	15 000 CAD	11	11
BCI QuadReal Realty 2,55 % 24-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000 CAD	39	34
bclMC Realty Corp. 1,06 % 12-03-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	16 000 CAD	13	12
bclMC Realty Corp. 1,07 % 04-02-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	23 000 CAD	18	15
Bell Canada 5,15 % 14-11-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	38 000 CAD	28	27
BP Capital Markets PLC 3,47 % 15-05-2025	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Broadcast Media Partners Holdings Inc. 4,50 % 01-05-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	7 000	7	6
Broadcom Inc. 4,11 % 15-09-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	13 000	12	12
Brookfield Infrastructure Finance ULC 4,20 % 11-09-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	27 000 CAD	20	18

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$ US)	Juste valeur (en milliers de \$ US)
OBLIGATIONS (suite)					
Brookfield Infrastructure Finance ULC 2,86 % 01-09-2032, rachetables 2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 000 CAD	4	3
Brookfield Renewable Energy Partners ULC 3,63 % 15-01-2027, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	172 000 CAD	133	118
Brookfield Renewable Partners ULC 4,25 % 15-01-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	27 000 CAD	21	19
Brookfield Residential Properties Inc. 5,13 % 15-06-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	9 000 CAD	7	5
Bruce Power L.P. 2,68 % 21-12-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	16	13
Bruce Power L.P. 4,00 % 21-06-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	26 000 CAD	20	17
CAE Inc. 5,54 % 12-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	32 000 CAD	24	23
Canadian Core Real Estate LP 3,30 % 02-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	44 000 CAD	35	29
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 21-04-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	51 000 CAD	41	34
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 28-07-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 000 CAD	1	1
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada 4,40 % 10-05-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	35 000 CAD	26	24
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 2,54 % 28-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	143 000 CAD	109	94
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 3,15 % 13-03-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	220 000 CAD	188	145
Capital Power Corp. 4,28 % 18-09-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	17	15
Capital Power Corp. 5,82 % 15-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	33 000 CAD	24	24
Capital Power Corp. 3,15 % 01-10-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	35 000 CAD	27	20
Capital Power Corp., taux variable 09-09-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	15	14
Cenovus Energy Inc. 3,50 % 07-02-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000 CAD	38	34
Cenovus Energy Inc. 3,75 % 15-02-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	151 000	119	100
Charter Communications Operating LLC 2,80 % 01-04-2031, rachetables 2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	16
Charter Communications Operating LLC 2,30 % 01-02-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	15
Charter Communications Operating LLC 3,50 % 01-06-2041	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	6
Chevron U.S.A. Inc. 2,34 % 12-08-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	301 000	220	171
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 2,46 % 30-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	29 000 CAD	23	19
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 5,40 % 01-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	79 000 CAD	59	55
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 5,70 % 28-02-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	54 000 CAD	40	38
The Clorox Co. 1,80 % 15-05-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	15 000	15	12
Cogeco Communications inc. 2,99 % 22-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	32 000 CAD	25	19
Cologix Data Centers Issuer LLC 4,94 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	13 000 CAD	10	9
Cologix Data Centers Issuer LLC 5,68 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	10 000 CAD	8	7
Columbia Care Inc. 6,00 % 29-06-2025, conv.	Canada	Sociétés – Convertibles	7 000	7	5
CommScope Technologies Finance LLC 8,25 % 01-03-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	13 000	13	9
Connect Finco SARL 6,75 % 01-10-2026	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	5 000	5	5
Continental Resources Inc. 5,75 % 15-01-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	192 000	181	181
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	22 314 CAD	17	15
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-09-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	14 995 CAD	11	10
Corus Entertainment Inc. 5,00 % 11-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	9 000 CAD	7	4
Country Garden Holdings Co. Ltd. 2,70 % 12-07-2026	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000	128	13
CPPIB Capital Inc. 1,95 % 30-09-2029	Canada	Gouvernement fédéral	61 000 CAD	47	39
CPPIB Capital Inc. 3,95 % 02-06-2032	Canada	Gouvernement fédéral	72 000 CAD	54	50
Fonds de placement immobilier Crombie 3,92 % 21-06-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 000 CAD	4	3
Fonds de placement immobilier Crombie 3,21 % 09-10-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	210 000 CAD	172	126
Fonds de placement immobilier Crombie 3,13 % 12-08-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	12 000 CAD	10	7
Curaleaf Holdings Inc. 8,00 % 15-12-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	40 000	40	33
DIRECTV Holdings LLC 5,88 % 15-08-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	6 000	6	5
Dollarama inc. 5,08 % 27-10-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	13 000 CAD	9	9
Dollarama inc. 5,53 % 26-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	42 000 CAD	31	31
Domtar Corp. 6,75 % 01-10-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	16 000	16	13
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 1,66 % 22-12-2025 (A)	Canada	Sociétés – Non convertibles	239 000 CAD	191	160
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,54 % 07-12-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	24	20
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,06 % 17-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	24 000 CAD	20	15
Ecopetrol SA 4,63 % 02-11-2031	Colombie	Sociétés – Non convertibles	91 000	69	70

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$ US)	Juste valeur (en milliers de \$ US)
OBLIGATIONS (suite)					
Electronic Arts Inc. 2,95 % 15-02-2051	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	151 000	112	92
L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie 3,63 % 17-04-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 000 CAD	2	1
Enbridge Inc. 4,90 % 26-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	26 000 CAD	19	19
Enbridge Inc. 3,10 % 21-09-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	67 000 CAD	52	39
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	180 000 CAD	145	120
Enbridge Inc., taux variable 12-04-2078, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	80 000 CAD	64	55
Énergir inc. 2,10 % 16-04-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	14	13
Énergir inc. 4,67 % 27-09-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	33 000 CAD	24	23
EPCOR Utilities Inc. 3,55 % 27-11-2047, rachetables 2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	24	17
EPCOR Utilities Inc. 3,11 % 08-07-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	23	15
EPCOR Utilities Inc. 4,73 % 02-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	45 000 CAD	35	30
Exxon Mobil Corp. 3,10 % 16-08-2049	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	301 000	242	199
Fairfax Financial Holdings Ltd. 8,30 % 15-04-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000	50	42
Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,23 % 14-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Fairfax Financial Holdings Ltd. 3,95 % 03-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	24	19
Fonds de placement immobilier First Capital 3,45 % 01-03-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	28 000 CAD	19	18
First West Credit Union 9,19 % 09-08-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	31 000 CAD	24	23
Flynn America LP, prêt à terme B de premier rang, taux variable 23-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	22 950	22	22
Compagnie Crédit Ford du Canada 2,96 % 16-09-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	16	13
Ford Motor Credit Co. LLC 6,78 % 15-09-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	76 000 CAD	58	56
Fortified Trust 1,96 % 23-10-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	90 000 CAD	73	59
Fortis Inc. 4,43 % 31-05-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	80 000 CAD	62	56
Frontera Generation Holdings LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 28-07-2026	États-Unis	Prêts à terme	940	1	–
Frontera Generation Holdings LLC, prêt à terme de second rang, taux variable 26-04-2028	États-Unis	Prêts à terme	912	1	–
FXI Holdings Inc. 7,88 % 01-11-2024 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 000	2	2
Financière General Motors du Canada Ltée 5,20 % 09-02-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	27 000 CAD	20	19
GFL Environmental Inc. 3,50 % 01-09-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 000	4	3
Gibson Energy Inc. 2,85 % 14-07-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	15	13
Gibson Energy Inc., taux variable 22-12-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	15 000 CAD	12	9
The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 30-11-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	89 000 CAD	70	59
The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 28-02-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	23 000 CAD	18	14
Gouvernement de l'Australie 1,75 % 21-06-2051	Australie	Gouvernements étrangers	900 000 AUD	358	308
Gouvernement des Bahamas 6,95 % 20-11-2029	Bahamas	Gouvernements étrangers	40 000	46	33
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2027	Brésil	Gouvernements étrangers	300 000 BRL	567	583
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2029	Brésil	Gouvernements étrangers	290 000 BRL	632	548
Gouvernement du Canada 0,75 % 01-02-2024	Canada	Gouvernement fédéral	4 000 CAD	3	3
Gouvernement du Canada 1,25 % 01-03-2027	Canada	Gouvernement fédéral	62 000 CAD	43	41
Gouvernement du Canada 0,50 % 01-12-2030	Canada	Gouvernement fédéral	163 000 CAD	100	93
Gouvernement du Canada 2,50 % 01-12-2032	Canada	Gouvernement fédéral	19 000 CAD	13	12
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-06-2033	Canada	Gouvernement fédéral	115 000 CAD	82	76
Gouvernement du Canada 2,00 % 01-12-2051	Canada	Gouvernement fédéral	500 000 CAD	295	252
Gouvernement du Canada 1,75 % 01-12-2053	Canada	Gouvernement fédéral	7 000 CAD	3	3
Gouvernement de l'Allemagne 0 % 15-08-2052	Allemagne	Gouvernements étrangers	1 210 000 EUR	1 038	550
Gouvernement du Japon 0 % 02-10-2023	Japon	Gouvernements étrangers	106 000 000 JPY	752	709
Gouvernement du Mexique 8,50 % 31-05-2029	Mexique	Gouvernements étrangers	7 300 000 MXN	419	393
Gouvernement du Mexique 2,66 % 24-05-2031	Mexique	Gouvernements étrangers	400 000	386	316
Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 4,50 % 15-05-2030	Nouvelle-Zélande	Gouvernements étrangers	500 000 NZD	306	279
Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 3,50 % 14-04-2033	Nouvelle-Zélande	Gouvernements étrangers	1 900 000 NZD	1 073	986
Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 4,25 % 15-05-2034	Nouvelle-Zélande	Gouvernements étrangers	780 000 NZD	476	426
Gouvernement de l'Afrique du Sud 8,88 % 28-02-2035	Afrique du Sud	Gouvernements étrangers	14 000 000 ZAR	626	584
GPS Blue Financing DAC 5,65 % 09-11-2041	Irlande	Sociétés – Non convertibles	300 000	312	289
Fiducie de placement immobilier Granite 3,06 % 04-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	14 000 CAD	10	9
Fiducie de placement immobilier Granite 2,19 % 30-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	240 000 CAD	162	148
Fiducie de placement immobilier Granite 2,38 % 18-12-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	63 000 CAD	39	36
Gray Escrow Inc. 7,00 % 15-05-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000	9	9
Gray Television Inc. 5,38 % 15-11-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	35 000	35	23
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 1,54 % 03-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	227 000 CAD	150	144
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 6,47 % 02-02-2034, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 000 CAD	4	4

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$ US)	Juste valeur (en milliers de \$ US)
OBLIGATIONS (suite)					
Fonds de placement immobilier H&R					
3,37 % 30-01-2024, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	17 000 CAD	14	12
HCA Healthcare Inc. 3,50 % 01-09-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	8 000	8	7
Heathrow Funding Ltd. 3,25 % 21-05-2025	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	13 000 CAD	11	9
Heathrow Funding Ltd. 2,69 % 13-10-2027	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	40 000 CAD	32	26
Heathrow Funding Ltd. 3,79 % 04-09-2030, rachetables 2030	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	40 000 CAD	31	26
Heathrow Funding Ltd. 3,73 % 13-04-2033	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	31 000 CAD	26	19
Compagnie Home Trust 5,32 % 13-06-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	46 000 CAD	36	33
Honda Canada Finance Inc. 4,87 % 23-09-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	69 000 CAD	51	49
Honda Canada Finance Inc. 5,73 % 28-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	29 000 CAD	22	21
Hydro One Inc. 1,69 % 16-01-2031, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	162 000 CAD	124	94
Hydro One Inc. 2,23 % 17-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	159 000 CAD	122	95
Hydro One Ltd. 1,41 % 15-10-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	15	13
iA Société financière inc., taux variable 20-06-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	25 000 CAD	19	18
iA Société financière inc., taux variable 25-02-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000 CAD	78	67
L'Ordre Indépendant des Forestiers, taux variable 15-10-2035, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	15	12
Indy US Bidco LLC, prêt à terme B3 de premier rang, taux variable 05-03-2028	États-Unis	Prêts à terme	9 653	10	9
Intact Corporation financière 5,46 % 22-09-2032 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	32 000	32	30
Intact Corporation financière, taux variable 31-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	8 000 CAD	6	5
Inter Pipeline Ltd. 2,73 % 18-04-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	49 000 CAD	38	36
Inter Pipeline Ltd. 3,48 % 16-12-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	15	14
Inter Pipeline Ltd. 4,23 % 01-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	114 000 CAD	90	79
Inter Pipeline Ltd. 5,76 % 17-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	27 000 CAD	20	20
Inter Pipeline Ltd. 5,71 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	31 000 CAD	23	22
Inter Pipeline Ltd. 3,98 % 25-11-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000 CAD	158	124
Inter Pipeline Ltd., taux variable 26-03-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	7	7
Inter Pipeline Ltd., taux variable 19-11-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	23	20
Interconexión Eléctrica SA ESP 3,83 % 26-11-2033	Colombie	Sociétés – Non convertibles	200 000	200	164
Banque internationale pour la reconstruction et le développement 6,25 % 12-01-2028	Suprationales	s.o.	3 000 000 000 IDR	196	194
Société Financière Internationale 0 % 22-02-2038	Suprationales	s.o.	28 000 000 MXN	444	382
Ivanhoe Cambridge II Inc. 2,30 % 12-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	19 000 CAD	14	13
JPMorgan Chase & Co. 1,90 % 05-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	63 000 CAD	50	41
Kaisa Group Holdings 8,65 % 27-10-2023	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000	73	12
Kaisa Group Holdings 10,50 % 27-10-2023	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000	138	12
Keyera Corp. 3,96 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	210 000 CAD	182	137
Keyera Corp., taux variable 13-06-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	15	14
Keyera Corp., taux variable 10-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	25 000 CAD	20	16
Knight Health Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 17-12-2028	États-Unis	Prêts à terme	33 405	31	9
Kommunalbanken AS 2,13 % 11-02-2025	Norvège	Gouvernements étrangers	200 000	196	191
KP Germany Erste GmbH, prêt à terme B de premier rang, taux variable 04-02-2026	Allemagne	Prêts à terme	10 000 EUR	12	10
Kronos Acquisition Holdings Inc. 5,00 % 31-12-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000	9	9
Produits Kruger S.E.C. 6,00 % 24-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Produits Kruger S.E.C. 5,38 % 09-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 000 CAD	4	3
LABL Escrow Issuer LLC 6,75 % 15-07-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	9 000	9	9
LABL Escrow Issuer LLC 10,50 % 15-07-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	12 000	12	11
LABL Inc. 8,25 % 01-11-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	9 000	8	7
Liberty Utilities (Canada) LP 3,32 % 14-02-2050, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	5
Les Compagnies Loblaw Itée 4,49 % 11-12-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Les Compagnies Loblaw Itée 2,28 % 07-05-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	24 000 CAD	17	15
Les Compagnies Loblaw Itée 5,34 % 13-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	23	21
Lower Mattagami Energy LP 2,43 % 14-05-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	29 000 CAD	24	18
LSF10 XL Bidco SCA, prêt à terme B de premier rang, taux variable 30-03-2028	Luxembourg	Prêts à terme	17 069 EUR	20	16
Magna International Inc. 4,95 % 31-01-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	37 000 CAD	27	26
Banque Manuvie du Canada 1,54 % 14-09-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	63 000 CAD	50	41
Société Financière Manuvie, taux variable 10-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	79 000 CAD	57	56
Société Financière Manuvie, taux variable 19-03-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	48 000 CAD	39	26
Société Financière Manuvie, taux variable 19-06-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	51 000 CAD	40	36

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$ US)	Juste valeur (en milliers de \$ US)
OBLIGATIONS (suite)					
Mattamy Group Corp. 4,63 % 01-03-2030, rachetables 2025 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 000	2	3
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 7,88 % 15-08-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	14 000	14	14
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 9,25 % 15-04-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	28 000	27	25
Metro inc. 4,66 % 07-02-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	7 000 CAD	5	5
Micron Technology Inc. 5,38 % 15-04-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	94 000	94	91
Microsoft Corp. 2,53 % 01-06-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	333 000	249	205
Minerva Merger Sub Inc. 6,50 % 15-02-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	30 000	30	25
Morgan Stanley 3,00 % 07-02-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	60 000 CAD	46	44
Mozart Debt Merger Sub Inc. 3,88 % 01-04-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	17
Mozart Debt Merger Sub Inc. 5,25 % 01-10-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	31 000	31	27
NAV CANADA 2,06 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	7	6
Nestlé Holdings Inc. 2,19 % 26-01-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	47 000 CAD	38	30
Nexstar Escrow Inc. 5,63 % 15-07-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	9 000	9	8
North West Redwater Partnership Co. Ltd. 2,80 % 01-06-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	69 000 CAD	56	42
North West Redwater Partnership Co. Ltd. 3,70 % 23-02-2043, rachetables 2042	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	6
North West Redwater Partnership 3,20 % 22-07-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	60 000 CAD	48	43
Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc. 4,11 % 31-03-2042	Canada	Sociétés – Non convertibles	29 912 CAD	23	18
NVIDIA Corp. 3,50 % 01-04-2050, rachetables 2049	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	151 000	131	110
Occidental Petroleum Corp. 6,13 % 01-01-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	182 000	180	180
OMERS Finance Trust 2,60 % 14-05-2029	Canada	Gouvernements provinciaux	35 000 CAD	26	23
Ontario Power Generation Inc. 2,89 % 08-04-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	15 000 CAD	11	11
Ontario Power Generation Inc. 1,17 % 22-04-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	7	7
Ontario Power Generation Inc. 2,98 % 13-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	26 000 CAD	21	17
Ontario Teachers' Finance Trust 1,10 % 19-10-2027	Canada	Gouvernements provinciaux	20 000 CAD	15	13
Régime de retraite des enseignantes et des enseignants de l'Ontario 4,45 % 02-06-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	44 000 CAD	33	31
Corporation Parkland du Canada 3,88 % 16-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	87 000 CAD	72	59
Corporation Parkland du Canada 4,38 % 26-03-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	66 000 CAD	52	42
Corporation Parkland du Canada 4,50 % 01-10-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	9
Corporation Pétroles Parkland 5,88 % 15-07-2027 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 000	2	2
Corporation Pétroles Parkland 6,00 % 23-06-2028, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	22	21
PayPal Holdings Inc. 2,65 % 01-10-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	18
PayPal Holdings Inc. 2,30 % 01-06-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	8
Pembina Pipeline Corp. 4,02 % 27-03-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	140 000 CAD	111	96
Pembina Pipeline Corp., taux variable 25-01-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	24	18
PepsiCo Inc. 3,00 % 15-10-2027, rachetables 2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	225 000	225	209
Petróleos de Venezuela SA 6,00 % 16-05-2024	Venezuela	Sociétés – Non convertibles	20 000	5	1
Petróleos Mexicanos 5,95 % 28-01-2031 144A	Mexique	Sociétés – Non convertibles	186 000	175	133
Petróleos Mexicanos 6,70 % 16-02-2032	Mexique	Sociétés – Non convertibles	181 000	182	134
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 4,65 % 19-05-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	154 000	154	148
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 4,75 % 19-05-2033	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	47 000	47	45
Pioneer Natural Resources Co. 2,15 % 15-01-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	151 000	127	119
Province de l'Alberta 4,15 % 01-06-2033	Canada	Gouvernements provinciaux	40 000 CAD	29	28
Province de l'Alberta 3,10 % 01-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	150 000 CAD	120	82
Province de l'Ontario 4,05 % 02-02-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	299 000 CAD	219	210
Province de l'Ontario 3,65 % 02-06-2033	Canada	Gouvernements provinciaux	342 000 CAD	237	230
Province de l'Ontario 4,15 % 02-12-2054	Canada	Gouvernements provinciaux	65 000 CAD	46	43
Province de Québec 3,65 % 20-05-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	391 000 CAD	292	266
Province de Québec 4,40 % 01-12-2055	Canada	Gouvernements provinciaux	1 000 CAD	1	1
PSP Capital Inc. 2,05 % 15-01-2030	Canada	Gouvernement fédéral	9 000 CAD	7	6
PSP Capital Inc. 2,60 % 01-03-2032	Canada	Gouvernement fédéral	50 000 CAD	39	31
Quasar Intermediate Holdings Ltd., prêt à terme B de premier rang, taux variable 20-01-2029	États-Unis	Prêts à terme	27 720	27	23
Reliance LP 2,68 % 01-12-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	15	13
Reliance LP 2,67 % 01-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	26 000 CAD	21	16
Fonds de placement immobilier RioCan 5,96 % 01-10-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	43 000 CAD	33	31
Rogers Communications Inc. 5,70 % 21-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	81 000 CAD	59	59
Rogers Communications Inc. 3,75 % 15-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000 CAD	93	79
Rogers Communications Inc. 2,90 % 09-12-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000 CAD	79	60
Rogers Communications Inc. 5,25 % 15-04-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	22 000 CAD	17	14

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$ US)	Juste valeur (en milliers de \$ US)
OBLIGATIONS (suite)					
Rogers Communications Inc., taux variable 15-03-2082 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	24 000	24	21
Banque Royale du Canada 4,61 % 26-07-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 000 CAD	3	3
Banque Royale du Canada, taux variable 03-11-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	12 000 CAD	8	8
Sagen MI Canada Inc. 3,26 % 05-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	23 000 CAD	18	13
Sagen MI Canada Inc., taux variable 24-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	17 000 CAD	14	10
Saputo inc. 2,88 % 19-11-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Secure Energy Services Inc. 7,25 % 30-12-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Sienna Senior Living Inc. 3,11 % 04-11-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Sienna Senior Living Inc. 3,45 % 27-02-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Sienna Senior Living Inc. 2,82 % 31-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	210 000 CAD	175	136
Silgan Holdings Inc. 4,13 % 01-02-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	5 000	5	4
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 4,75 % 05-08-2029	Chine	Sociétés – Non convertibles	602 000	118	24
Source Energy Services Canada LP 10,50 % 15-03-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	48 208 CAD	38	31
South Coast British Columbia Transportation Authority 1,60 % 03-07-2030	Canada	Administrations municipales	30 000 CAD	22	18
Specialty Pharma III Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 24-02-2028	États-Unis	Prêts à terme	19 600	19	19
Stitch Acquisition Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 27-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	20 580	19	16
Financière Sun Life inc., taux variable 21-11-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	115 000 CAD	92	73
Financière Sun Life inc., taux variable 10-08-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	31 000 CAD	24	21
Financière Sun Life inc., taux variable 04-07-2035	Canada	Sociétés – Non convertibles	19 000 CAD	14	14
Financière Sun Life inc., taux variable 01-10-2035	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	22	17
Sunac China Holdings Ltd. 5,95 % 26-04-2024	Chine	Sociétés – Non convertibles	218 000	59	29
Suncor Énergie Inc. 3,75 % 04-03-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	151 000	123	101
Suncor Énergie Inc. 3,95 % 04-03-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	16 000 CAD	12	9
Supérieur Plus S.E.C. 4,25 % 18-05-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Suzano SA 3,75 % 15-01-2031	Bésil	Sociétés – Non convertibles	20 000	21	17
TELUS Corp. 3,30 % 02-05-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	18 000 CAD	13	12
TELUS Corp. 3,15 % 19-02-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000 CAD	30	25
TELUS Corp. 2,05 % 07-10-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	8 000 CAD	6	5
TELUS Corp. 2,85 % 13-11-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	12	12
TELUS Corp. 4,95 % 28-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	24 000 CAD	17	16
Tenet Healthcare Corp. 4,38 % 15-01-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	5 000	5	4
Teranet Holdings LP 3,72 % 23-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000 CAD	79	65
Thomson Reuters Corp. 2,24 % 14-05-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	21	21
Timber Servicios Empresariales SA, prêt à terme B de premier rang, taux variable 29-03-2029	Espagne	Prêts à terme	17 000 EUR	19	17
T-Mobile USA Inc. 3,50 % 15-04-2025, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	19
T-Mobile USA Inc. 2,55 % 15-02-2031, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	8
T-Mobile USA Inc. 5,20 % 15-01-2033	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	47 000	47	44
Groupe TMX Ltée 2,30 % 11-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Groupe TMX Ltée 3,78 % 05-06-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	23	21
Groupe TMX Ltée 2,02 % 12-02-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	15 000 CAD	12	9
La Banque Toronto-Dominion 4,21 % 01-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	46 000 CAD	35	32
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 25-07-2029, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 000 CAD	4	4
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-10-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	78 000 CAD	59	56
Total Capital International SA 2,83 % 10-01-2030, rachetables 2029	France	Sociétés – Non convertibles	90 000	78	78
Tourmaline Oil Corp. 2,53 % 12-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	22 000 CAD	17	14
Crédit Toyota Canada Inc. 4,45 % 26-01-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	51 000 CAD	37	37
Toyota Motor Corp. 1,34 % 25-03-2026	Japon	Sociétés – Non convertibles	15 000	15	14
TransCanada PipeLines Ltd. 3,80 % 05-04-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	42 000 CAD	35	29
TransCanada PipeLines Ltd. 5,28 % 15-07-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	80 000 CAD	58	57
TransCanada PipeLines Ltd. 4,20 % 04-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	57 000 CAD	45	32
TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	252 000 CAD	205	162
Trulieve Cannabis Corp. 8,00 % 06-10-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	13 000	13	11
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-10-2026	États-Unis	Gouvernements étrangers	1 000 000	1 178	1 041
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,38 % 15-07-2027	États-Unis	Gouvernements étrangers	800 000	986	928
Obligations du Trésor des États-Unis 4,00 % 29-02-2028	États-Unis	Gouvernements étrangers	1 000 000	986	975
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,25 % 15-07-2029	États-Unis	Gouvernements étrangers	800 000	1 051	853

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$ US)	Juste valeur (en milliers de \$ US)
OBLIGATIONS (suite)					
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2031	États-Unis	Gouvernements étrangers	1 550 000	1 975	1 558
Obligations du Trésor des États-Unis 1,13 % 15-02-2031	États-Unis	Gouvernements étrangers	64 000	62	51
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2032	États-Unis	Gouvernements étrangers	1 500 000	1 722	1 387
Obligations du Trésor des États-Unis 2,75 % 15-08-2032	États-Unis	Gouvernements étrangers	46 000	42	40
Obligations du Trésor des États-Unis 3,50 % 15-02-2033	États-Unis	Gouvernements étrangers	1 842 400	1 827	1 691
Obligations du Trésor des États-Unis 3,88 % 15-08-2033	États-Unis	Gouvernements étrangers	800 000	786	756
Obligations du Trésor des États-Unis 2,38 % 15-02-2042	États-Unis	Gouvernements étrangers	98 000	86	68
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,25 % 15-02-2050	États-Unis	Gouvernements étrangers	400 000	533	281
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2051	États-Unis	Gouvernements étrangers	390 000	511	256
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052	États-Unis	Gouvernements étrangers	2 100 000	2 173	1 269
Obligations du Trésor des États-Unis 3,00 % 15-08-2052	États-Unis	Gouvernements étrangers	22 000	19	16
Upfield BV, prêt à terme B de premier rang, taux variable 31-01-2028	Pays-Bas	Prêts à terme	20 000 EUR	25	21
Administration de l'aéroport de Vancouver 1,76 % 20-09-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	8 000 CAD	5	5
Ventas Canada Finance Ltd. 5,40 % 21-04-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	53 000 CAD	40	38
Verizon Communications Inc., taux variable 20-03-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	9 000	9	9
Verizon Communications Inc. 2,38 % 22-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	49 000 CAD	38	31
Vidéotron ltée 5,75 % 15-01-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Vidéotron ltée 3,63 % 15-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	45 000 CAD	37	29
Vidéotron ltée 4,50 % 15-01-2030, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000 CAD	38	32
Visa Inc. 2,00 % 15-08-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	301 000	201	166
Weatherford International Ltd. 8,63 % 30-04-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	340 000	338	342
Wells Fargo & Co. 2,57 % 01-05-2026, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Wells Fargo & Co. 2,98 % 19-05-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	11 000 CAD	9	8
Groupe WSP Global Inc. 2,41 % 19-04-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	32 000 CAD	26	20
Zoetis Inc. 2,00 % 15-05-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	56 000	46	45
Total des obligations				36 872	30 678
ACTIONS					
AbbVie Inc.	États-Unis	Soins de santé	4 133	442	616
AIA Group Ltd.	Hong Kong	Services financiers	30 880	293	250
Air Liquide SA	France	Matériaux	2 566	274	432
Alphabet Inc., cat. A	États-Unis	Services de communication	8 766	1 066	1 147
Altria Group Inc.	États-Unis	Consommation de base	16 070	784	676
Amadeus IT Group SA	Espagne	Consommation discrétionnaire	8 242	541	497
Amazon.com Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	6 945	943	883
Analog Devices Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	2 335	422	409
Aon PLC	États-Unis	Services financiers	2 432	582	789
Apple Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	5 153	463	882
AstraZeneca PLC	Royaume-Uni	Soins de santé	6 097	820	821
Atlas Copco AB, A	Suède	Produits industriels	17 465	171	234
AutoZone Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	134	359	340
BCE Inc., priv., série AA	Canada	Services de communication	665	8	7
BCE Inc., priv., série AI	Canada	Services de communication	97	1	1
BCE Inc. 4,54 %, à div. cumulatif rachetable, priv. de premier rang, série R, rachetables	Canada	Services de communication	590	9	6
Becton, Dickinson and Co.	États-Unis	Soins de santé	2 650	590	685
Broadcom Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	1 060	398	880
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 46	Canada	Biens immobiliers	1 190	23	15
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 48	Canada	Biens immobiliers	441	9	6
Brookfield Renewable Partners L.P., priv., série 13	Canada	Services publics	288	6	4
Cenovus Energy Inc., priv., série 3	Canada	Énergie	250	4	4
Cenovus Energy Inc., priv., série 7	Canada	Énergie	1 700	28	24
Chevron Corp.	États-Unis	Énergie	5 820	638	981
CME Group Inc.	États-Unis	Services financiers	3 852	622	771

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$ US)	Juste valeur (en milliers de \$ US)
ACTIONS (suite)					
The Coca-Cola Co.	États-Unis	Consommation de base	12 112	637	678
Colgate-Palmolive Co.	États-Unis	Consommation de base	4 780	357	340
ConocoPhillips	États-Unis	Énergie	3 712	386	445
Corteva Inc.	États-Unis	Matériaux	6 098	208	312
CRH PLC	Irlande	Matériaux	5 998	323	328
Crown Castle International Corp.	États-Unis	Biens immobiliers	2 933	506	270
DBS Group Holdings Ltd.	Singapour	Services financiers	21 660	525	532
Deutsche Börse AG	Allemagne	Services financiers	5 170	656	894
Diageo PLC	Royaume-Uni	Consommation de base	6 867	266	253
Emera Inc., priv., série L	Canada	Services publics	885	18	11
Equifax Inc.	États-Unis	Produits industriels	1 221	170	224
Eurofins Scientific	Luxembourg	Soins de santé	3 052	169	172
Frontera Generation Holdings LLC	États-Unis	Énergie	67	–	–
Glencore PLC	Australie	Matériaux	136 673	594	782
Hannover Rueckversicherung SE, nom.	Allemagne	Services financiers	2 026	359	445
HDFC Bank Ltd.	Inde	Services financiers	14 667	236	268
Heineken Holding NV, A	Pays-Bas	Consommation de base	6 002	499	452
Honeywell International Inc.	États-Unis	Produits industriels	2 808	455	519
Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	Hong Kong	Services financiers	7 490	280	279
Hoya Corp.	Japon	Soins de santé	3 500	367	361
Intelsat Jackson Holdings SA, A, bons de souscription éch. 05-12-2025	Luxembourg	Services de communication	30	–	–
Intelsat Jackson Holdings SA, B, bons de souscription éch. 05-12-2025	Luxembourg	Services de communication	30	–	–
Intelsat Jackson Holdings SA	Luxembourg	Services de communication	289	10	7
ITOCHU Corp.	Japon	Produits industriels	9 400	372	340
Japan Exchange Group Inc.	Japon	Services financiers	22 960	400	426
Johnson & Johnson	États-Unis	Soins de santé	5 767	847	898
JPMorgan Chase & Co.	États-Unis	Services financiers	7 065	901	1 025
Kenvue Inc.	États-Unis	Consommation de base	11 938	305	240
Keyence Corp.	Japon	Technologie de l'information	640	210	238
Lam Research Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	725	422	454
Linde PLC (Bourse de New York)	Royaume-Uni	Matériaux	1 086	207	404
Les Compagnies Loblaw Itée 5,30 % à div. cumulatif rachetable, priv. de second rang, série B	Canada	Consommation de base	103	2	2
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	France	Consommation discrétionnaire	390	187	294
McDonald's Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	1 666	293	439
McKesson Corp.	États-Unis	Soins de santé	1 214	459	528
Meta Platforms Inc., cat. A	États-Unis	Services de communication	947	285	284
Microsoft Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	6 004	1 003	1 895
Moody's Corp.	États-Unis	Services financiers	589	106	186
Motorola Solutions Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	2 712	511	738
Nestlé SA, nom.	États-Unis	Consommation de base	5 294	488	598
Northrop Grumman Corp.	États-Unis	Produits industriels	905	438	398
Novo Nordisk AS, B	Danemark	Soins de santé	7 253	227	660
Oracle Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	2 736	320	290
PepsiCo Inc.	États-Unis	Consommation de base	2 351	340	398
¹ Pernod Ricard SA	France	Consommation de base	1 110	169	185
Philip Morris International Inc.	États-Unis	Consommation de base	8 279	748	766
Roche Holding AG Genussscheine	États-Unis	Soins de santé	2 266	712	618
S&P Global Inc.	États-Unis	Services financiers	1 558	567	569
Safran SA	France	Produits industriels	3 325	354	520
SAP AG	Allemagne	Technologie de l'information	8 094	954	1 051
Schlumberger Ltd.	États-Unis	Énergie	6 164	264	359
Shell PLC (actions en livres sterling)	Pays-Bas	Énergie	25 326	709	804
The Sherwin-Williams Co.	États-Unis	Matériaux	993	154	253
Siemens AG	Allemagne	Produits industriels	1 911	328	274
Sika AG	Suisse	Matériaux	835	152	212
Sony Corp.	Japon	Consommation discrétionnaire	6 419	450	525
Source Energy Services Ltd.	Canada	Énergie	2 501	5	10
Starbucks Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	2 566	176	234
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	Taiwan	Technologie de l'information	30 930	362	502
Texas Instruments Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	1 923	242	306

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$ US)	Juste valeur (en milliers de \$ US)
ACTIONS (suite)					
Thales SA	France	Produits industriels	1 761	263	247
Thermo Fisher Scientific Inc.	États-Unis	Soins de santé	715	392	362
TransAlta Corp., perpétuelles, priv., série C	Canada	Services publics	160	2	2
TransAlta Corp., priv., série A	Canada	Services publics	1 424	15	12
Union Pacific Corp.	États-Unis	Produits industriels	2 490	564	507
UnitedHealth Group Inc.	États-Unis	Soins de santé	1 164	603	587
Visa Inc., cat. A	États-Unis	Services financiers	2 882	454	663
The Williams Companies Inc.	États-Unis	Énergie	16 044	510	541
Wolters Kluwer NV	Pays-Bas	Produits industriels	2 959	246	358
Total des actions				34 235	40 134
OPTIONS					
Options achetées (se reporter au tableau des options achetées)				3	1
Total des options				3	1
FONDS/BILLETS NÉGOCIÉS EN BOURSE					
² FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	9 775	675	551
² FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	21 000	335	258
² FINB Obligations américaines totales Mackenzie (couvert en \$ CA)	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	3 000	192	174
² FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	3 009	233	182
² FINB TIPS américains Mackenzie (couvert en \$ CA)	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	6 000	382	369
Total des fonds/billets négociés en bourse				1 817	1 534
FONDS COMMUNS DE PLACEMENT					
³ Fonds international de dividendes Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	15 577	121	155
³ Fonds de revenu fixe sans contraintes Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	6 408	48	40
Total des fonds communs de placement				169	195
FONDS PRIVÉS					
⁴ Northleaf Private Credit II LP	Canada	Services financiers	37	307	296
⁵ Sagard Credit Partners II LP	Canada	Services financiers	37	129	132
Total des fonds privés				436	428
BILLETS À COURT TERME					
Gouvernement du Canada 4,44 % 07-12-2023	Canada	Gouvernement fédéral	6 000	4	4
Gouvernement du Canada 4,71 % 29-02-2024	Canada	Gouvernement fédéral	16 000	11	11
Obligations du Trésor des États-Unis 5,32 % 08-08-2024	États-Unis	Gouvernement fédéral	2 290 000	2 176	2 190
Total des billets à court terme				2 191	2 205
Coûts de transaction				(54)	–
Total des placements				75 669	75 175
Instruments dérivés					
(se reporter au tableau des instruments dérivés)					
Trésorerie et équivalents de trésorerie					328
Autres éléments d'actif moins le passif					489
Actif net attribuable aux porteurs de titres					900
					76 892

¹ L'émetteur de ce titre est lié à Mackenzie. Voir note 1.

² Ce fonds négocié en bourse est géré par Mackenzie.

³ Ce fonds est géré par Mackenzie.

⁴ Ce fonds est géré par Northleaf Capital Partners (Canada) Ltd., une société affiliée à Mackenzie.

⁵ Ce fonds est géré par Sagard Holdings Inc., une société affiliée à Mackenzie.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

APERÇU DU PORTEFEUILLE

30 SEPTEMBRE 2023

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Actions	52,1
Obligations	42,6
<i>Obligations</i>	39,9
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)</i>	2,5
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)</i>	0,2
Fonds/billets négociés en bourse	2,0
Autres éléments d'actif (de passif)	1,4
Placements à court terme	1,0
Fonds privés	0,6
Fonds communs de placement	0,3
Options sur swaps achetées	–

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	57,9
Canada	12,4
Autre	4,8
Allemagne	4,2
Japon	3,5
France	2,3
Nouvelle-Zélande	2,2
Pays-Bas	2,1
Royaume-Uni	2,1
Mexique	1,7
Brésil	1,5
Autres éléments d'actif (de passif)	1,4
Australie	1,4
Danemark	0,9
Irlande	0,8
Afrique du Sud	0,8

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations d'État étrangères	23,0
Obligations de sociétés	14,7
Technologie de l'information	9,9
Services financiers	9,3
Soins de santé	8,2
Consommation de base	6,0
Produits industriels	4,7
Consommation discrétionnaire	4,2
Énergie	4,1
Matériaux	3,5
Billets à escompte de gouvernements étrangers à court terme	2,9
Fonds/billets négociés en bourse	2,0
Services de communication	1,9
Autre	1,6
Autres éléments d'actif (de passif)	1,4
Obligations provinciales	1,2
Obligations fédérales	0,8
Fonds privés	0,6

31 MARS 2023

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Actions	52,4
Obligations	40,6
<i>Obligations</i>	41,1
<i>Options achetées</i>	–
<i>Options vendues</i>	–
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)</i>	(0,5)
Fonds/billets négociés en bourse	2,2
Trésorerie et placements à court terme	1,9
Autres éléments d'actif (de passif)	1,8
Fonds privés	0,6
Fonds communs de placement	0,5
Options sur devises achetées	–

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	56,4
Canada	14,8
Allemagne	4,7
Autre	3,9
Pays-Bas	2,7
Japon	2,4
France	2,4
Royaume-Uni	2,2
Mexique	2,1
Trésorerie et placements à court terme	1,9
Autres éléments d'actif (de passif)	1,8
Suisse	1,4
Hong Kong	0,9
Danemark	0,9
Espagne	0,8
Taiwan	0,7

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations d'État étrangères	22,1
Obligations de sociétés	13,5
Services financiers	9,5
Technologie de l'information	9,4
Soins de santé	8,8
Consommation de base	6,3
Produits industriels	4,4
Énergie	4,2
Consommation discrétionnaire	4,1
Matériaux	3,8
Autre	2,9
Obligations fédérales	2,9
Fonds/billets négociés en bourse	2,2
Trésorerie et placements à court terme	1,9
Autres éléments d'actif (de passif)	1,8
Obligations provinciales	1,6
Fonds privés	0,6

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

TABLEAU DES OPTIONS ACHETÉES

au 30 septembre 2023

Élément sous-jacent	Nombre de contrats	Type d'option	Date d'échéance	Prix d'exercice (\$)	Prime payée (en milliers de \$ US)	Juste valeur (en milliers de \$ US)
Indice Markit North American Investment Grade CDX	1 113 000	Vente	20 décembre 2023	100,00 USD	3	1
Total des options					3	1

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS

au 30 septembre 2023

Tableau des contrats à terme standardisés

Type de contrat	Nombre de contrats	Date d'échéance	Prix moyen des contrats (\$)	Montant notionnel* (en milliers de \$ US)	Profits latents (en milliers de \$ US)	Pertes latentes (en milliers de \$ US)
Contrats à terme standardisés sur obligations euro-OAT, décembre 2023	(8)	7 décembre 2023	127,40 EUR	(1 042)	36	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans, décembre 2023	(6)	13 décembre 2023	146,28 JPY	(5 821)	53	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor américain à 10 ans, décembre 2023	18	19 décembre 2023	109,98 USD	1 945	–	(35)
Contrats à terme standardisés à très long terme sur obligations du Trésor américain, décembre 2023	(9)	19 décembre 2023	127,42 USD	(1 068)	79	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du Royaume-Uni, décembre 2023	(5)	27 décembre 2023	94,87 GBP	(575)	3	–
Total des contrats à terme standardisés				(6 561)	171	(35)

* Le montant notionnel représente l'exposition aux instruments sous-jacents au 30 septembre 2023.

Tableau des contrats de change à terme de gré à gré (suite)

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$ US)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$ US)	Profits latents (en milliers de \$ US)	(Pertes) latentes (en milliers de \$ US)
A	29 USD	(45) AUD	3 octobre 2023	(29)	(29)	–	–
A	45 AUD	(29) USD	3 octobre 2023	29	29	–	–
A	51 CAD	(38) USD	3 octobre 2023	38	38	–	–
A	38 USD	(51) CAD	3 octobre 2023	(38)	(38)	–	–
A	77 USD	(68) CHF	3 octobre 2023	(77)	(74)	3	–
A	68 CHF	(74) USD	3 octobre 2023	74	74	–	–
A	33 USD	(30) EUR	3 octobre 2023	(33)	(32)	1	–
A	30 EUR	(32) USD	3 octobre 2023	32	32	–	–
A	230 GBP	(291) USD	3 octobre 2023	291	279	–	(12)
A	281 USD	(230) GBP	3 octobre 2023	(281)	(281)	–	–
A	394 USD	(57 100) JPY	3 octobre 2023	(394)	(382)	12	–
A	57 100 JPY	(383) USD	3 octobre 2023	383	383	–	–
A	167 USD	(1 770) NOK	3 octobre 2023	(167)	(166)	1	–
A	1 770 NOK	(166) USD	3 octobre 2023	166	165	–	(1)
A	212 NZD	(126) USD	3 octobre 2023	126	127	1	–
A	127 USD	(212) NZD	3 octobre 2023	(127)	(127)	–	–
A	320 SEK	(29) USD	3 octobre 2023	29	29	–	–
A	29 USD	(320) SEK	3 octobre 2023	(29)	(29)	–	–
AA	230 USD	(3 970) MXN	6 octobre 2023	(230)	(228)	2	–
AA	466 USD	(8 117) MXN	6 octobre 2023	(466)	(465)	1	–
A	99 USD	(1 719) MXN	6 octobre 2023	(99)	(99)	–	–
AA	3 520 MXN	(206) USD	6 octobre 2023	206	201	–	(5)
A	570 MXN	(33) USD	6 octobre 2023	33	33	–	–
AA	2 670 MXN	(156) USD	6 octobre 2023	156	153	–	(3)
A	610 MXN	(35) USD	6 octobre 2023	35	34	–	(1)
A	3 USD	(4) AUD	18 octobre 2023	(3)	(3)	–	–
A	10 AUD	(7) USD	18 octobre 2023	7	7	–	–
A	3 USD	(5) AUD	18 octobre 2023	(3)	(3)	–	–
A	10 AUD	(6) USD	18 octobre 2023	6	6	–	–
A	43 USD	(210) BRL	19 octobre 2023	(43)	(42)	1	–
A	21 USD	(18 000) CLP	19 octobre 2023	(21)	(20)	1	–
A	36 USD	(13 000) HUF	19 octobre 2023	(36)	(35)	1	–
A	420 PEN	(114) USD	19 octobre 2023	114	111	–	(3)

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2023

Tableau des contrats de change à terme de gré à gré (suite)

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$ US)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$ US)	Profits latents (en milliers de \$ US)	(Pertes) latentes (en milliers de \$ US)
A	54 USD	(220) PLN	19 octobre 2023	(54)	(51)	3	–
A	2 000 THB	(58) USD	19 octobre 2023	58	54	–	(4)
A	43 USD	(810) ZAR	19 octobre 2023	(43)	(42)	1	–
AA	29 USD	(27) EUR	20 octobre 2023	(29)	(28)	1	–
AA	10 EUR	(11) USD	20 octobre 2023	11	11	–	–
AA	17 EUR	(18) USD	20 octobre 2023	18	18	–	–
A	200 USD	(2 000) NOK	20 octobre 2023	(200)	(187)	13	–
A	2 000 NOK	(185) USD	20 octobre 2023	185	187	2	–
A	11 279 USD	(15 130) CAD	27 octobre 2023	(11 279)	(11 143)	136	–
A	1 220 CAD	(903) USD	27 octobre 2023	903	899	–	(4)
A	400 CAD	(296) USD	27 octobre 2023	296	295	–	(1)
A	672 USD	(610) EUR	27 octobre 2023	(672)	(646)	26	–
A	26 EUR	(28) USD	27 octobre 2023	28	28	–	–
A	208 AUD	(134) USD	3 novembre 2023	134	134	–	–
A	19 USD	(26) CAD	3 novembre 2023	(19)	(19)	–	–
A	526 USD	(480) CHF	3 novembre 2023	(526)	(526)	–	–
A	6 EUR	(6) USD	3 novembre 2023	6	6	–	–
A	277 GBP	(338) USD	3 novembre 2023	338	338	–	–
A	1 910 NOK	(180) USD	3 novembre 2023	180	179	–	(1)
A	470 NZD	(282) USD	3 novembre 2023	282	281	–	(1)
A	239 USD	(2 590) SEK	3 novembre 2023	(239)	(238)	1	–
A	259 USD	(38 500) JPY	6 novembre 2023	(259)	(259)	–	–
A	401 USD	(615) AUD	8 novembre 2023	(401)	(395)	6	–
A	15 AUD	(10) USD	8 novembre 2023	10	10	–	–
A	15 AUD	(10) USD	8 novembre 2023	10	10	–	–
A	755 USD	(1 250) NZD	8 novembre 2023	(755)	(749)	6	–
AA	1 058 USD	(1 750) NZD	8 novembre 2023	(1 058)	(1 049)	9	–
A	50 NZD	(30) USD	8 novembre 2023	30	30	–	–
A	40 NZD	(24) USD	8 novembre 2023	24	24	–	–
A	40 NZD	(24) USD	8 novembre 2023	24	24	–	–
A	9 EUR	(10) USD	26 janvier 2024	10	10	–	–
Total des contrats de change à terme de gré à gré						228	(36)
Total des actifs dérivés							399
Total des passifs dérivés							(71)

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

NOTES ANNEXES

1. Périodes comptables et renseignements généraux

L'information fournie dans les présents états financiers et dans les notes annexes se rapporte aux 30 septembre 2023 et 2022 ou aux semestres clos à ces dates, à l'exception des données comparatives présentées dans les états de la situation financière et les notes annexes, qui se rapportent au 31 mars 2023, selon le cas. Pour l'exercice au cours duquel un fonds ou une série est établi(e) ou rétabli(e), l'information fournie se rapporte à la période commençant à la date d'établissement ou de rétablissement. Lorsqu'une série d'un fonds a été dissoute au cours de l'une ou l'autre des périodes, l'information concernant la série est fournie jusqu'à la fermeture des bureaux à la date de dissolution. Se reporter à la note 10 pour la date de constitution du Fonds et la date d'établissement de chacune des séries.

Le Fonds a été constitué en fiducie de fonds commun de placement à capital variable en vertu des lois de la province de l'Ontario aux termes d'une déclaration de fiducie qui a été modifiée et mise à jour de temps à autre. Le siège social du Fonds est situé au 180, rue Queen Ouest, Toronto (Ontario) Canada. Le Fonds est autorisé à émettre un nombre illimité de parts (désignées en tant que « titre » ou « titres ») de séries multiples. Les séries du Fonds sont offertes à la vente aux termes d'un prospectus simplifié ou aux termes d'options de placement avec dispense de prospectus.

Corporation Financière Mackenzie (« Mackenzie ») est le gestionnaire du Fonds et appartient à cent pour cent à Société financière IGM Inc., filiale de Power Corporation du Canada. Gestion de placements Canada Vie limitée (« GPCV ») appartient à cent pour cent à La Compagnie d'Assurance du Canada sur la Vie (« Canada Vie »), filiale de Power Corporation du Canada. Les placements du Fonds dans des sociétés du groupe de sociétés Power sont identifiés dans le tableau des placements.

2. Base d'établissement et mode de présentation

Les présents états financiers intermédiaires non audités (les « états financiers ») ont été établis conformément aux Normes internationales d'information financière (« IFRS »), y compris la Norme comptable internationale 34 (« IAS »), *Information financière intermédiaire*, telles qu'elles ont été publiées par l'International Accounting Standards Board (l'« IASB »). Ces états financiers ont été établis selon les mêmes méthodes comptables, les mêmes jugements comptables critiques et les mêmes estimations que ceux qui ont été utilisés pour établir les états financiers annuels audités les plus récents du Fonds, soit ceux de l'exercice clos le 31 mars 2023. La note 3 présente un résumé des principales méthodes comptables du Fonds en vertu des IFRS.

Sauf indication contraire, tous les montants présentés dans ces états financiers sont en dollars américains, soit la monnaie fonctionnelle et la monnaie de présentation du Fonds, et sont arrondis au millier près. Les états financiers ont été établis sur la base de la continuité d'exploitation au moyen de la méthode du coût historique, sauf dans le cas des instruments financiers qui ont été évalués à la juste valeur.

Les présents états financiers ont été approuvés aux fins de publication par le conseil d'administration de Corporation Financière Mackenzie le 13 novembre 2023.

3. Principales méthodes comptables

a) Instruments financiers

Les instruments financiers comprennent des actifs financiers et des passifs financiers tels que des titres de créance, des titres de capitaux propres, des fonds de placement à capital variable et des dérivés. Le Fonds classe et évalue ses instruments financiers conformément à l'IFRS 9, *Instruments financiers* (« IFRS 9 »). Au moment de la comptabilisation initiale, les instruments financiers sont classés comme étant à la juste valeur par le biais du résultat net (la « JVRN »). Tous les instruments financiers sont comptabilisés dans l'état de la situation financière lorsque le Fonds devient partie aux exigences contractuelles de l'instrument. Les actifs financiers sont décomptabilisés lorsque le droit de percevoir les flux de trésorerie liés aux instruments est échu ou que le Fonds a transféré la quasi-totalité des risques et avantages inhérents à la propriété de ceux-ci. Les passifs financiers sont décomptabilisés lorsque l'obligation est acquittée, est annulée ou expire. Les opérations d'achat et de vente de placements sont comptabilisées à la date de l'opération.

Les instruments financiers sont par la suite évalués à la juste valeur par le biais du résultat net, et les variations de la juste valeur sont comptabilisées à l'état du résultat global au poste Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets – Profit (perte) net(te) latent(e).

Le coût des placements est calculé en fonction d'un coût moyen pondéré.

Les profits et les pertes réalisé(e)s et latent(e)s sur les placements sont calculé(e)s en fonction du coût moyen pondéré des placements, mais excluent les commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille, qui sont présentés de manière distincte dans l'état du résultat global au poste Commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille.

Les profits et les pertes découlant de la variation de la juste valeur des placements sont pris en compte dans l'état du résultat global de la période au cours de laquelle ils surviennent.

Le Fonds comptabilise ses placements dans des fonds de placement à capital variable non cotés, des fonds privés (« Fonds sous-jacents ») et des fonds négociés en bourse (« FNB »), le cas échéant, à la juste valeur par le biais du résultat net. Pour les fonds privés, le gestionnaire aura recours aux évaluations fournies par les gestionnaires des fonds privés, ce qui représente la quote-part du Fonds de l'actif net de ces fonds privés. Les placements du Fonds dans des Fonds sous-jacents et des FNB, le cas échéant, sont présentés dans le tableau des placements à la juste valeur, ce qui représente l'exposition maximale du Fonds en lien avec ces placements.

Les titres rachetables du Fonds confèrent aux porteurs le droit de faire racheter leur participation dans le Fonds contre un montant de trésorerie égal à leur part proportionnelle de la valeur liquidative du Fonds, entre autres droits contractuels. Les titres rachetables du Fonds satisfont aux critères de classement à titre de passifs financiers conformément à l'IAS 32, *Instruments financiers : Présentation*. L'obligation du Fonds à l'égard de l'actif net attribuable aux porteurs de titres est présentée au prix de rachat.

L'IAS 7, *Tableau des flux de trésorerie*, exige la présentation d'information relative aux changements dans les passifs et les actifs, comme les titres du Fonds, découlant d'activités de financement. Les changements relatifs aux titres du Fonds, y compris les changements découlant des flux de trésorerie et les changements sans effet de trésorerie, sont inclus à l'état de l'évolution de la situation financière. Tout changement relatif aux titres non réglé en espèces à la fin de la période est présenté à titre de Sommes à recevoir pour titres émis ou de Sommes à payer pour titres rachetés à l'état de la situation financière. Ces sommes à recevoir et à payer sont normalement réglées peu après la fin de la période.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

NOTES ANNEXES

3. Principales méthodes comptables (suite)

b) Évaluation de la juste valeur (suite)

La juste valeur est définie comme le prix qui serait obtenu à la vente d'un actif ou qui serait payé au transfert d'un passif lors d'une transaction normale entre des intervenants du marché à la date d'évaluation.

Les placements dans des titres cotés à une Bourse des valeurs mobilières ou négociés sur un marché hors cote sont évalués selon le dernier cours de marché ou le cours de clôture enregistré par la Bourse sur laquelle le titre se négocie principalement, le cours se situant à l'intérieur d'un écart acheteur-vendeur pour le placement. Dans certaines circonstances, lorsque le cours ne se situe pas à l'intérieur de l'écart acheteur-vendeur, Mackenzie détermine le point le plus représentatif de la juste valeur dans cet écart en fonction de faits et de circonstances spécifiques. Les titres de fonds communs d'un fonds sous-jacent sont évalués un jour ouvrable au cours calculé par le gestionnaire de ce fonds sous-jacent, conformément à ses actes constitutifs. Les titres non cotés ou non négociés à une Bourse et les titres dont le cours de la dernière vente ou de clôture n'est pas disponible ou les titres pour lesquels les cours boursiers, de l'avis de Mackenzie, sont inexacts ou incertains, ou ne reflètent pas tous les renseignements importants disponibles, sont évalués à leur juste valeur, laquelle sera déterminée par Mackenzie à l'aide de techniques d'évaluation appropriées et acceptées par le secteur, y compris des modèles d'évaluation. La juste valeur d'un titre déterminée à l'aide de modèles d'évaluation exige l'utilisation de facteurs et d'hypothèses fondés sur les données observables sur le marché, notamment la volatilité et les autres taux ou prix applicables. Dans des cas limités, la juste valeur d'un titre peut être déterminée grâce à des techniques d'évaluation qui ne sont pas appuyées par des données observables sur le marché.

La trésorerie et les équivalents de trésorerie, qui incluent les dépôts de trésorerie auprès d'institutions financières et les placements à court terme qui sont facilement convertibles en trésorerie, sont soumis à un risque négligeable de changement de valeur et sont utilisés par le Fonds dans la gestion de ses engagements à court terme. La trésorerie et les équivalents de trésorerie sont présentés à leur juste valeur, qui se rapproche de leur coût amorti en raison de leur nature très liquide et de leur échéance à court terme. Les découverts bancaires sont présentés dans les passifs courants à titre de dette bancaire dans l'état de la situation financière.

Le Fonds peut avoir recours à des instruments dérivés (comme les options souscrites, les contrats à terme standardisés ou de gré à gré, les swaps ou les instruments dérivés sur mesure) en guise de couverture contre les pertes occasionnées par des fluctuations des cours des titres, des taux d'intérêt ou des taux de change. Le Fonds peut également avoir recours à des instruments dérivés à des fins autres que de couverture afin d'effectuer indirectement des placements dans des titres ou des marchés financiers, de s'exposer à d'autres devises, de chercher à générer des revenus supplémentaires ou à toute autre fin considérée comme appropriée par le ou les portefeuillistes du Fonds, pourvu que cela soit compatible avec les objectifs de placement du Fonds. Les instruments dérivés doivent être utilisés conformément à la législation canadienne sur les organismes de placement collectif, sous réserve des dispenses accordées au Fonds par les organismes de réglementation, le cas échéant.

L'évaluation des instruments dérivés est effectuée quotidiennement, au moyen des sources usuelles d'information provenant des Bourses pour les instruments dérivés cotés en Bourse et des demandes précises auprès des courtiers relativement aux instruments dérivés hors cote.

La valeur des contrats à terme de gré à gré représente le profit ou la perte qui serait réalisé(e) si, à la date d'évaluation, les positions détenues étaient dénouées. La variation de la valeur des contrats à terme de gré à gré est incluse dans l'état du résultat global au poste Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets – Profit (perte) net(te) latent(e).

La valeur des contrats à terme standardisés ou des swaps fluctue quotidiennement; les règlements au comptant effectués tous les jours par le Fonds, le cas échéant, représentent la variation des profits ou des pertes latent(e)s, mieux établi(e)s au prix de règlement. Ces profits ou pertes latent(e)s sont inscrit(e)s et comptabilisé(e)s de cette manière jusqu'à ce que le Fonds dénoue le contrat ou que le contrat arrive à échéance. La marge versée ou reçue au titre des contrats à terme standardisés ou des swaps figure en tant que créance dans l'état de la situation financière au poste Marge sur instruments dérivés. Toute modification de l'exigence en matière de marge est rajustée quotidiennement.

Les primes payées pour l'achat d'options sont comptabilisées dans l'état de la situation financière au poste Placements à la juste valeur.

Les primes reçues à la souscription d'options sont incluses dans l'état de la situation financière à titre de passif et sont par la suite ajustées quotidiennement à leur juste valeur. Si une option souscrite vient à échéance sans avoir été exercée, la prime reçue est inscrite à titre de profit réalisé. Lorsqu'une option d'achat souscrite est exercée, l'écart entre le produit de la vente plus la valeur de la prime et le coût du titre est inscrit à titre de profit ou de perte réalisé(e). Lorsqu'une option de vente souscrite est exercée, le coût du titre acquis correspond au prix d'exercice de l'option moins la prime reçue.

Se reporter au tableau des instruments dérivés et au tableau des options achetées/vendues, le cas échéant, compris dans le tableau des placements pour la liste des instruments dérivés et des options au 30 septembre 2023.

Le Fonds classe la juste valeur de ses actifs et de ses passifs en trois catégories, lesquelles se différencient en fonction de la nature des données, observables ou non, et de la portée de l'estimation requise.

Niveau 1 – Prix non rajustés cotés sur des marchés actifs pour des actifs ou passifs identiques;

Niveau 2 – Données autres que les prix cotés qui sont observables pour l'actif ou le passif, soit directement, soit indirectement. Les évaluations de niveau 2 comprennent, par exemple, des prix cotés pour des titres semblables, des prix cotés sur des marchés inactifs et provenant de courtiers en valeurs mobilières reconnus, ainsi que l'application à des prix cotés ailleurs qu'en Amérique du Nord de facteurs obtenus à partir de données observables dans le but d'estimer l'incidence que peuvent avoir les différentes heures de clôture des marchés.

Les instruments financiers classés au niveau 2 sont évalués en fonction des prix fournis par une entreprise d'évaluation indépendante et reconnue qui établit le prix des titres en se fondant sur les opérations récentes et sur les estimations obtenues des intervenants du marché, en incorporant des données de marché observables et en ayant recours à des pratiques standards sur les marchés. Les placements à court terme classés au niveau 2 sont évalués en fonction du coût amorti, majoré des intérêts courus, ce qui se rapproche de la juste valeur.

Les justes valeurs estimées pour ces titres pourraient être différentes des valeurs qui auraient été utilisées si un marché pour le placement avait existé;

Niveau 3 – Données qui ne sont pas fondées sur des données de marché observables.

Les données sont considérées comme observables si elles sont élaborées à l'aide de données de marché, par exemple les informations publiées sur des événements ou des transactions réels, qui reflètent les hypothèses que les intervenants du marché utiliseraient pour fixer le prix de l'actif ou du passif.

Voir la note 10 pour le classement des justes valeurs du Fonds.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

NOTES ANNEXES

3. Principales méthodes comptables (suite)

c) Comptabilisation des produits

Les revenus d'intérêts aux fins de distribution correspondent à l'intérêt nominal reçu par le Fonds et sont comptabilisés selon la méthode de la comptabilité d'engagement. Le Fonds n'amortit pas les primes versées ou les escomptes reçus à l'achat de titres à revenu fixe, à l'exception des obligations à coupon zéro, qui sont amorties selon le mode linéaire. Les dividendes sont cumulés à compter de la date ex-dividende. Les profits ou les pertes latent(e)s sur les placements, les profits ou pertes réalisé(e)s à la vente de placements, lesquels comprennent les profits ou pertes de change sur ces placements, sont établis selon la méthode du coût moyen. Les distributions reçues d'un fonds sous-jacent sont comprises dans les revenus d'intérêts ou de dividendes, dans le profit (la perte) réalisé(e) à la vente de placements ou dans le revenu provenant des rabais sur les frais, selon le cas, à la date ex-dividende ou de distribution.

Le revenu, les profits (pertes) réalisé(e)s et les profits (pertes) latent(e)s sont répartis quotidiennement et proportionnellement entre les séries.

d) Commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille

Les commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille sont des charges engagées en vue d'acquérir, d'émettre ou de céder des actifs financiers ou des passifs financiers. Ils comprennent les honoraires et les commissions versés aux agents, aux bourses, aux courtiers et aux autres intermédiaires. Tous les courtages engagés par le Fonds en lien avec les opérations de portefeuille pour les périodes, ainsi que les autres frais d'opérations, sont présentés dans les états du résultat global. Les activités de courtage sont attribuées aux courtiers en fonction du meilleur résultat net pour le Fonds. Sous réserve de ces critères, des commissions peuvent être versées à des sociétés de courtage qui offrent certains services (ou les paient), outre l'exécution des ordres, y compris la recherche, l'analyse et les rapports sur les placements, et les bases de données et les logiciels à l'appui de ces services. Le cas échéant et lorsqu'elle est vérifiable, la valeur de ces services fournis au cours des périodes est présentée à la note 10. La valeur de certains services exclusifs fournis par des courtiers ne peut être estimée raisonnablement.

e) Opérations de prêt, de mise en pension et de prise en pension de titres

Le Fonds est autorisé à effectuer des opérations de prêt, de mise en pension et de prise en pension de titres, tel qu'il est défini dans le prospectus simplifié du Fonds. Ces opérations s'effectuent par l'échange temporaire de titres contre des biens donnés en garantie comportant l'engagement de rendre les mêmes titres à une date ultérieure.

Le revenu tiré de ces opérations se présente sous forme de frais réglés par la contrepartie et, dans certains cas, sous forme d'intérêts sur la trésorerie ou les titres détenus en garantie. Le revenu tiré de ces opérations est présenté à l'état du résultat global et constaté lorsqu'il est gagné. Les opérations de prêts de titres sont gérées par The Bank of New York Mellon (l'« agent de prêt de titres »). La valeur de la trésorerie ou des titres détenus en garantie doit équivaloir à au moins 102 % de la juste valeur des titres prêtés, vendus ou achetés.

La note 10 résume les détails relatifs aux titres prêtés et aux biens reçus en garantie à la fin de la période, et présente un rapprochement des revenus de prêt de titres durant la période, le cas échéant. Les biens reçus en garantie se composent de titres de créance du gouvernement du Canada et d'autres pays, d'administrations municipales, de gouvernements provinciaux et d'institutions financières du Canada.

f) Compensation

Les actifs financiers et les passifs financiers sont compensés et le solde net est comptabilisé dans l'état de la situation financière seulement s'il existe un droit exécutoire de compenser les montants comptabilisés et qu'il y a intention soit de régler le montant net, soit de réaliser l'actif et de régler le passif simultanément. Dans le cours normal des activités, le Fonds conclut diverses conventions-cadres de compensation ou ententes similaires qui ne satisfont pas aux critères de compensation dans l'état de la situation financière, mais qui permettent tout de même de compenser les montants dans certaines circonstances, comme une faillite ou une résiliation de contrat. La note 10 résume les détails de la compensation, le cas échéant, qui fait l'objet d'une convention-cadre de compensation ou d'autres conventions semblables et l'incidence nette sur les états de la situation financière si la totalité des droits à compensation était exercée.

Les produits et les charges ne sont pas compensés à l'état du résultat global, à moins qu'une norme comptable présentée de manière spécifique dans les méthodes IFRS adoptées par le Fonds l'exige ou le permette.

g) Devise

Le dollar américain est la monnaie fonctionnelle et la monnaie de présentation du Fonds. Les achats et les ventes de placements en devises ainsi que les dividendes, le revenu d'intérêts et les charges d'intérêts en devises sont convertis en dollars américains au taux de change en vigueur au moment de l'opération.

Les profits (pertes) de change à l'achat ou à la vente de devises sont comptabilisé(e)s dans l'état du résultat global au poste Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets – Profit (perte) net(te) réalisé(e).

La juste valeur des placements ainsi que des autres actifs et passifs libellés en devises est convertie en dollars américains au taux de change en vigueur chaque jour ouvrable.

h) Actif net attribuable aux porteurs de titres, par titre

L'actif net attribuable aux porteurs de titres par titre est calculé en divisant l'actif net attribuable aux porteurs de titres d'une série de titres un jour ouvrable donné par le nombre total de titres de la série en circulation ce jour-là.

i) Valeur liquidative par titre

La valeur liquidative quotidienne d'un fonds de placement peut être calculée sans tenir compte des IFRS conformément aux règlements des Autorités canadiennes en valeurs mobilières (les « ACVM »). La différence entre la valeur liquidative et l'actif net attribuable aux porteurs de titres (tel qu'il est présenté dans les états financiers), le cas échéant, tient principalement aux différences liées à la juste valeur des placements et des autres actifs financiers et passifs financiers, et est présentée à la note 10.

j) Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, par titre

L'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation par titre figurant dans l'état du résultat global représente l'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation pour la période, divisée par le nombre moyen pondéré de titres en circulation au cours de la période.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

NOTES ANNEXES

3. Principales méthodes comptables (suite)

k) Fusions

Dans le cadre d'une fusion de fonds, le Fonds fait l'acquisition de tous les actifs et prend en charge la totalité du passif du fonds dissous à la juste valeur en échange des titres du Fonds à la date de prise d'effet de la fusion.

l) Modifications comptables futures

Le Fonds a déterminé qu'aucune incidence importante sur ses états financiers ne découle des IFRS publiées mais non encore en vigueur.

4. Estimations et jugements comptables critiques

L'établissement de ces états financiers exige de la direction qu'elle fasse des estimations et qu'elle pose des hypothèses ayant principalement une incidence sur l'évaluation des placements. Les estimations et les hypothèses sont révisées de façon continue. Les résultats réels peuvent différer de ces estimations.

Voici les estimations et les jugements comptables les plus importants utilisés pour établir les états financiers :

Utilisation d'estimations

Juste valeur des titres non cotés sur un marché actif

Le Fonds peut détenir des instruments financiers qui ne sont pas cotés sur un marché actif et qui sont évalués au moyen de techniques d'évaluation fondées sur des données observables, dans la mesure du possible. Diverses techniques d'évaluation sont utilisées, selon un certain nombre de facteurs, notamment la comparaison avec des instruments similaires pour lesquels des cours du marché observables existent et l'examen de transactions récentes réalisées dans des conditions de concurrence normale. Les données d'entrée et les hypothèses clés utilisées sont propres à chaque société et peuvent comprendre les taux d'actualisation estimés et la volatilité prévue des prix. Des changements de données d'entrée clés peuvent entraîner une variation de la juste valeur présentée pour ces instruments financiers détenus par le Fonds.

Utilisation de jugements

Classement et évaluation des placements

Lors du classement et de l'évaluation des instruments financiers détenus par le Fonds, Mackenzie doit exercer des jugements importants afin de déterminer le classement le plus approprié selon l'IFRS 9. Mackenzie a évalué le modèle économique du Fonds, sa façon de gérer l'ensemble des instruments financiers ainsi que sa performance globale sur la base de la juste valeur, et elle a conclu que la comptabilisation à la juste valeur par le biais du résultat net conformément à l'IFRS 9 constitue la méthode d'évaluation et de présentation la plus appropriée pour les instruments financiers du Fonds.

Monnaie fonctionnelle

Le dollar américain est la monnaie fonctionnelle et la monnaie de présentation du Fonds, étant considéré comme la monnaie qui représente le plus fidèlement les effets économiques des opérations, événements et conditions sous-jacents du Fonds, compte tenu de la manière dont les titres sont émis et rachetés et dont le rendement et la performance du Fonds sont évalués.

Intérêts dans des entités structurées non consolidées

Afin de déterminer si un Fonds sous-jacent ou un FNB dans lequel le Fonds investit, mais qu'il ne consolide pas, respecte la définition d'une entité structurée, Mackenzie doit exercer des jugements importants visant à établir si ces fonds sous-jacents possèdent les caractéristiques typiques d'une entité structurée. Ces Fonds sous-jacents respectent la définition d'une entité structurée, car :

- I. les droits de vote dans les Fonds sous-jacents ne sont pas des facteurs dominants pour décider qui les contrôle;
- II. les activités des Fonds sous-jacents sont assujetties à des restrictions aux termes de leurs documents de placement;
- III. les Fonds sous-jacents ont des objectifs de placement précis et bien définis visant à offrir des occasions de placement aux investisseurs tout en leur transmettant les risques et avantages connexes.

Par conséquent, de tels placements sont comptabilisés à la JVRN. La note 10 résume les détails des participations des Fonds dans ces Fonds sous-jacents, le cas échéant.

5. Impôts sur le résultat

Le Fonds est admissible à titre de fiduciaire de fonds commun de placement en vertu des dispositions de la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada). Par conséquent, il est assujéti à l'impôt pour ce qui est de ses bénéficiaires, y compris le montant net des gains en capital réalisés pour l'année d'imposition, qui ne sont ni payés ni à payer à ses porteurs de titres à la fin de l'année d'imposition. La fin de l'année d'imposition du Fonds est en décembre. Le Fonds peut être assujéti aux retenues à la source d'impôts étrangers. En général, le Fonds traite les retenues d'impôts à la source en tant que charges portées en réduction du bénéfice aux fins du calcul de l'impôt. Le Fonds distribuera des montants suffisants tirés de son bénéfice net aux fins du calcul de l'impôt, au besoin, afin de ne pas payer d'impôt sur le résultat, à l'exception des impôts remboursables sur les gains en capital, le cas échéant.

Les pertes du Fonds ne peuvent être attribuées aux investisseurs et sont conservées par le Fonds pour des exercices futurs. Les pertes autres qu'en capital peuvent être reportées prospectivement jusqu'à 20 ans afin de réduire le bénéfice imposable et les gains en capital réalisés au cours d'exercices futurs. Les pertes en capital peuvent être reportées prospectivement indéfiniment afin de réduire les gains en capital réalisés au cours d'exercices futurs. Se reporter à la note 10 pour les reports prospectifs de pertes fiscales du Fonds.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

NOTES ANNEXES

6. Frais de gestion et frais d'exploitation

Mackenzie reçoit des frais de gestion pour la gestion du portefeuille de placements, l'analyse des placements, la formulation de recommandations et la prise de décisions quant aux placements, ainsi que pour la prise de dispositions de courtage pour l'achat et la vente de titres en portefeuille et la conclusion d'ententes avec des courtiers inscrits pour l'achat et la vente de titres du Fonds par des investisseurs. Les frais de gestion sont calculés pour chaque série de titres du Fonds en tant que pourcentage annuel fixe de la valeur liquidative quotidienne de la série.

Chaque série du Fonds, exception faite de la série-B, se voit imputer des frais d'administration annuels à taux fixe (les « frais d'administration ») et en retour, Mackenzie prend en charge tous les frais d'exploitation du Fonds autres que certains frais précis associés au Fonds. Les frais d'administration sont calculés pour chaque série de titres du Fonds en tant que pourcentage annuel fixe de la valeur liquidative quotidienne de la série.

Les autres frais associés au Fonds comprennent les taxes et impôts (y compris, mais sans s'y limiter, la TPS/TVH et l'impôt sur le résultat), les intérêts et les coûts d'emprunt, l'ensemble des frais et charges du Comité d'examen indépendant (« CEI ») des Fonds Mackenzie, les charges engagées pour respecter les exigences réglementaires en matière de production des Aperçus du Fonds, les frais versés à des fournisseurs de services externes en lien avec le recouvrement ou le remboursement de l'impôt ou avec la préparation de déclarations de revenus à l'étranger pour le compte du Fonds, les nouveaux frais associés aux services externes qui n'étaient pas généralement facturés dans le secteur canadien des fonds communs de placement et qui sont entrés en vigueur après la date de dépôt du prospectus simplifié le plus récent, ainsi que les coûts engagés pour respecter les nouvelles exigences réglementaires, y compris, sans s'y limiter, tous les nouveaux frais en vigueur après la date de dépôt du prospectus simplifié le plus récent.

Tous les frais associés à l'exploitation du Fonds quant aux titres de la série-B seront imputés à cette série. Les frais d'exploitation comprennent les frais juridiques, honoraires d'audit, frais de l'agent des transferts, droits de garde, frais d'administration et de fiducie, le coût des rapports financiers et d'impression des prospectus simplifiés, les droits de dépôt obligatoire, les autres charges diverses imputables précisément aux titres de série-B et tout impôt applicable.

Mackenzie peut renoncer aux frais de gestion et d'administration ou les absorber à son gré et mettre fin à la renonciation ou à l'absorption de ces frais en tout temps, sans préavis. Se reporter à la note 10 pour les taux des frais de gestion et d'administration imputés à chaque série de titres.

7. Capital du Fonds

Le capital du Fonds, qui comprend l'actif net attribuable aux porteurs de titres, est réparti entre les différentes séries, lesquelles comportent chacune un nombre illimité de titres. Les titres en circulation du Fonds aux 30 septembre 2023 et 2022 ainsi que les titres qui ont été émis, réinvestis et rachetés au cours de ces périodes sont présentés dans l'état de l'évolution de la situation financière. Mackenzie gère le capital du Fonds conformément aux objectifs de placement décrits à la note 10.

8. Risques découlant des instruments financiers

i. Exposition au risque et gestion du risque

Les activités de placement du Fonds l'exposent à divers risques financiers, tels qu'ils sont définis dans l'IFRS 7, *Instruments financiers : Informations à fournir* (« IFRS 7 »). L'exposition du Fonds aux risques financiers est concentrée dans ses placements, lesquels sont présentés dans le tableau des placements au 30 septembre 2023, regroupés par type d'actif, région géographique et secteur.

Mackenzie cherche à atténuer les éventuelles répercussions néfastes de ces risques sur le rendement du Fonds par l'embauche de conseillers en portefeuille professionnels et expérimentés, par la surveillance quotidienne des positions du Fonds et des événements du marché ainsi que par la diversification du portefeuille de placements en respectant les contraintes des objectifs de placement du Fonds; elle peut aussi, le cas échéant, avoir recours à des instruments dérivés à titre de couverture de certains risques. Pour faciliter la gestion des risques, Mackenzie maintient également une structure de gouvernance, dont le rôle consiste à superviser les activités de placement du Fonds et à s'assurer de la conformité avec la stratégie de placement établie du Fonds, les directives internes et la réglementation des valeurs mobilières.

ii. Risque de liquidité

Le risque de liquidité est le risque que le Fonds éprouve des difficultés à respecter ses obligations financières au fur et à mesure que celles-ci deviennent exigibles. Le Fonds est exposé au risque de liquidité en raison des rachats potentiels quotidiens en espèces de titres rachetables. Pour surveiller la liquidité de ses actifs, le Fonds a recours à un programme de gestion du risque de liquidité permettant de calculer le nombre de jours nécessaires pour convertir les placements détenus par le Fonds en espèces au moyen d'une approche de liquidation sur plusieurs jours. Cette analyse du risque de liquidité évalue la liquidité du Fonds en fonction de pourcentages de liquidité minimale prédéterminés établis pour diverses périodes et est surveillée sur une base trimestrielle. En outre, le Fonds peut emprunter jusqu'à concurrence de 5 % de la valeur de son actif net pour financer ses rachats.

Pour se conformer à la réglementation sur les valeurs mobilières, le Fonds doit conserver au moins 85 % de son actif dans des placements liquides (c.-à-d. des placements pouvant être facilement vendus).

iii. Risque de change

Le risque de change est le risque que les instruments financiers libellés ou échangés dans une monnaie autre que le dollar américain, qui est la monnaie fonctionnelle du Fonds, fluctuent en raison de variations des taux de change. En règle générale, la valeur des placements libellés dans une devise augmente lorsque la valeur du dollar américain baisse (par rapport aux devises). À l'inverse, lorsque la valeur du dollar américain augmente par rapport aux devises, la valeur des placements libellés dans une devise baisse.

La note 10 indique les devises, le cas échéant, auxquelles le Fonds avait une exposition importante, tant pour les instruments financiers monétaires que non monétaires, et illustre l'incidence potentielle, en dollars américains, sur l'actif net du Fonds d'une hausse ou d'une baisse de 5 % du dollar américain relativement à toutes les devises, toute autre variable demeurant constante. En pratique, les résultats réels de négociation peuvent différer et l'écart pourrait être important.

La sensibilité du Fonds au risque de change présentée à la note 10 comprend l'incidence indirecte potentielle des fonds sous-jacents et des FNB dans lesquels investit le Fonds, et/ou des contrats d'instruments dérivés, y compris les contrats de change à terme de gré à gré. Les autres actifs financiers et passifs financiers (y compris les dividendes et les intérêts à recevoir, ainsi que les sommes à recevoir ou à payer pour les placements vendus ou achetés) libellés en devises n'exposent pas le Fonds à un risque de change important.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

NOTES ANNEXES

8. Risques découlant des instruments financiers (suite)

iv. Risque de taux d'intérêt

Le risque de taux d'intérêt est lié aux instruments financiers portant intérêt. Le Fonds est exposé au risque que la valeur des instruments financiers portant intérêt fluctue selon les variations des taux d'intérêt du marché en vigueur. En règle générale, la valeur de ces titres augmente lorsque les taux d'intérêt baissent et diminue lorsqu'ils augmentent.

Si l'exposition est importante, la note 10 résume les instruments financiers portant intérêt du Fonds selon la durée résiduelle jusqu'à l'échéance et illustre l'incidence potentielle sur l'actif net du Fonds d'une hausse ou d'une baisse de 1 % des taux d'intérêt en vigueur, la courbe des taux évoluant en parallèle et toute autre variable demeurant constante. La sensibilité du Fonds aux fluctuations des taux d'intérêt a été estimée au moyen de la duration moyenne pondérée. En pratique, les résultats réels de négociation peuvent différer et l'écart pourrait être important.

La sensibilité du Fonds au risque de taux d'intérêt présentée à la note 10 comprend l'incidence indirecte potentielle des fonds sous-jacents et des FNB dans lesquels investit le Fonds, et/ou des contrats d'instruments dérivés. La trésorerie et les équivalents de trésorerie ainsi que les autres instruments du marché monétaire sont à court terme et ne sont généralement pas exposés à un risque de taux d'intérêt impliquant des montants importants.

v. Autre risque de prix

L'autre risque de prix est le risque que la valeur des instruments financiers fluctue en fonction des variations des cours du marché (autres que celles découlant du risque de taux d'intérêt ou du risque de change), que ces variations découlent de facteurs propres à un placement individuel ou à son émetteur, ou d'autres facteurs ayant une incidence sur tous les instruments négociés sur un marché ou un segment du marché. Tous les placements présentent un risque de perte en capital. Ce risque est géré grâce à une sélection minutieuse de placements et d'autres instruments financiers conformes aux stratégies de placement. À l'exception de certains contrats dérivés, le risque maximal découlant des instruments financiers équivaut à leur juste valeur. Le risque maximal de perte sur certains contrats dérivés, comme des contrats à terme de gré à gré, des swaps ou des contrats à terme standardisés équivaut à leurs montants notionnels. Dans le cas d'options d'achat (de vente) et de positions vendeur sur contrats à terme standardisés, la perte pour le Fonds continue d'augmenter, théoriquement sans limite, au fur et à mesure que la juste valeur de l'élément sous-jacent augmente (diminue). Toutefois, ces instruments sont généralement utilisés dans le cadre du processus global de gestion des placements afin de gérer le risque provenant des placements sous-jacents et n'augmentent généralement pas le risque de perte global du Fonds. Pour atténuer ce risque, le Fonds s'assure de détenir à la fois l'élément sous-jacent, la couverture en espèces ou la marge, dont la valeur équivaut à celle du contrat dérivé ou lui est supérieure.

L'autre risque de prix découle habituellement de l'exposition aux titres de participation et aux titres liés aux marchandises. Si l'exposition est importante, la note 10 illustre l'augmentation ou la diminution possible de l'actif net du Fonds si les cours des Bourses où se négocient ces titres avaient augmenté ou diminué de 10 %, toute autre variable demeurant constante. En pratique, les résultats réels de négociation peuvent différer et l'écart pourrait être important.

La sensibilité du Fonds à l'autre risque de prix présentée à la note 10 comprend l'incidence indirecte potentielle des fonds sous-jacents et des FNB dans lesquels investit le Fonds, et/ou des contrats d'instruments dérivés.

vi. Risque de crédit

Le risque de crédit est le risque qu'une contrepartie à un instrument financier ne s'acquitte pas d'une obligation ou d'un engagement pris envers le Fonds. La note 10 résume l'exposition du Fonds au risque de crédit, si une telle exposition s'applique et est importante.

Si elles sont présentées, les notes de crédit et les catégories de crédit sont basées sur les notes d'une agence de notation désignée. L'exposition indirecte au risque de crédit peut provenir des titres à revenu fixe, tels que les obligations, détenus par des fonds sous-jacents ou des FNB, le cas échéant. La juste valeur des titres de créance tient compte de la solvabilité de l'émetteur de ces titres.

Afin de réduire la possibilité d'un défaut de règlement, la livraison des titres vendus se fait simultanément contre paiement, quand les pratiques du marché le permettent, au moyen d'un dépôt central ou d'une agence de compensation et de dépôt lorsque c'est la façon de procéder.

La valeur comptable des placements et des autres actifs représente l'exposition maximale au risque de crédit à la date de l'état de la situation financière. Le Fonds peut effectuer des opérations de prêt sur titres avec d'autres parties et peut aussi être exposé au risque de crédit découlant des contreparties aux instruments dérivés qu'il pourrait utiliser. Le risque de crédit associé à ces opérations est jugé minime puisque toutes les contreparties ont une cote de solvabilité équivalant à une note de crédit d'une agence de notation désignée d'au moins A-1 (faible) pour la dette à court terme ou de A pour la dette à long terme, selon le cas.

vii. Fonds sous-jacents

Le Fonds peut investir dans des fonds sous-jacents et peut être exposé indirectement au risque de change, au risque de taux d'intérêt, à l'autre risque de prix et au risque de crédit en raison des fluctuations de la valeur des instruments financiers détenus par les fonds sous-jacents. La note 10 résume l'exposition du Fonds à ces risques provenant des fonds sous-jacents, si une telle exposition s'applique et est importante.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

NOTES ANNEXES

9. Autres renseignements

Abréviations

Les devises, le cas échéant, sont présentées dans les présents états financiers en utilisant les codes de devises suivants :

Code de la devise	Description	Code de la devise	Description	Code de la devise	Description
AUD	Dollar australien	HUF	Forint hongrois	PLN	Zloty polonais
AED	Dirham des Émirats arabes unis	IDR	Rupiah indonésienne	QAR	Rial du Qatar
BRL	Real brésilien	ILS	Shekel israélien	RON	Leu roumain
CAD	Dollar canadien	INR	Roupie indienne	RUB	Rouble russe
CHF	Franc suisse	JPY	Yen japonais	SAR	Riyal saoudien
CKZ	Couronne tchèque	KOR	Won sud-coréen	SEK	Couronne suédoise
CLP	Peso chilien	MXN	Peso mexicain	SGD	Dollar de Singapour
CNY	Yuan chinois	MYR	Ringgit malaisien	THB	Baht thaïlandais
COP	Peso colombien	NGN	Naira nigérian	TRL	Livre turque
DKK	Couronne danoise	NOK	Couronne norvégienne	USD	Dollar américain
EGP	Livre égyptienne	NTD	Nouveau dollar de Taïwan	VND	Dong vietnamien
EUR	Euro	NZD	Dollar néo-zélandais	ZAR	Rand sud-africain
GBP	Livre sterling	PEN	Nouveau sol péruvien	ZMW	Kwacha zambien
GHS	Cedi ghanéen	PHP	Peso philippin		
HKD	Dollar de Hong Kong	PKR	Roupie pakistanaise		

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

NOTES ANNEXES

10. Renseignements propres au Fonds (en milliers de \$ US, sauf pour a))

a) Constitution du Fonds et renseignements sur les séries

Date de constitution : 1^{er} mai 2015

Le Fonds peut émettre un nombre illimité de titres de chaque série. Le nombre de titres de chaque série qui ont été émis et qui sont en circulation est présenté dans les états de l'évolution de la situation financière.

Séries offertes par Corporation Financière Mackenzie (180, rue Queen Ouest, Toronto (Ontario) M5V 3K1; 1-800-387-0615; www.placementsmackenzie.com)

Les montants minimaux ci-dessous sont calculés en dollars américains.

Les titres des séries A et T8 sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$ (5 000 \$ pour la série T8). Les investisseurs des séries A et T8 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % ou de 8 % par année, respectivement.

Les titres de série D sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$ par l'entremise d'un compte de courtage à escompte ou de tout autre compte approuvé par Mackenzie. Les investisseurs de série D désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année.

Les titres des séries F et F8 sont offerts aux investisseurs qui participent à un programme de services rémunérés à l'acte ou de comptes intégrés parrainé par le courtier, qui sont assujettis à des frais établis en fonction de l'actif plutôt qu'à des commissions pour chaque opération et qui investissent un minimum de 500 \$ (5 000 \$ pour la série F8); ils sont également proposés aux employés de Mackenzie et de ses filiales, et aux administrateurs de Mackenzie. Les investisseurs des séries F et F8 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % ou de 8 % par année, respectivement.

Les titres de série FB sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$. Les investisseurs doivent négocier leurs honoraires de service du conseiller, lesquels ne peuvent dépasser 1,50 %, avec leur conseiller financier. Les investisseurs de série FB désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année.

Les titres des séries PW et PWT8 sont offerts à certains investisseurs à valeur nette élevée de nos Solutions Patrimoine privé qui investissent un minimum de 100 000 \$. Les investisseurs des séries PW et PWT8 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % ou de 8 % par année, respectivement.

Les titres de série PWFB sont offerts à certains investisseurs à valeur nette élevée de nos Solutions Patrimoine privé qui investissent un minimum de 100 000 \$. Les investisseurs doivent négocier leurs honoraires de service du conseiller, lesquels ne peuvent dépasser 1,50 %, avec leur conseiller financier. Les investisseurs de série PWFB désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année.

Les titres des séries PWX et PWX8 sont offerts à certains investisseurs à valeur nette élevée de nos Solutions Patrimoine privé qui investissent un minimum de 100 000 \$. Les investisseurs doivent négocier leurs honoraires de service du conseiller, lesquels ne peuvent dépasser 1,50 %, avec leur conseiller financier. Les investisseurs des séries PWX et PWX8 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % ou de 8 % par année, respectivement.

Depuis le 1^{er} juin 2022, les investisseurs peuvent acheter des titres du Fonds seulement en vertu d'un mode de souscription avec frais d'acquisition. Les frais d'acquisition du mode de souscription avec frais d'acquisition sont négociés entre l'investisseur et son courtier. Les titres souscrits avant le 1^{er} juin 2022 en vertu du mode de souscription avec frais de rachat, du mode de souscription avec frais modérés 3 et du mode de souscription avec frais modérés 2 (collectivement, les « modes de souscription avec frais d'acquisition différés ») peuvent continuer d'être détenus dans les comptes des investisseurs. Les investisseurs peuvent échanger des titres d'un Fonds Mackenzie souscrits antérieurement en vertu de ces modes de souscription avec frais d'acquisition différés contre des titres d'autres Fonds Mackenzie, en vertu du même mode de souscription, jusqu'à l'expiration du délai prévu dans le barème des frais de rachat. Pour de plus amples renseignements, veuillez vous reporter au prospectus simplifié du Fonds et à l'aperçu du Fonds.

Série	Date d'établissement/ de rétablissement	Frais de gestion	Frais d'administration
Série A	20 mai 2015	1,85 %	0,24 %
Série D	20 mai 2015	0,85 % ²⁾	0,16 %
Série F	20 mai 2015	0,70 %	0,15 %
Série F8	1 ^{er} juin 2018	0,70 %	0,15 %
Série FB	26 octobre 2015	0,85 %	0,24 %
Série PW	20 mai 2015	1,70 %	0,15 %
Série PWFB	3 avril 2017	0,70 %	0,15 %
Série PWT8	3 avril 2017	1,70 %	0,15 %
Série PWX	15 juin 2015	— ¹⁾	— ¹⁾
Série PWX8	24 octobre 2018	— ¹⁾	— ¹⁾
Série T8	26 mai 2015	1,85 %	0,24 %

1) Ces frais sont payables directement à Mackenzie par les investisseurs dans cette série par l'entremise du rachat de leurs titres.

2) Avant le 4 avril 2022, les frais de gestion pour la série D étaient imputés au Fonds au taux de 1,10 %.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

NOTES ANNEXES

10. Renseignements propres au Fonds (en milliers de \$ US, sauf pour a)) (suite)

b) Reports prospectifs de pertes fiscales

Total de la perte en capital \$	Total de la perte autre qu'en capital \$	Date d'échéance des pertes autres qu'en capital													
		2029 \$	2030 \$	2031 \$	2032 \$	2033 \$	2034 \$	2035 \$	2036 \$	2037 \$	2038 \$	2039 \$	2040 \$	2041 \$	2042 \$
1 318	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

c) Prêt de titres

	30 septembre 2023	31 mars 2023
	(\$)	(\$)
Valeur des titres prêtés	104	5 104
Valeur des biens reçus en garantie	109	5 380

	30 septembre 2023		30 septembre 2022	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
Revenus de prêts de titres bruts	6	100,0	4	100,0
Impôt retenu à la source	(1)	(16,7)	-	-
	5	83,3	4	100,0
Paiements à l'agent de prêt de titres	(1)	(16,7)	(1)	(25,0)
Revenu tiré du prêt de titres	4	66,6	3	75,0

d) Commissions

	(\$)
30 septembre 2023	3
30 septembre 2022	2

e) Risques découlant des instruments financiers

i. Exposition au risque et gestion du risque

Le Fonds vise à générer un revenu avec un potentiel de croissance du capital à long terme en dollars américains en investissant principalement dans des titres à revenu fixe et/ou des titres de participation axés sur le revenu émis partout dans le monde. Selon la conjoncture économique et les évaluations relatives des conseillers en valeurs du Fonds, ce dernier investira généralement de 30 % à 70 % de son actif dans des titres de participation et dans des titres à revenu fixe, mais il peut investir jusqu'à 100 % de son actif dans l'une ou l'autre de ces catégories d'actifs.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

NOTES ANNEXES

10. Renseignements propres au Fonds (en milliers de \$ US, sauf pour a)) (suite)

e) Risques découlant des instruments financiers (suite)

ii. Risque de change

Les tableaux ci-après résument l'exposition du Fonds au risque de change.

Devise	30 septembre 2023				Incidence sur l'actif net			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Renforcement de 5 %		Affaiblissement de 5 %	
					(\$)	%	(\$)	%
EUR	6 435	40	(565)	5 910				
GBP	2 660	30	339	3 029				
JPY	2 599	(30)	(205)	2 364				
BRL	1 131	77	(42)	1 166				
CHF	1 428	–	(526)	902				
MXN	1 072	6	(371)	707				
DKK	660	4	–	664				
ZAR	584	33	(42)	575				
SGD	532	8	–	540				
HKD	529	6	–	535				
NTD	502	2	–	504				
INR	268	2	–	270				
NZD	1 691	–	(1 439)	252				
IDR	194	–	–	194				
CAD	9 813	335	(9 968)	180				
NOK	–	2	178	180				
AUD	366	1	(234)	133				
PEN	–	–	111	111				
THB	–	–	54	54				
SEK	234	–	(238)	(4)				
CLP	–	–	(20)	(20)				
HUF	–	–	(35)	(35)				
PLN	–	–	(51)	(51)				
Total	30 698	516	(13 054)	18 160				
% de l'actif net	39,9	0,7	(17,0)	23,6				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					(908)	(1,2)	908	1,2

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

NOTES ANNEXES

10. Renseignements propres au Fonds (en milliers de \$ US, sauf pour a)) (suite)

- e) Risques découlant des instruments financiers (suite)
 ii. Risque de change (suite)

31 mars 2023

Devise	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Incidence sur l'actif net			
					Renforcement de 5 %		Affaiblissement de 5 %	
					(\$)	%	(\$)	%
EUR	8 275	472	(1 518)	7 229				
GBP	2 926	36	206	3 168				
JPY	2 024	430	(447)	2 007				
CHF	1 724	34	(547)	1 211				
CAD	12 902	305	(12 145)	1 062				
HKD	761	8	–	769				
DKK	714	10	–	724				
BRL	511	–	(23)	488				
NTD	617	–	(162)	455				
SGD	580	–	(136)	444				
INR	290	–	117	407				
NZD	489	–	(281)	208				
EGP	–	–	191	191				
AUD	453	2	(312)	143				
NOK	191	4	(126)	69				
MXN	1 338	6	(1 288)	56				
ZAR	–	–	41	41				
HUF	–	–	(25)	(25)				
SEK	229	–	(254)	(25)				
COP	–	–	(28)	(28)				
KOR	–	–	(46)	(46)				
PEN	–	–	(47)	(47)				
IDR	–	–	(84)	(84)				
Total	34 024	1 307	(16 914)	18 417				
% de l'actif net	40,6	1,6	(20,2)	22,0				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					(921)	(1,1)	921	1,1

* Comprend les instruments financiers monétaires et non monétaires.

iii. Risque de taux d'intérêt

Les tableaux ci-après résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt découlant de ses placements dans des obligations et des instruments dérivés selon la durée jusqu'à l'échéance.

30 septembre 2023	Obligations (\$)	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
			Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
			(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	1 072	(6 560)				
1 an à 5 ans	7 297	–				
5 ans à 10 ans	14 827	–				
Plus de 10 ans	7 482	–				
Total	30 678	(6 560)				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt			(1 856)	(2,4)	1 856	2,4

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

NOTES ANNEXES

10. Renseignements propres au Fonds (en milliers de \$ US, sauf pour a)) (suite)

e) Risques découlant des instruments financiers (suite)

iii. Risque de taux d'intérêt (suite)

31 mars 2023	Obligations (\$)	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
			Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
			(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	423	(18 758)				
1 an à 5 ans	11 445	–				
5 ans à 10 ans	11 289	–				
Plus de 10 ans	11 324	–				
Total	34 481	(18 758)				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt			(1 580)	(1,9)	1 589	1,9

iv. Autre risque de prix

Le tableau ci-après résume l'exposition du Fonds à l'autre risque de prix.

Incidence sur l'actif net	Augmentation de 10 %		Diminution de 10 %	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
30 septembre 2023	4 229	5,5	(4 229)	(5,5)
31 mars 2023	4 666	5,6	(4 666)	(5,6)

v. Risque de crédit

Pour ce Fonds, la plus forte concentration du risque de crédit se trouve dans les titres de créance, tels que les obligations. La juste valeur des titres de créance tient compte de la solvabilité de l'émetteur de ces titres. L'exposition maximale à tout émetteur de titres de créance au 30 septembre 2023 était de 14,5 % de l'actif net du Fonds (16,9 % au 31 mars 2023).

Au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023, les titres de créance par note de crédit étaient les suivants :

Note des obligations*	30 septembre 2023	31 mars 2023
	% de l'actif net	% de l'actif net
AAA	5,4	7,0
AA	16,0	19,4
A	4,6	3,5
BBB	6,5	6,4
Inférieure à BBB	4,2	2,3
Sans note	3,2	2,5
Total	39,9	41,1

* Les notes de crédit et les catégories de crédit sont basées sur les notes d'une agence de notation désignée.

f) Classement de la juste valeur

Le tableau ci-après résume la juste valeur des instruments financiers du Fonds selon la hiérarchie de la juste valeur décrite à la note 3.

	30 septembre 2023				31 mars 2023			
	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	–	30 678	–	30 678	–	34 481	–	34 481
Actions	25 603	14 524	7	40 134	27 286	16 627	7	43 920
Options	–	1	–	1	–	21	–	21
Fonds/billets négociés en bourse	1 534	–	–	1 534	1 861	–	–	1 861
Fonds communs de placement	195	–	–	195	452	–	–	452
Fonds privés	–	–	428	428	–	–	426	426
Actifs dérivés	171	228	–	399	–	205	–	205
Passifs dérivés	(35)	(36)	–	(71)	(449)	(146)	–	(595)
Placements à court terme	–	2 205	–	2 205	–	16	–	16
Total	27 468	47 600	435	75 503	29 150	51 204	433	80 787

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

NOTES ANNEXES

10. Renseignements propres au Fonds (en milliers de \$ US, sauf pour a)) (suite)

f) Classement de la juste valeur (suite)

La méthode du Fonds consiste à comptabiliser les transferts vers ou depuis les différents niveaux de la hiérarchie de la juste valeur à la date de l'événement ou du changement de circonstances à l'origine du transfert.

Au cours de la période close le 30 septembre 2023, les actions autres que nord-américaines étaient fréquemment transférées entre le niveau 1 (prix non rajustés cotés) et le niveau 2 (prix rajustés). Au 30 septembre 2023, ces titres étaient classés dans le niveau 2 (niveau 2 au 31 mars 2023).

Le tableau ci-après présente un rapprochement des instruments financiers évalués à la juste valeur à l'aide de données non observables (niveau 3) pour les périodes closes le 30 septembre 2023 et le 31 mars 2023 :

	30 septembre 2023				31 mars 2023			
	Actions (\$)	Obligations (\$)	Fonds privés (\$)	Total (\$)	Actions (\$)	Obligations (\$)	Fonds privés (\$)	Total (\$)
Solde, à l'ouverture	7	–	426	433	10	19	200	229
Achats	–	–	8	8	–	–	237	237
Ventes	–	–	–	–	–	(311)	–	(311)
Transferts entrants	–	–	–	–	–	–	–	–
Transferts sortants	–	–	–	–	–	–	–	–
Profits (pertes) au cours de la période :								
Réalisé(e)s	–	–	–	–	–	(797)	–	(797)
Latent(e)s	–	–	(6)	(6)	(3)	1 089	(11)	1 075
Solde, à la clôture	7	–	428	435	7	–	426	433
Variation des profits (pertes) latent(e)s au cours de la période attribuables aux titres détenus à la clôture de la période	–	–	(6)	(6)	(3)	–	(11)	(14)

Le changement d'une ou de plusieurs données donnant lieu à d'autres hypothèses raisonnablement possibles pour évaluer les instruments financiers du niveau 3 n'entraînerait aucune variation importante de la juste valeur de ces instruments.

g) Placements détenus par le gestionnaire et des sociétés affiliées

Les placements détenus par le gestionnaire, d'autres fonds gérés par le gestionnaire et des fonds gérés par des sociétés affiliées au gestionnaire, investis dans les séries CL, IG ou S du Fonds, le cas échéant (comme il est décrit à la rubrique *Constitution du Fonds et renseignements sur les séries* de la note 10), s'établissaient comme suit :

	30 septembre 2023	31 mars 2023
	(\$)	(\$)
Gestionnaire	–	11
Autres fonds gérés par le gestionnaire	–	–
Fonds gérés par des sociétés affiliées au gestionnaire	–	–

h) Compensation d'actifs et de passifs financiers

Les tableaux ci-après présentent les actifs et passifs financiers qui font l'objet d'une convention-cadre de compensation ou d'autres conventions semblables et l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds si la totalité des droits à compensation était exercée dans le cadre d'événements futurs comme une faillite ou la résiliation de contrats. Aucun montant n'a été compensé dans les états financiers.

	30 septembre 2023			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	360	(62)	–	298
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(67)	62	(257)	(262)
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	293	–	(257)	36

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

NOTES ANNEXES

10. Renseignements propres au Fonds (en milliers de \$ US, sauf pour a)) (suite)

h) Compensation d'actifs et de passifs financiers (suite)

	31 mars 2023			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	155	(19)	–	136
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(556)	19	913	376
Obligation pour options vendues	(10)	–	–	(10)
Total	(411)	–	913	502

i) Intérêts dans des entités structurées non consolidées

Les détails des placements du Fonds dans des fonds sous-jacents au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023 sont les suivants :

30 septembre 2023	% de l'actif net du Fonds sous-jacent	Juste valeur des placements du Fonds (\$)
FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	0,2	551
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	0,2	258
Fonds international de dividendes Mackenzie, série R	0,0	155
FINB Obligations américaines totales Mackenzie (couvert en \$ CA)	0,8	174
Fonds de revenu fixe sans contraintes Mackenzie, série R	0,0	40
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	0,1	182
FINB TIPS américains Mackenzie (couvert en \$ CA)	0,1	369
Northleaf Private Credit II LP	0,0	296
Sagard Credit Partners II LP	0,0	132

31 mars 2023	% de l'actif net du Fonds sous-jacent	Juste valeur des placements du Fonds (\$)
FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	0,2	586
Fonds mondial chinois Mackenzie, série R	0,9	199
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	0,2	271
Fonds international de dividendes Mackenzie, série R	0,1	212
FINB Obligations américaines totales Mackenzie (couvert en \$ CA)	0,9	184
Fonds de revenu fixe sans contraintes Mackenzie, série R	0,0	41
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	0,1	421
FINB TIPS américains Mackenzie (couvert en \$ CA)	0,1	399
Northleaf Private Credit II LP	0,0	301
Sagard Credit Partners II LP	0,0	125

j) Engagement

	30 septembre 2023		31 mars 2023	
	Montant appelé (\$ US)	Engagement d'investissement total (\$ US)	Montant appelé (\$ US)	Engagement d'investissement total (\$ US)
Northleaf Private Credit II LP ¹⁾	296	366	291	366
Sagard Credit Partners II LP ²⁾	125	366	125	366

¹⁾ Ce fonds est géré par Northleaf Capital Partners (Canada) Ltd., une société affiliée à Mackenzie.

²⁾ Ce fonds est géré par Sagard Holdings Inc., une société affiliée à Mackenzie.