

## **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](http://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 multistratégie à rendement absolu 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 MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

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

	30 sept. 2023	31 mars 2023 (Audité)
	\$	\$
<b>ACTIF</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements à la juste valeur	44 203	71 551
Trésorerie et équivalents de trésorerie	31 854	49 656
Intérêts courus à recevoir	278	398
Dividendes à recevoir	485	428
Sommes à recevoir pour placements vendus	281	221
Sommes à recevoir pour titres émis	1	–
Sommes à recevoir du gestionnaire	2	–
Marge sur instruments dérivés	1 571	2 807
Actifs dérivés	1 916	2 238
<b>Total de l'actif</b>	<b>80 591</b>	<b>127 299</b>
<b>PASSIF</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert à la juste valeur	15 887	29 081
Sommes à payer pour placements achetés	93	223
Sommes à payer pour titres rachetés	–	77
Intérêts à payer sur les titres vendus à découvert	6	7
Dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	462	397
Sommes à payer au gestionnaire	–	11
Obligation pour options vendues	67	73
Passifs dérivés	2 129	1 734
<b>Total du passif</b>	<b>18 644</b>	<b>31 603</b>
<b>Actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>61 947</b>	<b>95 696</b>

## ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

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

	2023 \$	2022 \$
<b>Revenus (note 10j))</b>		
Dividendes	34	806
Revenus d'intérêts aux fins de distribution	1 502	1 004
Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets		
Profit (perte) net(te) réalisé(e)	(1 792)	(2,301)
Profit (perte) net(te) latent(e)	372	73
Revenu provenant des rabais sur les frais	–	2
<b>Total des revenus (pertes)</b>	<b>116</b>	<b>(416)</b>
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	36	81
Frais d'administration	5	12
Intérêts débiteurs	119	3
Frais d'emprunt	(80)	170
Commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille	113	128
Frais du comité d'examen indépendant	–	–
<b>Charges avant les montants absorbés par le gestionnaire</b>	<b>193</b>	<b>394</b>
Charges absorbées par le gestionnaire	–	–
<b>Charges nettes</b>	<b>193</b>	<b>394</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, avant impôt</b>	<b>(77)</b>	<b>(810)</b>
Charge (économie) d'impôt étranger retenu à la source	28	109
Charge d'impôt étranger sur le résultat (recouvrée)	–	–
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation</b>	<b>(105)</b>	<b>(919)</b>

### 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	7,99	8,09	680	846
Série CL	–	8,95	–	4 435
Série F	8,52	8,56	3 549	6 887
Série FB	8,41	8,47	1	1
Série O	9,03	9,02	1	233
Série PW	8,08	8,17	375	553
Série PWFB	8,62	8,64	1	1
Série PWX	9,04	9,03	184	547
Série R	8,96	8,95	57 102	69 116
Série S	9,63	9,63	54	13 077
			<b>61 947</b>	<b>95 696</b>

### 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	(0,11)	(0,17)	(10)	(28)
Série CL	0,04	(0,06)	20	(25)
Série F	(0,05)	(0,06)	(24)	(55)
Série FB	(0,06)	(0,13)	–	–
Série O	(0,14)	(0,08)	(1)	(21)
Série PW	(0,10)	(0,14)	(5)	(32)
Série PWFB	(0,03)	(0,09)	–	–
Série PWX	–	(0,20)	–	(68)
Série R	(0,01)	(0,07)	(92)	(612)
Série S	0,03	(0,06)	7	(78)
			<b>(105)</b>	<b>(919)</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.



# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 \$, sauf les montants par titre)

	Série PWX		Série R		Série S	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>						
<b>À l'ouverture</b>	<b>547</b>	<b>23</b>	<b>69 116</b>	<b>84 593</b>	<b>13 077</b>	<b>11 789</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	–	(68)	(92)	(612)	7	(78)
Distributions aux porteurs de titres :						
Revenu de placement	–	(18)	–	(297)	–	(51)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	–	(18)	–	(297)	–	(51)
Opérations sur les titres :						
Produit de l'émission de titres	1	11 237	108	456	74	1 219
Réinvestissement des distributions	–	18	–	–	–	51
Paiements au rachat de titres	(364)	(7 223)	(12 030)	(15 133)	(13 104)	(885)
Total des opérations sur les titres	(363)	4 032	(11 922)	(14 677)	(13 030)	385
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>(363)</b>	<b>3 946</b>	<b>(12 014)</b>	<b>(15 586)</b>	<b>(13 023)</b>	<b>256</b>
<b>À la clôture</b>	<b>184</b>	<b>3 969</b>	<b>57 102</b>	<b>69 007</b>	<b>54</b>	<b>12 045</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>	<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>	
<b>Titres en circulation, à l'ouverture</b>	<b>61</b>	<b>3</b>	<b>7 718</b>	<b>9 461</b>	<b>1 359</b>	<b>1 226</b>
Émis	–	1 251	12	51	8	128
Réinvestissement des distributions	–	2	–	–	–	5
Rachetés	(41)	(811)	(1 360)	(1 709)	(1 361)	(92)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>20</b>	<b>445</b>	<b>6 370</b>	<b>7 803</b>	<b>6</b>	<b>1 267</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

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

	2023	2022
	\$	\$
<b>Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation	(105)	(919)
Ajustements pour :		
Perte (profit) net(te) réalisé(e) sur les placements	3 542	1 784
Variation de la perte (du profit) net(te) latent(e) sur les placements	(372)	(73)
Achat de placements	(53 157)	(58 472)
Produit de la vente et de l'échéance de placements	64 694	61 195
(Augmentation) diminution des sommes à recevoir et autres actifs	1 297	1 498
Augmentation (diminution) des sommes à payer et autres passifs	53	57
<b>Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités d'exploitation</b>	<b>15 952</b>	<b>5 070</b>
<b>Flux de trésorerie liés aux activités de financement</b>		
Produit de l'émission de titres	473	29 282
Paiements au rachat de titres	(34 177)	(27 048)
Distributions versées, déduction faite des réinvestissements	(18)	(318)
<b>Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités de financement</b>	<b>(33 722)</b>	<b>1 916</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>	<b>(17 770)</b>	<b>6 986</b>
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à l'ouverture	49 656	58 652
Incidence des fluctuations des taux de change sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie	(32)	466
<b>Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture</b>	<b>31 854</b>	<b>66 104</b>
Trésorerie	15 113	38 251
Équivalents de trésorerie	16 741	27 853
<b>Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture</b>	<b>31 854</b>	<b>66 104</b>
<b>Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :</b>		
Dividendes reçus	534	1 240
Dividendes versés	492	405
Impôts étrangers payés	28	109
Intérêts reçus	1 656	962
Intérêts versés	154	56

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES PLACEMENTS

au 30 septembre 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>POSITIONS ACHETEUR</b>					
<b>OBLIGATIONS</b>					
AerCap Ireland Capital DAC 3,00 % 29-10-2028	Irlande	Sociétés – Non convertibles	21 000 USD	24	24
Algonquin Power & Utilities Corp., taux variable 18-01-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	194 000	184	154
AltaGas Ltd., taux variable 11-01-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	101 000	97	80
AltaGas Ltd., taux variable 17-08-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	66 000	66	64
Altice France SA 5,13 % 15-07-2029	France	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	206	193
Ardagh Metal Packaging 4,00 % 01-09-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	33 000 USD	43	35
Ardagh Packaging Finance PLC 5,25 % 15-08-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	92 000 USD	105	104
Ashton Woods USA LLC 4,63 % 01-08-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	86 000 USD	106	99
AutoCanada Inc. 5,75 % 07-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000	100	87
Black Knight InfoServ LLC 3,63 % 01-09-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	56 000 USD	70	69
Broadcast Media Partners Holdings Inc. 4,50 % 01-05-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	42 000 USD	53	47
Brookfield Residential Properties Inc. 5,13 % 15-06-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	119 000	120	98
California Resources Corp. 7,13 % 01-02-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	37 000 USD	48	51
Capital Power Corp., taux variable 09-09-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	98 000	98	94
Carnival Corp. 9,88 % 01-08-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	35 000 USD	51	50
Carriage Purchaser Inc. 7,88 % 15-10-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	70 000 USD	83	72
Cascades inc. 5,13 % 15-01-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	150 000	146	146
Cascades inc. 5,13 % 15-01-2026, rachetables 2023 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	102 000 USD	137	133
CCO Holdings LLC 4,25 % 01-02-2031, rachetables 2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	68 000 USD	74	74
Clearway Energy Group LLC 3,75 % 15-02-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	30 000 USD	35	32
Clearway Energy LLC 3,75 % 15-01-2032 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	40 000 USD	51	42
Clydesdale Acquisition Holdings Inc. 8,75 % 15-04-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	70 000 USD	83	82
Cogent Communications Group Inc. 7,00 % 15-06-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	48 000 USD	61	62
Coinbase Global Inc. 3,63 % 01-10-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	230 000 USD	178	209
Cologix Data Centers Issuer LLC 4,94 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	102 000	102	92
Cologix Data Centers Issuer LLC 5,68 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	81 000	81	72
Columbia Care Inc. 6,00 % 29-06-2025, conv.	Canada	Sociétés – Convertibles	89 000 USD	117	94
CommScope Inc. 4,75 % 01-09-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	41 000 USD	52	41
CommScope Technologies Finance LLC 8,25 % 01-03-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	76 000 USD	91	68
Condor Merger Sub Inc. 7,38 % 15-02-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	31 000 USD	38	35
Corus Entertainment Inc. 5,00 % 11-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	170 000	165	115
Country Garden Holdings Co. Ltd. 2,70 % 12-07-2026	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	171	18
Covert Mergco Inc. 4,88 % 01-12-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000 USD	12	11
Crocs Inc. 4,25 % 15-03-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	40 000 USD	52	45
Crown Americas LLC 5,25 % 01-04-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	125 000 USD	160	157
Curleaf Holdings Inc. 8,00 % 15-12-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	60 000 USD	77	67
Diamond Sports Group LLC 5,38 % 15-08-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	128 000 USD	100	4
Diamond Sports Group LLC 6,63 % 15-08-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	66 000 USD	32	2
DISH DBS Corp. 5,25 % 01-12-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	39 000 USD	42	45
DISH Network Corp. 11,75 % 15-11-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	31 000 USD	41	42
Domtar Corp. 6,75 % 01-10-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	178 000 USD	225	200
Ecopetrol SA 4,63 % 02-11-2031	Colombie	Sociétés – Non convertibles	62 000 USD	74	64
Eldorado Gold Corp. 6,25 % 01-09-2029 144A	Turquie	Sociétés – Non convertibles	31 000 USD	39	36
Embecta Corp. 5,00 % 15-02-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	44 000 USD	54	47
Emera Inc., taux variable 15-06-2076, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	56 000 USD	74	73
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	262 000	275	236
Enel SPA 2,25 % 12-07-2031 144A	Italie	Sociétés – Non convertibles	45 000 USD	46	46
Ensign Drilling Inc. 9,25 % 15-04-2024 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	73 000 USD	89	99
Expedia Group Inc. 2,95 % 15-03-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	47 000 USD	50	51
Fair Isaac Corp. 4,00 % 15-06-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	65 000 USD	78	79
Compagnie Crédit Ford du Canada 2,96 % 16-09-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	299 000	279	267
Ford Motor Co. 3,25 % 12-02-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	48 000 USD	50	50
Ford Motor Credit Co. LLC 2,70 % 10-08-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	92 000 USD	111	111
Frontier Communications Corp. 5,88 % 15-10-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	33 000 USD	45	41
Corporation de Sécurité Garda World 6,00 % 01-06-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	150 000 USD	151	167
Gibson Energy Inc., taux variable 22-12-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	143 000	141	117
GoDaddy Operating Co. LLC 3,50 % 01-03-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	53 000 USD	64	61
Gray Escrow Inc. 7,00 % 15-05-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	38 000 USD	46	44
Gray Television Inc. 5,38 % 15-11-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	211 000 USD	268	187
Greenfire Resources Inc. 12,00 % 01-10-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 USD	27	27
Gulfport Energy Corp. 8,00 % 17-05-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	28 000 USD	38	38

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N <sup>bre</sup> d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>POSITIONS ACHETEUR (suite)</b>					
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Heartland Dental LLC 10,50 % 30-04-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	26 000 USD	35	36
Hilton Domestic Operating Co. Inc. 4,88 % 15-01-2030, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	47 000 USD	57	58
Innovative Industrial Properties Inc. 5,50 % 25-05-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	56 000 USD	75	68
Inter Pipeline Ltd., taux variable 26-03-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000	243	231
Inter Pipeline Ltd., taux variable 19-11-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	180 000	196	162
International Game Technology PLC 2,38 % 15-04-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 EUR	111	128
Iris Merger Sub 2019 Inc. 9,38 % 15-02-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	81 000 USD	112	106
Iron Mountain Inc. 5,00 % 15-07-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	61 000 USD	79	76
Iron Mountain Inc. 5,25 % 15-07-2030, rachetables 2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	21 000 USD	28	25
Kaisa Group Holdings 10,50 % 27-10-2023	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	92	16
Kaisa Group Holdings 8,65 % 27-10-2023	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	91	16
Keyera Corp., taux variable 10-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000	199	170
Keyera Corp., taux variable 13-06-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	190 000	201	176
Kleopatra Finco SARL 4,25 % 01-03-2026	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	100 000 EUR	121	120
Kronos Acquisition Holdings Inc. 5,00 % 31-12-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	34 000 USD	42	42
Produits Kruger S.E.C. 5,38 % 09-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	165 000	169	141
Produits Kruger S.E.C. 6,00 % 24-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000	192	193
L Brands Inc. 6,63 % 01-10-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	45 000 USD	58	58
LABL Escrow Issuer LLC 10,50 % 15-07-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	80 000 USD	99	102
LABL Escrow Issuer LLC 6,75 % 15-07-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	182 000 USD	235	240
LABL Inc. 8,25 % 01-11-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	182 000 USD	208	202
Banque Laurentienne du Canada, taux variable 15-06-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	300 000	291	228
Logan Group Co. Ltd. 4,70 % 06-07-2026	Chine	Sociétés – Non convertibles	204 000 USD	142	20
Société Financière Manuvie, taux variable 19-06-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	38 000	38	37
Marriott International Inc. 4,90 % 15-04-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	24 000 USD	32	31
Mattamy Group Corp. 4,63 % 01-03-2030, rachetables 2025 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	76 000 USD	85	88
Mattel Inc. 3,38 % 01-04-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	86 000 USD	111	108
Mattel Inc. 3,75 % 01-04-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000 USD	24	24
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 7,88 % 15-08-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	62 000 USD	83	81
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 9,25 % 15-04-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	113 000 USD	151	134
Mav Acquisition Corp. 5,75 % 01-08-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	170 000 USD	210	200
MEDNAX Inc. 5,38 % 15-02-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	24 000 USD	27	29
MEG Energy Corp. 5,88 % 01-02-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	112 000 USD	141	142
Mercer International Inc., taux variable 01-02-2029	Allemagne	Sociétés – Non convertibles	28 000 USD	36	30
Minerva Merger Sub Inc. 6,50 % 15-02-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	111 000 USD	137	126
Molina Healthcare Inc. 3,88 % 15-05-2032 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000 USD	25	22
Mozart Debt Merger Sub Inc. 5,25 % 01-10-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	95 000 USD	118	112
Murphy Oil USA Inc. 3,75 % 15-02-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	122 000 USD	140	136
Nabors Industries Ltd. 7,25 % 15-01-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	16 000 USD	19	21
Banque Nationale du Canada, taux variable 15-08-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000	86	74
Banque Nationale du Canada, taux variable 16-11-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000	41	39
New Red Finance Inc. 4,00 % 15-10-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	88 000 USD	109	99
Northland Power Inc., taux variable 30-06-2083	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000	30	30
NuVista Energy Ltd. 7,88 % 23-07-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	82 000	82	83
Open Text Corp. 3,88 % 01-12-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	32 000 USD	38	36
Open Text Holdings Inc. 4,13 % 01-12-2031 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	35 000 USD	39	38
Corporation Parkland du Canada 4,38 % 26-03-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	214 000	202	187
Corporation Parkland du Canada 4,50 % 01-10-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	72 000 USD	91	84
Pattern Energy Operations LP 4,50 % 15-08-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	41 000 USD	55	49
Pembina Pipeline Corp., taux variable 25-01-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	257 000	244	207
Perrigo Co. PLC 3,15 % 15-06-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	24 000 USD	27	28
PharmaCann LLC 12,00 % 30-06-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	90 000 USD	115	117
Pilgrim's Pride Corp. 3,50 % 01-03-2032 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	46 000 USD	50	48
Pilgrim's Pride Corp. 4,25 % 15-04-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	30 000 USD	35	34
Rogers Communications Inc., taux variable 15-03-2082 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	90 000 USD	114	108
Rogers Communications Inc., taux variable 17-12-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	126 000	126	114
Sabre Global Inc. 8,63 % 01-06-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	30 000 USD	35	35
Sealed Air Corp. 6,13 % 01-02-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000 USD	14	13
Seaspan Corp. 5,50 % 01-08-2029 144A	Hong Kong	Sociétés – Non convertibles	37 000 USD	48	40

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>POSITIONS ACHETEUR (suite)</b>					
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Secure Energy Services Inc. 7,25 % 30-12-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	214 000	216	212
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 2,70 % 13-01-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	87	17
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 4,75 % 05-08-2029	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	107	11
Source Energy Services Canada LP 10,50 % 15-03-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	89 850	51	78
Square Inc. 2,75 % 01-06-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	110 000 USD	135	134
Steel Dynamics Inc. 3,45 % 15-04-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	40 000 USD	49	47
Sunac China Holdings Ltd. 5,95 % 26-04-2024	Chine	Sociétés – Non convertibles	214 000 USD	79	38
Sunac China Holdings Ltd. 6,50 % 10-01-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	59	36
Supérieur Plus S.E.C. 4,25 % 18-05-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	116 000	114	103
Supérieur Plus S.E.C. 4,50 % 15-03-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	81 000 USD	107	96
Tacora Resources Inc. 8,25 % 15-05-2026 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	23 000 USD	31	17
Tamarack Valley Energy Ltd. 7,25 % 10-05-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	157 000	152	149
TEGNA Inc. 4,63 % 15-03-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	51 000 USD	66	60
Tenet Healthcare Corp. 4,38 % 15-01-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	85 000 USD	105	99
TerraForm Power Operating LLC 5,00 % 31-01-2028, rachetables 2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	135	123
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 5,13 % 09-05-2029	Israël	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	249	246
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-01-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	330 000	325	330
Trulieve Cannabis Corp. 8,00 % 06-10-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	110 000 USD	131	122
Trulieve Cannabis Corp. 9,75 % 18-06-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	24 000 USD	33	32
Uber Technologies Inc. 8,00 % 01-11-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	90 000 USD	126	124
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,50 % 15-04-2024	États-Unis	Gouvernements étrangers	135 000 USD	215	218
Obligations du Trésor des États-Unis 3,50 % 15-02-2033	États-Unis	Gouvernements étrangers	51 000 USD	66	64
US Foods Inc. 4,75 % 15-02-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	30 000 USD	37	36
Vermilion Energy Inc. 6,88 % 01-05-2030 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	170 000 USD	211	219
Vidéotron Itée 3,13 % 15-01-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	217 000	204	169
Vidéotron Itée 4,50 % 15-01-2030, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000	207	175
VistaJet Malta Finance PLC 6,38 % 01-02-2030 144A	Suisse	Sociétés – Non convertibles	220 000 USD	275	231
VistaJet Malta Finance PLC 9,50 % 01-06-2028 144A	Suisse	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	134	120
WarnerMedia Holdings Inc. 4,28 % 15-03-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000 USD	23	23
Weatherford International Ltd. 8,63 % 30-04-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	190 000 USD	237	260
WildBrain Ltd. 5,88 % 30-09-2024, conv.	Canada	Sociétés – Convertibles	142 000	138	131
<b>Total des obligations</b>				<b>15 914</b>	<b>14 168</b>
<b>ACTIONS</b>					
1-800-FLOWERS.COM Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	8 890	124	84
Abcam PLC	Royaume-Uni	Soins de santé	1 880	40	58
ABN AMRO Group NV	Pays-Bas	Services financiers	2 330	44	45
Advanced Technology & Materials Co. Ltd.	Chine	Matériaux	1 400	2	2
Advantage Energy Ltd.	Canada	Énergie	50 000	164	464
Aena SA	Espagne	Produits industriels	96	20	20
Air Canada	Canada	Produits industriels	1 464	34	28
Alamos Gold Inc.	Canada	Matériaux	540	9	8
Alibaba Group Holding Ltd.	Chine	Consommation discrétionnaire	11 850	197	174
American Airlines Group Inc.	États-Unis	Produits industriels	3 930	84	68
American International Group Inc.	États-Unis	Services financiers	462	33	38
Anheuser-Busch InBev NV	Belgique	Consommation de base	149	12	11
Anker Innovations Technology Co. Ltd.	Chine	Technologie de l'information	2 800	45	49
Antero Resources Corp.	États-Unis	Énergie	71	2	2
Applied Materials Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	184	34	35
ARC Resources Ltd.	Canada	Énergie	24 600	191	533
ArcelorMittal SA	Luxembourg	Matériaux	228	9	8
ArcSoft Corp. Ltd.	Chine	Technologie de l'information	2 000	13	15
Astellas Pharma Inc.	Japon	Soins de santé	700	14	13
Atlassian Corp. PLC, cat. A	États-Unis	Technologie de l'information	128	29	35
Autodesk Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	87	23	24
AutoZone Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	1	3	3
AvePoint Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	8 250	62	75
AviChina Industry & Technology Co. Ltd.	Chine	Produits industriels	40 274	26	26
B&M European Value Retail SA	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	2 152	21	21

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>POSITIONS ACHETEUR (suite)</b>					
<b>ACTIONS (suite)</b>					
Badger Infrastructure Solutions Ltd.	Canada	Produits industriels	6 000	193	208
BAIC Motor Corp. Ltd.	Chine	Consommation discrétionnaire	20 500	7	8
Baidu Inc., CAAE	Chine	Services de communication	44	9	8
Baker Hughes Co.	États-Unis	Énergie	10 000	416	479
Banca Mediolanum SPA	Italie	Services financiers	1 006	12	12
Banco Santander SA	Espagne	Services financiers	8 196	39	42
Bank of Hangzhou Co. Ltd.	Chine	Services financiers	4 200	10	9
Barclays PLC	Royaume-Uni	Services financiers	17 055	45	45
BAWAG Group AG	Autriche	Services financiers	170	12	11
BCE Inc.					
4,54 %, à div. cumulatif rachetable, priv. de premier rang, série R, rachetables	Canada	Services de communication	361	7	5
BCE Inc., priv., série AA	Canada	Services de communication	277	5	4
BCE Inc., priv., série AL	Canada	Services de communication	125	2	2
BioMarin Pharmaceutical Inc.	États-Unis	Soins de santé	40	5	5
BKW AG	Suisse	Services publics	129	32	31
BlueScope Steel Ltd.	Australie	Matériaux	2 228	39	38
Bombardier Inc., cat. B, à droit de vote subalterne	Canada	Produits industriels	653	44	31
Booking Holdings Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	7	25	29
BOW Technology Group Co. Ltd., cat. A	Chine	Technologie de l'information	126 800	104	91
BP PLC, CAAE	Royaume-Uni	Énergie	12 000	566	631
BPER Banca SPA	Italie	Services financiers	10 384	46	43
British American Tobacco PLC	Royaume-Uni	Consommation de base	162	8	7
Brixmor Property Group Inc.	États-Unis	Biens immobiliers	638	19	18
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 46	Canada	Biens immobiliers	155	4	3
Brookfield Renewable Partners L.P., priv., série 13	Canada	Services publics	121	3	2
BRP inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	324	30	33
Buzzi Unicem SPA	Italie	Matériaux	621	21	23
BYD Co. Ltd., H	Chine	Consommation discrétionnaire	3 000	126	125
BYD Electronic International Co. Ltd.	Chine	Technologie de l'information	14 000	80	86
California Resources Corp.	États-Unis	Énergie	4 000	151	304
La Société Canadian Tire Ltée, cat. A, sans droit de vote	Canada	Consommation discrétionnaire	13	2	2
Cardinal Health Inc.	États-Unis	Soins de santé	270	33	32
Carnival PLC, CAAE	États-Unis	Consommation discrétionnaire	127	3	2
Carrefour SA	France	Consommation de base	1 424	31	33
carsales.com Ltd.	Australie	Services de communication	1 345	34	33
Cenovus Energy Inc., priv., série 3	Canada	Énergie	49	1	1
Cenovus Energy Inc., priv., série 7	Canada	Énergie	412	9	8
Centennial Resource Development Inc.	États-Unis	Énergie	11 600	129	220
Centrica PLC	Royaume-Uni	Services publics	1 723	4	4
Chesapeake Energy Corp.	États-Unis	Énergie	3 000	300	351
Chevron Corp.	États-Unis	Énergie	655	270	150
Chico's FAS Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	11 890	82	121
China Construction Bank Corp., H	Chine	Services financiers	193 000	171	148
China CSSC Holdings Ltd.	Chine	Produits industriels	4 800	25	25
China Eastern Airlines Corp. Ltd.	Chine	Produits industriels	106 817	89	87
China Merchants Bank Co. Ltd., H	Chine	Services financiers	4 000	24	23
China Pacific Insurance (Group) Co. Ltd., cat. A	Chine	Services financiers	4 800	24	26
China Petroleum & Chemical Corp.	Chine	Énergie	7 500	9	8
China Resources Phoenix Healthcare Holdings Co. Ltd.	Chine	Soins de santé	6 000	5	5
China Shineway Pharmaceutical Group Ltd.	Chine	Soins de santé	6 000	8	8
China Southern Airlines Co. Ltd.	Chine	Produits industriels	1 929	2	1
China Tower Corp. Ltd.	Chine	Services de communication	618 000	99	80
China Travel International Investment Hong Kong Ltd.	Chine	Consommation discrétionnaire	49 833	13	13
Chubb Ltd.	États-Unis	Services financiers	115	28	32
Chubu Electric Power Co. Inc.	Japon	Services publics	2 300	31	40
CIMC Vehicles Group Co. Ltd.	Chine	Produits industriels	30 300	69	69
Cisco Systems Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	240	13	18
Coca-Cola European Partners PLC	Royaume-Uni	Consommation de base	532	35	45
Coca-Cola HBC AG-DI	Suisse	Consommation de base	794	27	30
Cochlear Ltd.	Australie	Soins de santé	135	28	30

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>POSITIONS ACHETEUR (suite)</b>					
<b>ACTIONS (suite)</b>					
Colgate-Palmolive Co.	États-Unis	Consommation de base	314	31	30
Comerica Inc.	États-Unis	Services financiers	606	34	34
Commercial Vehicle Group Inc.	États-Unis	Produits industriels	6 460	91	68
Contemporary Amperex Technology Co. Ltd.	Chine	Produits industriels	300	13	11
Corebridge Financial Inc.	États-Unis	Services financiers	913	20	24
Cricut Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	5 780	83	73
CTP NV	Pays-Bas	Biens immobiliers	467	8	9
CVS Health Corp.	États-Unis	Soins de santé	354	41	34
D.R. Horton Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	212	31	31
Daito Trust Construction Co. Ltd.	Japon	Biens immobiliers	200	29	29
Dell Technologies Inc., cat. C	États-Unis	Technologie de l'information	356	33	33
Deutsche Lufthansa AG, nom.	Allemagne	Produits industriels	1 438	12	16
Devon Energy Corp.	États-Unis	Énergie	5 000	293	324
DHC Software Co. Ltd.	Chine	Technologie de l'information	7 900	11	10
Diamondback Energy Inc.	États-Unis	Énergie	1 500	282	315
DocuSign Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	145	8	8
Doximity Inc.	États-Unis	Soins de santé	112	5	3
Dropbox Inc., cat. A	États-Unis	Technologie de l'information	980	30	36
Dun & Bradstreet Holdings Inc.	États-Unis	Produits industriels	224	3	3
E.ON SE	Allemagne	Services publics	506	8	8
Eastroc Beverage (Group) Co. Ltd.	Chine	Consommation de base	2 500	85	85
easyJet PLC	Royaume-Uni	Produits industriels	3 203	27	23
Elanco Animal Health Inc.	États-Unis	Soins de santé	981	13	15
Electronic Arts Inc.	États-Unis	Services de communication	201	32	33
Emera Inc., priv., série J	Canada	Services publics	16	–	–
Emera Inc., priv., série L	Canada	Services publics	2 195	55	36
Emerson Electric Co.	États-Unis	Produits industriels	233	27	31
Empire Co. Ltd., cat. A, sans droit de vote	Canada	Consommation de base	69	3	3
Enel SPA	Italie	Services publics	857	8	7
ENGIE SA	France	Services publics	2 114	38	44
Enviri Corp.	États-Unis	Produits industriels	7 560	95	74
Equitrans Midstream Corp.	États-Unis	Énergie	5 990	80	76
Essent Group Ltd.	États-Unis	Services financiers	434	22	28
Essex Property Trust Inc.	États-Unis	Biens immobiliers	8	3	2
Evercore Partners Inc., cat. A	États-Unis	Services financiers	122	18	23
Expedia Group Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	226	40	32
Fairfax Financial Holdings Ltd., priv., série E	Canada	Services financiers	54	1	1
Ferroglobe PLC	États-Unis	Matériaux	10 490	71	74
Finning International Inc.	Canada	Produits industriels	800	33	32
First Horizon National Corp.	États-Unis	Services financiers	2 144	37	32
Focus Media Information Technology Co. Ltd., cat. A	Chine	Services de communication	30 500	41	41
Fortinet Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	238	16	19
Fortune Brands Home & Security Inc.	États-Unis	Produits industriels	89	8	8
Foxconn Industrial Internet Co. Ltd.	Chine	Technologie de l'information	9 400	39	34
Fuyao Glass Industry Group Co. Ltd.	Chine	Consommation discrétionnaire	6 200	43	43
Garrett Motion Inc.	Suisse	Consommation discrétionnaire	7 200	72	77
Geely Automobile Holdings Ltd.	Chine	Consommation discrétionnaire	23 000	37	37
General Electric Co.	États-Unis	Produits industriels	216	23	32
Genting Singapore Ltd.	Singapour	Consommation discrétionnaire	35 500	39	30
George Weston Itée	Canada	Consommation de base	92	16	14
GigaCloud Technology Inc.	Hong Kong	Consommation discrétionnaire	3 740	52	45
G-III Apparel Group Ltd.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	2 940	76	99
Les Vêtements de Sport Gildan Inc.	Canada	Consommation discrétionnaire	718	35	27
GlaxoSmithKline PLC	Royaume-Uni	Soins de santé	274	6	7
GoodRx Holdings Inc.	États-Unis	Soins de santé	8 790	64	67
Great Lakes Dredge & Dock Corp.	États-Unis	Produits industriels	6 820	79	74
Guangzhou Baiyun International Airport Co. Ltd.	Chine	Produits industriels	2 100	6	4
Guangzhou Development Group Inc.	Chine	Énergie	2 800	3	3
H. Lundbeck AS	Danemark	Soins de santé	1 815	11	13
Halliburton Co.	États-Unis	Énergie	618	30	34
Helix Energy Solutions Group Inc.	États-Unis	Énergie	5 290	69	80

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>POSITIONS ACHETEUR (suite)</b>					
<b>ACTIONS (suite)</b>					
Hengdian Entertainment Co. Ltd.	Chine	Services de communication	3 200	11	10
Hewlett Packard Enterprise Co.	États-Unis	Technologie de l'information	1 333	26	31
Highwood Asset Management Ltd.	Canada	Énergie	35 000	209	201
Highwood Asset Management Ltd., bons de souscription éch. 03-08-2026	Canada	Énergie	15 000	–	12
Huafa Industrial Co. Ltd. (Zhuhai), cat. A	Chine	Biens immobiliers	2 400	4	4
Huangshan Tourism Development Co. Ltd.	Chine	Consommation discrétionnaire	4 800	5	5
Huayu Automotive Systems Co. Ltd., cat. A	Chine	Consommation discrétionnaire	19 300	67	67
Hugo Boss AG	Allemagne	Consommation discrétionnaire	138	12	12
Hulic Co. Ltd.	Japon	Biens immobiliers	2 700	30	33
iA Société financière inc.	Canada	Services financiers	444	40	38
Imeik Technology Development Co. Ltd.	Chine	Soins de santé	100	8	7
Imperial Brands PLC	Royaume-Uni	Consommation de base	444	14	12
Incyte Corp.	États-Unis	Soins de santé	190	16	15
Insperty Inc.	États-Unis	Produits industriels	176	25	23
International Consolidated Airlines Group SA	Royaume-Uni	Produits industriels	591	2	1
International Game Technology PLC	États-Unis	Consommation discrétionnaire	1 053	35	43
Intuit Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	6	4	4
Japan Post Holdings Co. Ltd.	Japon	Services financiers	3 800	37	41
Jefferies Financial Group Inc.	États-Unis	Services financiers	634	25	32
JetBlue Airways Corp.	États-Unis	Produits industriels	10 030	124	63
Jiangsu Pacific Quartz Co. Ltd.	Chine	Technologie de l'information	2 500	49	50
Juneyao Airlines Co. Ltd.	Chine	Produits industriels	9 100	28	24
JXTG Holdings Inc.	Japon	Énergie	400	2	2
KE Holdings Inc.	Chine	Biens immobiliers	1 478	31	31
Keppel Corp. Ltd.	Singapour	Produits industriels	5 600	28	38
KeyCorp	États-Unis	Services financiers	2 357	30	34
Kite Realty Group Trust	États-Unis	Biens immobiliers	838	25	24
Kosmos Energy Ltd.	Ghana	Énergie	30 000	307	333
Kuaishou Technology Co. Ltd.	Chine	Services de communication	10 300	99	111
Kweichow Moutai Co. Ltd., cat. A	Chine	Consommation de base	200	68	67
Lawson Inc.	Japon	Consommation de base	400	25	25
Legend Biotech Corp., CAAE	Chine	Soins de santé	379	35	35
Lennar Corp., cat. A	États-Unis	Consommation discrétionnaire	129	21	20
Lens Technology Co. Ltd.	Chine	Technologie de l'information	20 000	43	46
Li Auto Inc.	Chine	Consommation discrétionnaire	2 028	76	98
Liberty Global PLC, série C	États-Unis	Services de communication	1 271	33	32
Lightwave Logic Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	9 330	86	57
Live Nation Entertainment Inc.	États-Unis	Services de communication	289	32	33
Les Compagnies Loblaw Itée					
5,30 % à div. cumulatif rachetable, priv. de second rang, série B	Canada	Consommation de base	609	16	12
Luminar Technologies Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	10 120	87	63
Luzhou Laojiao Co. Ltd.	Chine	Consommation de base	400	17	16
LyondellBasell Industries NV, cat. A	États-Unis	Matériaux	149	20	19
Marathon Petroleum Corp.	États-Unis	Énergie	125	26	26
Marks & Spencer Group PLC	Royaume-Uni	Consommation de base	7 890	25	31
Masco Corp.	États-Unis	Produits industriels	391	34	28
Mastercard Inc., cat. A	États-Unis	Services financiers	17	8	9
Mazda Motor Corp.	Japon	Consommation discrétionnaire	3 000	31	46
Medtronic PLC	États-Unis	Soins de santé	32	3	3
MEG Energy Corp.	Canada	Énergie	21 934	212	580
Meituan-Dianping	Chine	Consommation discrétionnaire	8 115	198	160
Melco Resorts & Entertainment Ltd., CAAE	Hong Kong	Consommation discrétionnaire	1 959	30	26
Mercury NZ Ltd.	Nouvelle-Zélande	Services publics	1 670	9	8
Meritage Homes Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	195	37	32
Meta Platforms Inc., cat. A	États-Unis	Services de communication	86	16	35
Mettler-Toledo International Inc.	États-Unis	Soins de santé	1	2	2
MGIC Investment Corp.	États-Unis	Services financiers	1 446	26	33
Mint Group Ltd.	Hong Kong	Consommation discrétionnaire	13 965	55	48
Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co. Ltd.	Japon	Services financiers	400	3	4
National Fuel Gas Co.	États-Unis	Services publics	57	4	4
NatWest Group PLC	Royaume-Uni	Services financiers	7 594	30	30

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>POSITIONS ACHETEUR (suite)</b>					
<b>ACTIONS (suite)</b>					
NAURA Technology Group Co. Ltd., cat. A	Chine	Technologie de l'information	1 000	51	45
Navitas Semiconductor Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	6 580	79	62
Neoenegria SA	Brésil	Services publics	75 000	324	373
NetEase Inc.	Chine	Services de communication	109	14	15
Neurocrine Biosciences Inc.	États-Unis	Soins de santé	52	7	8
New China Life Insurance Co. Ltd.	Chine	Services financiers	12 800	88	88
New York REIT Inc.	États-Unis	Biens immobiliers	1 050	23	18
Newmark Group Inc.	États-Unis	Biens immobiliers	8 090	84	71
News Corp., cat. A	États-Unis	Services de communication	111	3	3
Nexans SA	France	Produits industriels	46	6	5
Nissan Motor Co. Ltd.	Japon	Consommation discrétionnaire	7 800	40	47
Nongfu Spring Co. Ltd.	Chine	Consommation de base	4 735	36	37
Northern Oil and Gas Inc.	États-Unis	Énergie	12 000	194	656
Novo Nordisk AS, B	Danemark	Soins de santé	378	27	47
Nutanix Inc., cat. A	États-Unis	Technologie de l'information	696	29	33
Occidental Petroleum Corp., bons de souscription éch. 03-08-2027	États-Unis	Énergie	1 240	–	73
Offshore Oil Engineering Co. Ltd.	Chine	Énergie	27 300	28	33
Okta Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	186	21	21
OneMain Holdings Inc.	États-Unis	Services financiers	470	30	26
Open Text Corp.	Canada	Technologie de l'information	866	45	41
Orica Ltd.	Australie	Matériaux	440	6	6
Ovintiv Inc.	États-Unis	Énergie	7 000	328	452
Palantir Technologies Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	2 823	62	61
Palo Alto Networks Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	108	24	34
Paramount Resources Ltd., cat. A	Canada	Énergie	10 000	306	323
Parex Resources Inc.	Canada	Énergie	17 000	325	433
Parker Hannifin Corp.	États-Unis	Produits industriels	62	25	33
Corporation Pétroles Parkland	Canada	Énergie	10 000	348	397
Partners Group Holding AG	Suisse	Services financiers	2	3	3
PayPal Holdings Inc.	États-Unis	Services financiers	19	2	2
PetroChina Co. Ltd., H	Chine	Énergie	20 000	16	20
Petróleo Brasileiro SA – Petrobras, CAAE	Brésil	Énergie	20 000	365	407
Peyto Exploration & Development Corp., reçus de souscription	Canada	Énergie	10 000	119	138
Philip Morris International Inc.	États-Unis	Consommation de base	175	20	22
PICC Property & Casualty Co. Ltd., H	Chine	Services financiers	62 000	74	108
Pilbara Minerals Ltd.	Australie	Matériaux	3 102	14	12
Pinduoduo Inc.	Chine	Consommation discrétionnaire	27	4	4
Ping An Insurance (Group) Co. of China Ltd., cat. A	Chine	Services financiers	5 300	49	48
Plains GP Holdings LP	États-Unis	Énergie	20 000	295	438
Polaris Infrastructure Inc.	Canada	Services publics	14 100	211	200
Popular Inc.	Porto Rico	Services financiers	358	36	31
Post Holdings Inc.	États-Unis	Consommation de base	235	30	27
Pro Medicus Ltd.	Australie	Soins de santé	199	12	14
PulteGroup Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	93	8	9
Pure Storage Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	689	27	33
Qantas Airways Ltd.	Australie	Produits industriels	9 480	46	43
Québecor inc., cat. B, à droit de vote subalterne	Canada	Services de communication	55	2	2
Raiffeisen International Bank-Holding AG	Autriche	Services financiers	930	19	18
Raytron Technology Co. Ltd.	Chine	Technologie de l'information	4 682	42	42
Republic Services Inc.	États-Unis	Produits industriels	93	16	18
Rexel SA	France	Produits industriels	1 157	25	35
Ricoh Co. Ltd.	Japon	Technologie de l'information	2 100	24	25
ROK Resources Inc., bons de souscription éch. 04-03-2025	Canada	Énergie	600 000	–	116
Rolls-Royce Holdings PLC	Royaume-Uni	Produits industriels	457	2	2
Royal Caribbean Cruises Ltd.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	30	4	4
S&P Global Inc.	États-Unis	Services financiers	65	38	32
Saab AB, cat. B	Suède	Produits industriels	141	11	10
Sany Heavy Equipment International Holdings Co. Ltd.	Chine	Produits industriels	23 293	45	50
Sarepta Therapeutics Inc.	États-Unis	Soins de santé	29	5	5
Saturn Oil & Gas Inc.	Canada	Énergie	95 000	200	272
Saturn Oil & Gas Inc., bons de souscription éch. 10-03-2025	Canada	Énergie	175 000	–	74

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>POSITIONS ACHETEUR (suite)</b>					
<b>ACTIONS (suite)</b>					
SBI Holdings Inc.	Japon	Services financiers	1 400	39	40
Scout24 AG	Allemagne	Services de communication	256	22	24
Seatrium Ltd.	Singapour	Produits industriels	304 200	38	40
Secure Energy Services Inc.	Canada	Énergie	45 000	172	336
SERES Group Co. Ltd.	Chine	Consommation discrétionnaire	6 000	44	63
Seven Group Holdings Ltd.	Australie	Produits industriels	353	8	10
SGIS Songshan Co. Ltd.	Chine	Matériaux	101 799	53	55
Shanghai Allist Pharmaceuticals Co. Ltd.	Chine	Soins de santé	10 996	65	80
Shanghai Henlius Biotech Inc., cat. H	Chine	Soins de santé	3 964	8	7
Shanghai International Airport Co. Ltd., cat. A	Chine	Produits industriels	11 300	112	80
ShawCor Ltd.	Canada	Énergie	13 000	156	207
Shell PLC-W/I, CAAE	Pays-Bas	Énergie	7 000	361	612
Singapore Airlines Ltd.	Singapour	Produits industriels	4 400	23	28
Sinopharm Group Co., H	Chine	Soins de santé	3 823	16	15
Sitio Royalties Corp., cat. A	États-Unis	Énergie	4 000	134	131
SkyWest Inc.	États-Unis	Produits industriels	1 280	73	73
Snap Inc.	États-Unis	Services de communication	5 546	88	67
Groupe SNC-Lavalin inc.	Canada	Produits industriels	689	30	31
Squarespace Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	1 800	72	71
Stantec Inc.	Canada	Produits industriels	483	34	43
State Street Corp.	États-Unis	Services financiers	283	28	26
Streamax Technology Co. Ltd.	Chine	Consommation discrétionnaire	4 800	27	27
Subaru Corp.	Japon	Consommation discrétionnaire	600	16	16
SUMCO Corp.	Japon	Technologie de l'information	400	8	7
Swedish Orphan Biovitrum AB	Suède	Soins de santé	132	2	4
Synchrony Financial	États-Unis	Services financiers	740	32	31
T. Rowe Price Group Inc.	États-Unis	Services financiers	126	32	18
Tamarack Valley Energy Ltd.	Canada	Énergie	30 000	121	117
Targa Resources Corp.	États-Unis	Énergie	3 300	327	384
Taylor Morrison Home Corp., cat. A	États-Unis	Consommation discrétionnaire	567	33	33
TechnipFMC PLC	Royaume-Uni	Énergie	10 475	214	289
Teekay Corp.	États-Unis	Énergie	9 240	78	77
Tencent Holdings Ltd.	Chine	Services de communication	7 300	457	384
TETRA Technologies Inc.	États-Unis	Énergie	9 850	71	85
Textron Inc.	États-Unis	Produits industriels	357	33	38
TFI International Inc.	Canada	Produits industriels	262	40	46
The AES Corp.	États-Unis	Services publics	289	8	6
The Allstate Corp.	États-Unis	Services financiers	160	22	24
The GEO Group Inc.	États-Unis	Produits industriels	7 610	72	85
The Hershey Co.	États-Unis	Consommation de base	10	2	3
The Mosaic Co.	États-Unis	Matériaux	40	2	2
The Travelers Companies Inc.	États-Unis	Services financiers	17	4	4
The Williams Companies Inc.	États-Unis	Énergie	11 000	307	503
ThyssenKrupp AG	Allemagne	Matériaux	3 566	36	37
Toll Brothers Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	51	6	5
Topaz Energy Corp.	Canada	Énergie	17 600	359	377
Toromont Industries Ltd.	Canada	Produits industriels	61	7	7
Total SA, CAAE	France	Énergie	7 500	384	671
Tourmaline Oil Corp.	Canada	Énergie	6 664	75	455
TransAlta Corp., perpétuelles, priv., série C	Canada	Services publics	782	15	13
TransAlta Corp., priv., série A	Canada	Services publics	286	4	3
Transocean Ltd.	États-Unis	Énergie	6 920	79	77
Truist Financial Corp.	États-Unis	Services financiers	516	23	20
Uber Technologies Inc.	États-Unis	Produits industriels	562	26	35
United Airlines Holdings Inc.	États-Unis	Produits industriels	1 150	82	66
United Rentals Inc.	États-Unis	Produits industriels	57	25	34
US Foods Holding Corp.	États-Unis	Consommation de base	28	2	2
Verallia SA	France	Matériaux	358	19	19
Visionox Technology Inc.	Chine	Technologie de l'information	48 600	65	70
Vistra Corp.	États-Unis	Services publics	831	28	37
Vodafone Group PLC	Royaume-Uni	Services de communication	4 416	6	6

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>POSITIONS ACHETEUR (suite)</b>					
<b>ACTIONS (suite)</b>					
Volvo Car AB	Suède	Consommation discrétionnaire	4 942	30	27
Wanda Film Holding Co. Ltd.	Chine	Services de communication	4 600	11	12
Wasion Group Holdings Ltd.	Chine	Technologie de l'information	10 000	5	5
Weave Communications Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	5 680	76	63
Wells Fargo & Co.	États-Unis	Services financiers	253	14	14
West Fraser Timber Co. Ltd.	Canada	Matériaux	375	44	37
WeWork Inc., cat. A	États-Unis	Biens immobiliers	584	14	2
Whitecap Resources Inc.	Canada	Énergie	40 000	411	459
Wix.com Ltd.	Israël	Technologie de l'information	333	42	41
Workday Inc., cat. A	États-Unis	Technologie de l'information	112	22	33
Wynn Resorts Ltd.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	82	9	10
Xero Ltd.	Nouvelle-Zélande	Technologie de l'information	371	34	37
Xiamen King Long Motor Group Co. Ltd.	Chine	Produits industriels	10 700	15	14
Xinfengming Group Co. Ltd.	Chine	Matériaux	500	1	1
Yancoal Australia Ltd.	Australie	Énergie	5 367	24	24
Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd.	Singapour	Produits industriels	22 300	37	37
Yankershop Food Co. Ltd.	Chine	Consommation de base	3 150	45	44
Zhengzhou Yutong Bus Co. Ltd., cat. A	Chine	Produits industriels	37 986	100	94
ZhongMan Petroleum and Natural Gas Group Corp. Ltd.	Chine	Énergie	21 900	81	88
<b>Total des actions</b>				<b>20 070</b>	<b>24 187</b>
<b>OPTIONS</b>					
Options achetées (se reporter au tableau des options achetées)				398	484
<b>Total des options</b>				<b>398</b>	<b>484</b>
<b>FONDS/BILLETS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>					
iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	730	135	101
SPDR Bloomberg High Yield Bond ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	900	110	110
SPDR S&P Oil & Gas Exploration & Production ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	5 700	1 067	1 145
<b>Total des fonds/billets négociés en bourse</b>				<b>1 312</b>	<b>1 356</b>
<b>FONDS COMMUNS DE PLACEMENT</b>					
<sup>1</sup> Fonds toutes actions Chine Mackenzie ChinaAMC, série R	Canada	Fonds communs de placement	555 181	5 602	3 812
<b>Total des fonds communs de placement</b>				<b>5 602</b>	<b>3 812</b>
<b>FONDS PRIVÉS</b>					
<sup>2</sup> Sagard Credit Partners II LP	Canada	Services financiers	40	187	196
<b>Total des fonds privés</b>				<b>187</b>	<b>196</b>
<b>Total des positions acheteur</b>				<b>43 483</b>	<b>44 203</b>
<b>POSITIONS VENDEUR</b>					
<b>OBLIGATIONS</b>					
Bombardier Inc. 6,00 % 15-02-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	(65 000) USD	(81)	(80)
Bombardier Inc. 7,88 % 15-04-2027 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	(64 000) USD	(77)	(85)
Bread Financial Holdings Inc. 7,00 % 15-01-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(40 000) USD	(49)	(51)
Coty Inc. 4,75 % 15-01-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(40 000) USD	(52)	(49)
Credit Acceptance Corp. 6,63 % 15-03-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(200 000) USD	(264)	(262)
Eco Material Technologies Inc. 7,88 % 31-01-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(40 000) USD	(49)	(52)
Griffon Corp. 5,75 % 01-03-2028, rachetables 2023	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(44 000) USD	(53)	(54)
Paramount Global 4,20 % 19-05-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(20 000) USD	(22)	(22)
TRI Pointe Group Inc. 5,70 % 15-06-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(200 000) USD	(274)	(252)
United States Steel Corp. 6,88 % 01-03-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(40 000) USD	(52)	(54)
W. R. Grace Holdings LLC 5,63 % 15-08-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(40 000) USD	(44)	(44)
<b>Total des obligations</b>				<b>(1 017)</b>	<b>(1 005)</b>

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>POSITIONS VENDEUR (suite)</b>					
<b>ACTIONS</b>					
AAON Inc.	États-Unis	Produits industriels	(112)	(10)	(9)
Admiral Group PLC	Royaume-Uni	Services financiers	(583)	(21)	(23)
Adyen NV	Pays-Bas	Services financiers	(17)	(46)	(17)
Affirm Holdings Inc.	États-Unis	Services financiers	(279)	(7)	(8)
Airbnb Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(9)	(1)	(2)
Aker ASA	Norvège	Produits industriels	(70)	(6)	(6)
ALD SA	France	Produits industriels	(812)	(10)	(9)
Algonquin Power & Utilities Corp.	Canada	Services publics	(851)	(8)	(7)
Allegion PLC	États-Unis	Produits industriels	(85)	(11)	(12)
Alliant Energy Corp.	États-Unis	Services publics	(314)	(23)	(21)
Alstom SA	France	Produits industriels	(727)	(27)	(23)
Amcor PLC (actions américaines)	Jersey	Matériaux	(964)	(14)	(12)
American Water Works Co. Inc.	États-Unis	Services publics	(124)	(25)	(21)
Analog Devices Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(12)	(3)	(3)
Andritz AG	Autriche	Produits industriels	(93)	(6)	(6)
Anterix Inc.	États-Unis	Services de communication	(1 680)	(76)	(72)
Antero Midstream Corp.	États-Unis	Énergie	(756)	(10)	(12)
Apollo Global Management Inc.	États-Unis	Services financiers	(144)	(9)	(18)
Apple Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(84)	(20)	(20)
Ares Management Corp.	États-Unis	Services financiers	(175)	(16)	(24)
Arrow Electronics Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(17)	(2)	(3)
Ascendas Real Estate Investment Trust	Singapour	Biens immobiliers	(3 100)	(8)	(8)
Ascendis Pharma AS, CAAE	Danemark	Soins de santé	(95)	(12)	(12)
Aspen Technology Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(85)	(24)	(24)
ASX Ltd.	Australie	Services financiers	(382)	(24)	(19)
AutoStore Holdings Ltd.	Bermudes	Produits industriels	(2 232)	(6)	(4)
Avantor Inc.	États-Unis	Soins de santé	(605)	(23)	(17)
Avis Budget Group Inc.	États-Unis	Produits industriels	(77)	(19)	(19)
Azelis Group NV	Belgique	Produits industriels	(227)	(7)	(6)
Bachem Holding AG	Suisse	Soins de santé	(147)	(14)	(15)
Badger Meter Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(14)	(3)	(3)
Balchem Corp.	États-Unis	Matériaux	(84)	(15)	(14)
Banque Cantonale Vaudoise	Suisse	Services financiers	(126)	(15)	(18)
Société aurifère Barrick	Canada	Matériaux	(198)	(4)	(4)
Baytex Energy Corp.	Canada	Énergie	(65 000)	(292)	(389)
BCE Inc.	Canada	Services de communication	(93)	(6)	(5)
Beijer Ref AB	Suède	Produits industriels	(1 481)	(25)	(21)
Bill.com Holdings Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(593)	(87)	(87)
Bio-Techne Corp.	États-Unis	Soins de santé	(14)	(2)	(1)
Birchcliff Energy Ltd.	Canada	Énergie	(60 000)	(311)	(464)
Boliden AB	Suède	Matériaux	(216)	(8)	(8)
Bolloré SA	France	Services de communication	(1 168)	(9)	(9)
Bonterra Energy Corp.	Canada	Énergie	(24 200)	(74)	(181)
Brown & Brown Inc.	États-Unis	Services financiers	(217)	(17)	(21)
Brown-Forman Corp., cat. B, sans droit de vote	États-Unis	Consommation de base	(74)	(6)	(6)
Bunge Ltd.	États-Unis	Consommation de base	(164)	(20)	(24)
Burlington Stores Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(28)	(8)	(5)
Fonds de placement immobilier d'immeubles résidentiels canadien	Canada	Biens immobiliers	(204)	(10)	(9)
Banque Canadienne Impériale de Commerce	Canada	Services financiers	(363)	(25)	(19)
Canadian Pacific Kansas City Ltd.	Canada	Produits industriels	(230)	(21)	(23)
Canadian Utilities Ltd., cat. A, sans droit de vote	Canada	Services publics	(760)	(24)	(22)
CapitaLand Investment Ltd.	Singapour	Biens immobiliers	(400)	(2)	(1)
Cardlytics Inc.	États-Unis	Services de communication	(3 290)	(58)	(74)
Casella Waste Systems Inc., cat. A	États-Unis	Produits industriels	(146)	(16)	(15)
CCC Intelligent Solutions Holdings Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(969)	(13)	(18)
CDW Corp. of Delaware	États-Unis	Technologie de l'information	(85)	(19)	(23)
Celsius Holdings Inc.	États-Unis	Consommation de base	(93)	(10)	(22)
Cenovus Energy Inc.	Canada	Énergie	(860)	(20)	(24)
Chart Industries Inc.	États-Unis	Produits industriels	(101)	(16)	(23)
Check Point Software Technologies Ltd.	Israël	Technologie de l'information	(18)	(3)	(3)
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix	Canada	Biens immobiliers	(1 044)	(14)	(13)

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>POSITIONS VENDEUR (suite)</b>					
<b>ACTIONS (suite)</b>					
Church & Dwight Co. Inc.	États-Unis	Consommation de base	(14)	(2)	(2)
Churchill Downs Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(140)	(22)	(22)
Civitas Resources Inc.	États-Unis	Énergie	(112)	(8)	(12)
CNX Resources Corp.	États-Unis	Énergie	(8 400)	(181)	(257)
Coherent Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	(342)	(16)	(15)
Coinbase Global Inc.	États-Unis	Services financiers	(710)	(62)	(72)
Columbia Sportswear Co.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(168)	(20)	(17)
Commerce Bancshares Inc.	États-Unis	Services financiers	(314)	(23)	(20)
Commonwealth Bank of Australia	Australie	Services financiers	(305)	(27)	(26)
Computershare Ltd.	Australie	Produits industriels	(169)	(3)	(4)
ConocoPhillips	États-Unis	Énergie	(1 600)	(163)	(260)
CONSOL Energy Inc.	États-Unis	Énergie	(620)	(56)	(88)
CoStar Group Inc.	États-Unis	Biens immobiliers	(208)	(21)	(22)
Crédit Agricole SA	France	Services financiers	(1 053)	(19)	(18)
Crescent Point Energy Corp.	Canada	Énergie	(17 739)	(203)	(200)
Crocs Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(93)	(14)	(11)
Cullen/Frost Bankers Inc.	États-Unis	Services financiers	(154)	(22)	(19)
Cutera Inc.	États-Unis	Soins de santé	(5 230)	(92)	(43)
Dai Nippon Printing Co. Ltd.	Japon	Produits industriels	(700)	(19)	(25)
Darling Ingredients Inc.	États-Unis	Consommation de base	(36)	(3)	(3)
DBS Group Holdings Ltd.	Singapour	Services financiers	(900)	(27)	(30)
Delivery Hero AG	Corée du Sud	Consommation discrétionnaire	(459)	(22)	(18)
Deutsche Börse AG	Allemagne	Services financiers	(116)	(23)	(27)
DiaSorin SPA	Italie	Soins de santé	(55)	(8)	(7)
Dollar General Corp.	États-Unis	Consommation de base	(123)	(31)	(18)
Dollar Tree Inc.	États-Unis	Consommation de base	(117)	(21)	(17)
Dominion Resources Inc.	États-Unis	Services publics	(88)	(7)	(5)
Domino's Pizza Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(15)	(7)	(8)
DraftKings Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(449)	(13)	(18)
Eli Lilly and Co.	États-Unis	Soins de santé	(4)	(3)	(3)
Elia System Operator SA/NV	Belgique	Services publics	(75)	(14)	(10)
Elisa OYJ	Finlande	Services de communication	(77)	(6)	(5)
Emera Inc.	Canada	Services publics	(81)	(4)	(4)
EMS-CHEMIE HOLDING AG	Suisse	Matériaux	(17)	(22)	(16)
Enbridge Inc.	Canada	Énergie	(5 000)	(231)	(225)
Endeavour Group Ltd.	Australie	Consommation de base	(5 371)	(31)	(25)
Enerplus Corp.	Canada	Énergie	(15 000)	(236)	(359)
Enphase Energy Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(133)	(24)	(22)
Entegris Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(58)	(6)	(7)
Enviva Partners LP	États-Unis	Énergie	(6 830)	(110)	(69)
EOG Resources Inc.	États-Unis	Énergie	(2 300)	(267)	(396)
EQT AB	Suède	Services financiers	(231)	(7)	(6)
Equinor ASA	Norvège	Énergie	(7 500)	(177)	(334)
Equity Lifestyle Properties Inc.	États-Unis	Biens immobiliers	(246)	(26)	(21)
Erie Indemnity Co., cat. A	États-Unis	Services financiers	(54)	(13)	(22)
Essential Utilities Inc.	États-Unis	Services publics	(442)	(24)	(21)
Euronext NV	Pays-Bas	Services financiers	(74)	(9)	(7)
Expeditors International of Washington Inc.	États-Unis	Produits industriels	(134)	(19)	(21)
Exponent Inc.	États-Unis	Produits industriels	(58)	(7)	(7)
Exxon Mobil Corp.	États-Unis	Énergie	(2 589)	(226)	(413)
Fabrinet	Thaïlande	Technologie de l'information	(25)	(5)	(6)
FactSet Research Systems Inc.	États-Unis	Services financiers	(11)	(6)	(7)
Fastenal Co.	États-Unis	Produits industriels	(313)	(23)	(23)
FinecoBank Banca Fineco SPA	Italie	Services financiers	(1 143)	(22)	(19)
First Financial Bankshares Inc.	États-Unis	Services financiers	(379)	(20)	(13)
First Quantum Minerals Ltd.	Zambie	Matériaux	(118)	(4)	(4)
First Solar Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(100)	(19)	(22)
Five Below Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(104)	(26)	(23)
Fiverr International Ltd.	Israël	Produits industriels	(1 910)	(77)	(63)
Fluence Energy Inc.	États-Unis	Produits industriels	(44)	(2)	(1)
Fortescue Metals Group Ltd.	Australie	Matériaux	(1 289)	(22)	(23)

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>POSITIONS VENDEUR (suite)</b>					
<b>ACTIONS (suite)</b>					
Fortum OYJ	Finlande	Services publics	(1 337)	(23)	(21)
Franco-Nevada Corp.	Canada	Matériaux	(87)	(15)	(16)
FTI Consulting Inc.	États-Unis	Produits industriels	(35)	(9)	(8)
GameStop Corp., cat. A	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(168)	(4)	(4)
Garmin Ltd.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(158)	(27)	(23)
Gen Digital Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(305)	(10)	(7)
Generac Holdings Inc.	États-Unis	Produits industriels	(134)	(25)	(20)
GlobalFoundries Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(263)	(20)	(21)
Goodman Group	Australie	Biens immobiliers	(1 638)	(34)	(31)
Gran Tierra Energy Inc.	Canada	Énergie	(8 300)	(142)	(78)
Hasbro Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(132)	(12)	(12)
Healthcare Realty Trust Inc.	États-Unis	Biens immobiliers	(183)	(5)	(4)
Helmerich & Payne Inc.	États-Unis	Énergie	(4 000)	(173)	(229)
Hertz Global Holdings Inc.	États-Unis	Produits industriels	(100)	(2)	(2)
Hess Corp.	États-Unis	Énergie	(2 400)	(167)	(498)
Hitachi Ltd.	Japon	Produits industriels	(400)	(29)	(34)
Home REIT PLC	Royaume-Uni	Biens immobiliers	(27 939)	(49)	(9)
Hongkong Land Holdings Ltd.	Hong Kong	Biens immobiliers	(2 100)	(10)	(10)
Hormel Foods Corp.	États-Unis	Consommation de base	(372)	(21)	(19)
HP Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(248)	(10)	(9)
ICON PLC	États-Unis	Soins de santé	(94)	(25)	(31)
IDACORP Inc.	États-Unis	Services publics	(144)	(20)	(18)
ImmunoGen Inc.	États-Unis	Soins de santé	(344)	(8)	(7)
Industrie De Nora SPA	Italie	Produits industriels	(140)	(4)	(3)
Indutrade AB	Suède	Produits industriels	(473)	(13)	(12)
Insight Enterprises Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(74)	(14)	(15)
Interactive Brokers Group Inc.	États-Unis	Services financiers	(171)	(17)	(20)
Intra-Cellular Therapies Inc.	États-Unis	Soins de santé	(297)	(24)	(21)
Investec PLC	Afrique du Sud	Services financiers	(1 707)	(13)	(14)
Investment AB Latour	Suède	Produits industriels	(75)	(3)	(2)
IonQ Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(2 910)	(53)	(59)
iRhythm Technologies Inc.	États-Unis	Soins de santé	(560)	(66)	(72)
ITOCHU Corp.	Japon	Produits industriels	(600)	(23)	(29)
Jack Henry & Associates Inc.	États-Unis	Services financiers	(103)	(21)	(21)
JDE Peet's BV	Pays-Bas	Consommation de base	(356)	(13)	(13)
Joby Aviation Inc.	États-Unis	Produits industriels	(1 539)	(16)	(13)
Karuna Therapeutics Inc.	États-Unis	Soins de santé	(49)	(14)	(11)
Kawasaki Kisen Kaisha Ltd.	Japon	Produits industriels	(350)	(8)	(16)
KDDI Corp.	Japon	Services de communication	(200)	(8)	(8)
Keio Corp.	Japon	Produits industriels	(100)	(6)	(5)
Kesko OYJ, cat. B	Finlande	Consommation de base	(483)	(19)	(12)
Kikkoman Corp.	Japon	Consommation de base	(200)	(20)	(14)
Kinsale Capital Group Inc.	États-Unis	Services financiers	(45)	(13)	(25)
Kintetsu Corp.	Japon	Produits industriels	(500)	(23)	(19)
KKR & Co. LP	États-Unis	Services financiers	(290)	(18)	(24)
Kobayashi Pharmaceutical Co. Ltd.	Japon	Consommation de base	(100)	(10)	(6)
Kobe Bussan Co. Ltd.	Japon	Consommation de base	(700)	(31)	(22)
Kubota Corp.	Japon	Produits industriels	(800)	(23)	(16)
Kura Sushi USA Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(680)	(85)	(61)
L E Lundbergföretagen AB, cat. B	Suède	Services financiers	(150)	(10)	(8)
Lancaster Colony Corp.	États-Unis	Consommation de base	(23)	(6)	(5)
Laredo Petroleum Holdings Inc.	États-Unis	Énergie	(910)	(88)	(68)
Lattice Semiconductor Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	(42)	(5)	(5)
Liberty Broadband Corp.	États-Unis	Services de communication	(179)	(30)	(22)
Logan Energy Corp. CA	Canada	Énergie	(12 739)	(4)	(13)
Lucid Group Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(2 037)	(18)	(15)
Macquarie Group Ltd.	Australie	Services financiers	(125)	(20)	(18)
MarketAxess Holdings Inc.	États-Unis	Services financiers	(76)	(26)	(22)
Marubeni Corp.	Japon	Produits industriels	(500)	(11)	(11)
Matador Resources Co.	États-Unis	Énergie	(4 894)	(197)	(395)
Medpace Holdings Inc.	États-Unis	Soins de santé	(69)	(17)	(23)

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>POSITIONS VENDEUR (suite)</b>					
<b>ACTIONS (suite)</b>					
Meritor Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(204)	(15)	(15)
MicroStrategy Inc., cat. A	États-Unis	Technologie de l'information	(160)	(82)	(71)
Mitsui & Co. Ltd.	Japon	Produits industriels	(600)	(30)	(30)
Mitsui O.S.K. Lines Ltd.	Japon	Produits industriels	(600)	(20)	(22)
Moderna Inc.	États-Unis	Soins de santé	(47)	(10)	(7)
Mondi PLC	Afrique du Sud	Matériaux	(919)	(20)	(21)
Montrose Environmental Group Inc.	États-Unis	Produits industriels	(1 490)	(67)	(59)
Morgan Stanley	États-Unis	Services financiers	(178)	(22)	(20)
Mowi ASA	Norvège	Consommation de base	(541)	(13)	(13)
MSA Safety Inc.	États-Unis	Produits industriels	(64)	(14)	(14)
Nabors Industries Ltd.	États-Unis	Énergie	(460)	(77)	(77)
National Australia Bank Ltd.	Australie	Services financiers	(406)	(11)	(10)
Banque Nationale du Canada	Canada	Services financiers	(322)	(31)	(29)
National Beverage Corp.	États-Unis	Consommation de base	(170)	(10)	(11)
Neogen Corp.	États-Unis	Soins de santé	(86)	(3)	(2)
Neste Oil OYJ	Finlande	Énergie	(72)	(4)	(3)
New Fortress Energy Inc.	États-Unis	Énergie	(518)	(20)	(23)
Newell Brands Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(1 387)	(25)	(17)
Nexi SPA	Italie	Services financiers	(2 174)	(29)	(18)
NIBE Industrier AB	Suède	Produits industriels	(764)	(7)	(7)
Nintendo Co. Ltd.	Japon	Services de communication	(100)	(6)	(6)
Northland Power Inc.	Canada	Services publics	(547)	(20)	(12)
NOV Inc.	États-Unis	Énergie	(11 700)	(185)	(332)
Novanta Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(84)	(19)	(16)
NOW Inc.	États-Unis	Produits industriels	(18 400)	(247)	(296)
Nutrien Ltd.	Canada	Matériaux	(360)	(36)	(30)
NuVista Energy Ltd.	Canada	Énergie	(20 700)	(238)	(269)
Obsidian Energy Ltd.	Canada	Énergie	(13 000)	(109)	(145)
Occidental Petroleum Corp.	États-Unis	Énergie	(5 000)	(194)	(440)
Odakyu Electric Railway Co. Ltd.	Japon	Produits industriels	(1 100)	(26)	(22)
Omega Healthcare Investors Inc.	États-Unis	Biens immobiliers	(374)	(14)	(17)
On Holding AG	Suisse	Consommation discrétionnaire	(245)	(6)	(9)
ON Semiconductor Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	(172)	(12)	(22)
ONEOK Inc.	États-Unis	Énergie	(4 200)	(272)	(362)
Oracle Corp. Japan	Japon	Technologie de l'information	(100)	(10)	(10)
Packaging Corp. of America	États-Unis	Matériaux	(119)	(20)	(25)
Pan Pacific International Holdings Corp.	Japon	Consommation discrétionnaire	(1 100)	(24)	(31)
Paycor HCM Inc.	États-Unis	Produits industriels	(387)	(13)	(12)
PBF Energy Inc.	États-Unis	Énergie	(2 486)	(11)	(181)
Pioneer Natural Resources Co.	États-Unis	Énergie	(1 000)	(258)	(312)
Plug Power Inc.	États-Unis	Produits industriels	(1 985)	(33)	(20)
PointsBet Holdings Ltd., bons de souscription éch. 08-07-2024	Australie	Consommation discrétionnaire	(516)	-	-
Polestar Automotive Holding UK PLC	Hong Kong	Consommation discrétionnaire	(749)	(4)	(3)
Polo Ralph Lauren Corp., cat. A	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(43)	(7)	(7)
Pool Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(41)	(22)	(20)
PowerSchool Holdings Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(378)	(12)	(12)
Prosperity Bancshares Inc.	États-Unis	Services financiers	(249)	(20)	(18)
Prosus NV	Pays-Bas	Consommation discrétionnaire	(683)	(28)	(27)
Range Resources Corp.	États-Unis	Énergie	(2 800)	(50)	(123)
Raymond James Financial Inc.	États-Unis	Services financiers	(135)	(17)	(18)
RBC Bearings Inc.	États-Unis	Produits industriels	(67)	(17)	(21)
REA Group Ltd.	Australie	Services de communication	(163)	(18)	(22)
Reece Ltd.	Australie	Produits industriels	(647)	(10)	(11)
Regal Rexnord Corp.	États-Unis	Produits industriels	(110)	(23)	(21)
Remitly Global Inc.	États-Unis	Services financiers	(483)	(17)	(17)
Rémy Cointreau SA	France	Consommation de base	(120)	(24)	(20)
RenaissanceRe Holdings Ltd.	Bermudes	Services financiers	(16)	(3)	(4)
Resona Holdings Inc.	Japon	Services financiers	(4 200)	(26)	(32)
RH	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(48)	(21)	(17)
Rio Tinto Ltd.	Australie	Matériaux	(109)	(10)	(11)
Rivian Automotive Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(2 993)	(91)	(99)

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>POSITIONS VENDEUR (suite)</b>					
<b>ACTIONS (suite)</b>					
RLI Corp.	États-Unis	Services financiers	(99)	(14)	(18)
Robert Half International Inc.	États-Unis	Produits industriels	(41)	(4)	(4)
Roivant Sciences Ltd.	États-Unis	Soins de santé	(669)	(8)	(11)
Rollins Inc.	États-Unis	Produits industriels	(55)	(2)	(3)
Banque Royale du Canada	Canada	Services financiers	(190)	(23)	(23)
Royal Gold Inc.	États-Unis	Matériaux	(70)	(11)	(10)
Royalty Pharma PLC	États-Unis	Soins de santé	(391)	(19)	(14)
Ryan Specialty Holdings Inc.	États-Unis	Services financiers	(245)	(16)	(16)
Sagax AB, cat. B	Suède	Biens immobiliers	(506)	(15)	(13)
Saia Inc.	États-Unis	Produits industriels	(44)	(17)	(24)
Salmar ASA	Norvège	Consommation de base	(282)	(14)	(19)
Santos Ltd.	Australie	Énergie	(1 576)	(10)	(11)
Sartorius Stedim Biotech SA	France	Soins de santé	(59)	(23)	(19)
SBA Communications Corp., cat. A	États-Unis	Biens immobiliers	(26)	(8)	(7)
Schroders PLC	Royaume-Uni	Services financiers	(2 546)	(20)	(17)
Sea Ltd.	Singapour	Services de communication	(242)	(23)	(14)
Sempra Energy	États-Unis	Services publics	(226)	(23)	(21)
SentinelOne Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(3 230)	(65)	(74)
SG Holdings Co. Ltd.	Japon	Produits industriels	(500)	(14)	(9)
Shift4 Payments Inc.	États-Unis	Services financiers	(146)	(12)	(11)
Shimano Inc.	Japon	Consommation discrétionnaire	(100)	(23)	(18)
Shopify Inc., cat. A	Canada	Technologie de l'information	(358)	(19)	(27)
SilverBow Resources Inc.	États-Unis	Énergie	(1 350)	(60)	(66)
SiTime Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	(440)	(73)	(68)
SIXT SE	Allemagne	Produits industriels	(24)	(3)	(3)
Skechers USA Inc., cat. A	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(65)	(3)	(4)
SM Energy Co.	États-Unis	Énergie	(4 936)	(240)	(266)
SoFi Technologies Inc.	États-Unis	Services financiers	(1 110)	(9)	(12)
SOITEC	France	Technologie de l'information	(87)	(17)	(20)
SolarEdge Technologies Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(408)	(100)	(72)
Southwest Airlines Co.	États-Unis	Produits industriels	(60)	(3)	(2)
Southwestern Energy Co.	États-Unis	Énergie	(23 943)	(118)	(210)
Spartan Delta Corp.	Canada	Énergie	(20 000)	(195)	(81)
SPS Commerce Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(81)	(16)	(19)
Square Enix Holdings Co. Ltd.	Japon	Services de communication	(500)	(30)	(23)
STERIS PLC	États-Unis	Soins de santé	(82)	(23)	(24)
Suncor Énergie Inc.	Canada	Énergie	(5 005)	(213)	(234)
Sunnova Energy International Inc.	États-Unis	Services publics	(4 100)	(103)	(58)
Sunrun Inc.	États-Unis	Produits industriels	(3 700)	(94)	(63)
Super Micro Computer Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(252)	(77)	(94)
Surge Energy Inc.	Canada	Énergie	(22 000)	(209)	(204)
Svenska Cellulosa AB (SCA), B	Suède	Matériaux	(1 375)	(25)	(26)
Sweetgreen Inc., cat. A	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(3 940)	(79)	(63)
Swisscom AG, nom.	Suisse	Services de communication	(34)	(23)	(27)
Synnex Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	(135)	(18)	(18)
Corporation TC Énergie	Canada	Énergie	(5 600)	(279)	(263)
Technoprobe SPA	Italie	Technologie de l'information	(634)	(7)	(7)
Tesla Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(290)	(90)	(99)
Texas Roadhouse Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(89)	(13)	(12)
The Bank of Kyoto Ltd.	Japon	Services financiers	(200)	(16)	(15)
La Banque de Nouvelle-Écosse	Canada	Services financiers	(471)	(31)	(29)
The Berkeley Group Holdings PLC	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	(270)	(14)	(18)
The Chiba Bank Ltd.	Japon	Services financiers	(2 500)	(22)	(25)
The Cooper Companies Inc.	États-Unis	Soins de santé	(43)	(22)	(19)
The Home Depot Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(16)	(6)	(7)
The New York Times Co., cat. A	États-Unis	Services de communication	(87)	(4)	(5)
Toast Inc.	États-Unis	Services financiers	(880)	(26)	(22)
Tokyo Electric Power Co. Holdings Inc.	Japon	Services publics	(5 300)	(25)	(32)
TOMRA Systems ASA	Norvège	Produits industriels	(694)	(14)	(11)
Topicus.com Inc.	Canada	Technologie de l'information	(90)	(9)	(8)
Total SA	France	Énergie	(316)	(21)	(28)



# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## APERÇU DU PORTEFEUILLE

30 SEPTEMBRE 2023

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Trésorerie et équivalents de trésorerie *	32,1	–	32,1
Autres éléments d'actif (de passif)	2,4	23,9	26,3
Actions	50,2	(26,5)	23,7
<i>Actions</i>	46,5	(23,7)	22,8
<i>Options achetées</i>	0,7	–	0,7
<i>Contrats à terme standardisés</i>	3,0	(2,7)	0,3
<i>Options vendues</i>	–	(0,1)	(0,1)
Obligations	38,3	(21,8)	16,5
<i>Obligations</i>	22,9	(1,6)	21,3
<i>Options achetées</i>	0,1	–	0,1
<i>Contrats à terme standardisés</i>	15,3	(20,2)	(4,9)
Contrats à terme standardisés sur marchandises	1,7	(0,6)	1,1
Fonds privés	0,3	–	0,3
Swaps	–	–	–
Fonds/billets négociés en bourse	0,3	(0,3)	–
Options sur swaps achetées	–	–	–

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Trésorerie et équivalents de trésorerie *	32,1	–	32,1
Autres éléments d'actif (de passif)	2,4	23,9	26,3
Canada	27,4	(10,6)	16,8
États-Unis	33,9	(21,2)	12,7
Chine	11,6	–	11,6
Allemagne	3,1	(0,1)	3,0
Australie	2,6	(0,7)	1,9
Autre	2,8	(1,2)	1,6
France	1,6	(0,2)	1,4
Brésil	1,3	–	1,3
Pays-Bas	1,1	(0,1)	1,0
Royaume-Uni	2,0	(1,2)	0,8
Ghana	0,5	–	0,5
Israël	0,5	(0,1)	0,4
Italie	0,5	(0,1)	0,4
Luxembourg	0,4	–	0,4
Suisse	0,8	(0,5)	0,3
Mexique	–	(0,2)	(0,2)
Afrique du Sud	–	(0,4)	(0,4)
Norvège	–	(0,7)	(0,7)
Japon	0,7	(11,9)	(11,2)

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Trésorerie et équivalents de trésorerie *	32,1	–	32,1
Autres éléments d'actif (de passif)	2,4	23,9	26,3
Obligations de sociétés	22,2	(1,6)	20,6
Énergie	24,3	(14,0)	10,3
Consommation discrétionnaire	4,4	(1,4)	3,0
Obligations fédérales	6,9	(4,4)	2,5
Produits industriels	4,2	(2,0)	2,2
Consommation de base	2,3	(0,4)	1,9
Services de communication	2,1	(0,5)	1,6
Autre	2,0	(0,7)	1,3
Contrats à terme standardisés sur marchandises	1,7	(0,6)	1,1
Services publics	1,6	(0,5)	1,1
Services financiers	2,7	(1,7)	1,0
Technologie de l'information	2,8	(1,9)	0,9
Soins de santé	1,1	(0,7)	0,4
Fonds privés	0,3	–	0,3
Contrats à terme standardisés sur actions	3,0	(2,7)	0,3
Fonds/billets négociés en bourse	0,3	(0,3)	–
Obligations d'État étrangères	8,9	(15,8)	(6,9)

31 MARS 2023

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Trésorerie et placements à court terme *	39,5	–	39,5
Autres éléments d'actif (de passif)	3,4	24,3	27,7
Actions	49,8	(33,9)	15,9
<i>Actions</i>	46,5	(29,0)	17,5
<i>Contrats à terme standardisés</i>	2,9	(4,8)	(1,9)
<i>Options achetées</i>	0,4	–	0,4
<i>Options vendues</i>	–	(0,1)	(0,1)
Obligations	35,3	(21,0)	14,3
<i>Obligations</i>	31,0	(1,1)	29,9
<i>Contrats à terme standardisés</i>	4,2	(19,9)	(15,7)
<i>Options achetées</i>	0,1	–	0,1
<i>Options vendues</i>	–	–	–
Contrats à terme standardisés sur marchandises	1,8	(0,3)	1,5
Fonds/billets négociés en bourse	1,1	(0,2)	0,9
Swaps	–	–	–
Fonds privés	0,2	–	0,2

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Trésorerie et placements à court terme *	39,5	–	39,5
Autres éléments d'actif (de passif)	3,4	24,3	27,7
Canada	26,1	(8,1)	18,0
Chine	12,4	(0,4)	12,0
États-Unis	31,9	(22,4)	9,5
Australie	3,5	–	3,5
France	1,7	(0,2)	1,5
Brésil	1,1	–	1,1
Pays-Bas	1,2	(0,1)	1,1
Espagne	0,7	–	0,7
Royaume-Uni	1,8	(1,3)	0,5
Afrique du Sud	0,5	–	0,5
Italie	0,4	–	0,4
Luxembourg	0,4	–	0,4
Mexique	–	(0,4)	(0,4)
Autre	5,0	(5,5)	(0,5)
Norvège	–	(0,6)	(0,6)
Allemagne	0,3	(3,0)	(2,7)
Japon	1,2	(13,4)	(12,2)

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Trésorerie et placements à court terme *	39,5	–	39,5
Autres éléments d'actif (de passif)	3,4	24,3	27,7
Obligations de sociétés	28,7	(1,1)	27,6
Énergie	18,9	(13,9)	5,0
Technologie de l'information	5,4	(2,6)	2,8
Consommation discrétionnaire	4,8	(2,3)	2,5
Soins de santé	4,0	(1,5)	2,5
Obligations d'État étrangères	1,7	–	1,7
Services de communication	2,3	(0,6)	1,7
Contrats à terme standardisés sur marchandises	1,8	(0,3)	1,5
Consommation de base	2,0	(0,8)	1,2
Produits industriels	3,0	(2,0)	1,0
Autre	1,0	–	1,0
Fonds/billets négociés en bourse	1,1	(0,2)	0,9
Services financiers	2,5	(2,0)	0,5
Biens immobiliers	1,4	(1,0)	0,4
Services publics	0,9	(0,7)	0,2
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,2	–	0,2
Énergie	–	(0,1)	(0,1)
Matériaux	1,4	(1,6)	(0,2)
Contrats à terme standardisés sur actions	2,9	(4,8)	(1,9)
Obligations – Contrats à terme standardisés	4,2	(19,9)	(15,7)

\* Une portion de la répartition effective de la trésorerie du Fonds est investie dans des titres de série R d'un fonds du marché monétaire géré par Mackenzie. La répartition effective présente l'exposition du Fonds par portefeuille, région ou secteur calculée en combinant les placements directs et indirects du Fonds.

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF	475	Vente	17 novembre 2023	73,00 USD	48	44
Indice Markit North American Investment Grade CDX	434 000	Vente	20 décembre 2023	100,00 USD	1	–
Indice S&P 500	4	Vente	21 juin 2024	4 000,00 USD	77	66
Indice S&P 500	14	Vente	20 septembre 2024	4 175,00 USD	272	374
<b>Total des options</b>					<b>398</b>	<b>484</b>

## TABLEAU DES OPTIONS VENDUES

au 30 septembre 2023

Élément sous-jacent	Nombre de contrats	Type d'option	Date d'échéance	Prix d'exercice \$	Prime reçue (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
Chevron Corp.	(40)	Option d'achat vendue	20 octobre 2023	75,00 USD	(26)	(11)
Northern Oil and Gas Inc.	(60)	Option d'achat vendue	20 octobre 2023	38,00 USD	(18)	(22)
Ovintiv Inc.	(30)	Option d'achat vendue	20 octobre 2023	43,00 USD	(8)	(21)
Devon Energy Corp.	(30)	Option d'achat vendue	17 novembre 2023	57,50 USD	(8)	(1)
The Williams Companies Inc.	(46)	Option d'achat vendue	16 février 2024	34,00 USD	(6)	(12)
<b>Total des options</b>					<b>(66)</b>	<b>(67)</b>

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS

au 30 septembre 2023

### Tableau des contrats de swap

Note de crédit de la contrepartie	Nombre de contrats	Échéance	Rendement payé par le Fonds, en fonction de	Rendement reçu par le Fonds, en fonction de	Montant notionnel (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
AA	(6 700)	20 octobre 2023	Swap sur rendement excédentaire sur indice des produits de base 0,68 %	Trésorerie	1 868	–	(16)
A	51 831	25 octobre 2023	Taux CAD-CORRA à 1 jour majoré de 0,61 %	FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	3 994	–	–
<b>Total des contrats de swap</b>					<b>5 862</b>	<b>–</b>	<b>(16)</b>

### Tableau des contrats à terme standardisés

Type de contrat	Nombre de contrats	Date d'échéance	Prix moyen des contrats (\$)	Montant notionnel* (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
Contrats à terme standardisés sur l'indice IBEX 35, octobre 2023	1	20 octobre 2023	9 345,00 EUR	135	1	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice OMXS30, octobre 2023	1	20 octobre 2023	2 184,10 SEK	27	–	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE China A50, octobre 2023	2	30 octobre 2023	12 515,49 USD	34	–	–
Contrats à terme standardisés sur euro-obligations, décembre 2023	10	7 décembre 2023	130,69 EUR	1 846	–	(55)
Contrats à terme standardisés libellés en yens sur l'indice Nikkei 225, décembre 2023	(1)	7 décembre 2023	32 275,00 JPY	(145)	2	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans de moindre valeur, décembre 2023	(2)	12 décembre 2023	145,91 JPY	(263)	2	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans, décembre 2023	(5)	13 décembre 2023	146,17 JPY	(6 584)	52	–
Contrats à terme standardisés sur le maïs, décembre 2023	2	14 décembre 2023	487,67 USD	65	–	(1)
Contrats à terme standardisés sur le blé RVH de KC, décembre 2023	(3)	14 décembre 2023	768,98 USD	(135)	21	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice S&P/TSX 60, décembre 2023	(1)	14 décembre 2023	1 211,34 CAD	(235)	7	–
Contrats à terme standardisés sur la farine de soja, décembre 2023	2	14 décembre 2023	389,75 USD	103	–	(2)
Contrats à terme standardisés sur l'huile de soja, décembre 2023	(2)	14 décembre 2023	58,89 USD	(91)	5	–
Contrats à terme standardisés sur le blé (CBT), décembre 2023	3	14 décembre 2023	601,88 USD	110	–	(12)
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor australien à 10 ans, décembre 2023	15	15 décembre 2023	113,65 AUD	1 467	–	(35)
Contrats à terme standardisés sur l'indice CME E-Mini Standard & Poor's 500, décembre 2023	5	15 décembre 2023	4 409,80 USD	1 468	–	(9)
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-Mini NASDAQ 100, décembre 2023	(1)	15 décembre 2023	15 477,75 USD	(404)	17	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice Euro STOXX 50, décembre 2023	(4)	15 décembre 2023	4 226,83 EUR	(240)	3	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE/MIB 100, décembre 2023	1	15 décembre 2023	28 785,00 EUR	203	–	(4)
Contrats à terme standardisés sur l'indice Bolsa Mexicana, décembre 2023	(3)	15 décembre 2023	52 963,90 MXN	(121)	3	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice MSCI Marchés émergents, décembre 2023	(1)	15 décembre 2023	956,90 USD	(65)	–	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice Swiss Market, décembre 2023	(1)	15 décembre 2023	10 991,00 CHF	(163)	–	–
Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 10 ans, décembre 2023	(24)	18 décembre 2023	117,44 CAD	(2 763)	67	–
Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 2 ans, décembre 2023	42	18 décembre 2023	102,19 CAD	4 277	–	(14)
Contrats à terme standardisés sur l'aluminium LME, décembre 2023	1	18 décembre 2023	2 199,75 USD	80	5	–
Contrats à terme standardisés sur le plomb LME, décembre 2023	(1)	18 décembre 2023	2 220,00 USD	(74)	2	–

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2023

### Tableau des contrats à terme standardisés (suite)

Type de contrat	Nombre de contrats	Date d'échéance	Prix moyen des contrats (\$)	Montant notionnel* (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
Contrats à terme standardisés sur le zinc LME, décembre 2023	(1)	18 décembre 2023	2 481,00 USD	(90)	–	(6)
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor américain à 10 ans, décembre 2023	(17)	19 décembre 2023	109,87 USD	(2 494)	44	–
Contrats à terme standardisés à très long terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans, décembre 2023	3	19 décembre 2023	116,10 USD	454	–	(18)
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE/JSE Top 40, décembre 2023	(4)	21 décembre 2023	69 050,65 ZAR	(194)	5	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice SPI 200, décembre 2023	(1)	21 décembre 2023	7 079,00 AUD	(155)	–	–
Contrats à terme standardisés sur l'or, 100 oz, décembre 2023	3	27 décembre 2023	2 020,93 USD	760	–	(63)
Contrats à terme standardisés sur obligations du Royaume-Uni, décembre 2023	(4)	27 décembre 2023	94,33 GBP	(624)	2	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor américain à 5 ans, décembre 2023	11	29 décembre 2023	106,22 USD	1 573	–	(13)
Contrats à terme standardisés sur le sucre n° 11 (monde), mars 2024	(1)	29 février 2024	26,57 USD	(40)	–	–
<b>Total des contrats à terme standardisés</b>				<b>(2 278)</b>	<b>238</b>	<b>(232)</b>

\* 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

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 \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	9 USD	(18) AUD	3 octobre 2023	(12)	(12)	–	–
A	18 AUD	(9) USD	3 octobre 2023	12	12	–	–
A	21 CAD	(12) USD	3 octobre 2023	(15)	(15)	–	–
A	12 USD	(21) CAD	3 octobre 2023	15	15	–	–
A	24 USD	(28) CHF	3 octobre 2023	(32)	(30)	2	–
A	28 CHF	(23) USD	3 octobre 2023	31	31	–	–
A	10 USD	(12) EUR	3 octobre 2023	(13)	(13)	–	–
A	12 EUR	(10) USD	3 octobre 2023	13	13	–	–
A	94 GBP	(88) USD	3 octobre 2023	119	113	–	(6)
A	85 USD	(94) GBP	3 octobre 2023	(115)	(115)	–	–
A	119 USD	(23 400) JPY	3 octobre 2023	(161)	(155)	6	–
A	23 400 JPY	(116) USD	3 octobre 2023	157	157	–	–
A	50 USD	(720) NOK	3 octobre 2023	(68)	(67)	1	–
A	720 NOK	(50) USD	3 octobre 2023	68	68	–	–
A	87 NZD	(38) USD	3 octobre 2023	52	52	–	–
A	38 USD	(87) NZD	3 octobre 2023	(52)	(52)	–	–
A	130 SEK	(9) USD	3 octobre 2023	12	12	–	–
A	9 USD	(130) SEK	3 octobre 2023	(12)	(12)	–	–
A	11 USD	(21) AUD	19 octobre 2023	(15)	(14)	1	–
A	4 USD	(9) AUD	19 octobre 2023	(6)	(6)	–	–
A	13 AUD	(6) USD	19 octobre 2023	8	8	–	–
A	6 AUD	(3) USD	19 octobre 2023	4	4	–	–
A	19 BRL	(3) USD	19 octobre 2023	4	4	–	–
A	27 BRL	(4) USD	19 octobre 2023	6	6	–	–
A	119 BRL	(18) USD	19 octobre 2023	24	23	–	(1)
A	61 BRL	(9) USD	19 octobre 2023	12	12	–	–
A	27 USD	(48) CAD	19 octobre 2023	36	38	2	–
A	34 USD	(61) CAD	19 octobre 2023	45	47	2	–

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	10 CAD	(6) USD	19 octobre 2023	(8)	(8)	–	–
A	23 CAD	(13) USD	19 octobre 2023	(17)	(18)	–	(1)
A	12 CAD	(7) USD	19 octobre 2023	(9)	(9)	–	–
A	6 CAD	(3) USD	19 octobre 2023	(4)	(4)	–	–
A	3 USD	(6) CAD	19 octobre 2023	4	4	–	–
A	9 CAD	(5) USD	19 octobre 2023	(7)	(7)	–	–
A	5 063 CLP	(4) USD	19 octobre 2023	6	5	–	(1)
A	4 USD	(4 425) CLP	19 octobre 2023	(5)	(4)	1	–
A	16 USD	(160) CNY	19 octobre 2023	(22)	(21)	1	–
A	27 USD	(264) CNY	19 octobre 2023	(37)	(36)	1	–
A	84 CNY	(9) USD	19 octobre 2023	12	12	–	–
A	8 USD	(81) CNY	19 octobre 2023	(11)	(11)	–	–
A	134 CNY	(14) USD	19 octobre 2023	19	18	–	(1)
A	10 USD	(93) CNY	19 octobre 2023	(13)	(13)	–	–
A	51 CNY	(5) USD	19 octobre 2023	7	7	–	–
A	3 USD	(27) CNY	19 octobre 2023	(4)	(4)	–	–
A	28 CNY	(3) USD	19 octobre 2023	4	4	–	–
A	98 CNY	(10) USD	19 octobre 2023	13	13	–	–
A	5 USD	(51) CNY	19 octobre 2023	(7)	(7)	–	–
A	59 246 COP	(10) USD	19 octobre 2023	14	15	1	–
A	61 181 COP	(10) USD	19 octobre 2023	14	15	1	–
A	206 108 COP	(35) USD	19 octobre 2023	48	50	2	–
A	5 USD	(29 945) COP	19 octobre 2023	(7)	(7)	–	–
A	3 USD	(15 787) COP	19 octobre 2023	(4)	(4)	–	–
A	3 USD	(17 926) COP	19 octobre 2023	(4)	(4)	–	–
A	5 USD	(25 851) COP	19 octobre 2023	(7)	(7)	–	–
A	5 USD	(148) CZK	19 octobre 2023	(7)	(6)	1	–
A	7 USD	(198) CZK	19 octobre 2023	(9)	(8)	1	–
A	11 USD	(323) CZK	19 octobre 2023	(15)	(14)	1	–
A	4 USD	(129) CZK	19 octobre 2023	(6)	(6)	–	–
A	142 CZK	(4) USD	19 octobre 2023	6	6	–	–
A	13 EUR	(11) USD	19 octobre 2023	15	14	–	(1)
A	13 EUR	(10) USD	19 octobre 2023	14	13	–	(1)
A	5 EUR	(4) USD	19 octobre 2023	6	5	–	(1)
A	15 USD	(18) EUR	19 octobre 2023	(20)	(19)	1	–
A	5 USD	(7) EUR	19 octobre 2023	(7)	(7)	–	–
A	3 USD	(3) EUR	19 octobre 2023	(4)	(4)	–	–
A	4 EUR	(3) USD	19 octobre 2023	4	4	–	–
A	1 USD	(1) GBP	19 octobre 2023	(2)	(2)	–	–
A	18 USD	(18) GBP	19 octobre 2023	(24)	(22)	2	–
A	4 GBP	(4) USD	19 octobre 2023	5	5	–	–
A	6 GBP	(6) USD	19 octobre 2023	8	8	–	–
A	7 USD	(7) GBP	19 octobre 2023	(9)	(9)	–	–
A	3 USD	(3) GBP	19 octobre 2023	(4)	(4)	–	–
A	4 USD	(4) GBP	19 octobre 2023	(5)	(5)	–	–
A	135 993 IDR	(7) USD	19 octobre 2023	9	9	–	–
A	319 451 IDR	(15) USD	19 octobre 2023	21	20	–	(1)
A	138 908 IDR	(7) USD	19 octobre 2023	9	9	–	–
A	145 038 IDR	(7) USD	19 octobre 2023	10	10	–	–
A	7 USD	(133 905) IDR	19 octobre 2023	(9)	(9)	–	–

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	63 207 IDR	(3) USD	19 octobre 2023	4	4	–	–
A	134 070 IDR	(7) USD	19 octobre 2023	9	9	–	–
A	134 070 IDR	(7) USD	19 octobre 2023	9	9	–	–
A	128 358 IDR	(6) USD	19 octobre 2023	8	8	–	–
A	3 USD	(65 105) IDR	19 octobre 2023	(4)	(4)	–	–
A	29 USD	(145) ILS	19 octobre 2023	(40)	(38)	2	–
A	21 ILS	(4) USD	19 octobre 2023	6	6	–	–
A	20 ILS	(4) USD	19 octobre 2023	5	5	–	–
A	68 INR	(1) USD	19 octobre 2023	1	1	–	–
A	3 216 INR	(29) USD	19 octobre 2023	39	39	–	–
A	336 INR	(3) USD	19 octobre 2023	4	4	–	–
A	486 INR	(4) USD	19 octobre 2023	6	6	–	–
A	11 USD	(1 215) INR	19 octobre 2023	(15)	(15)	–	–
A	3 USD	(318) INR	19 octobre 2023	(4)	(4)	–	–
A	5 USD	(564) INR	19 octobre 2023	(7)	(7)	–	–
A	622 JPY	(3) USD	19 octobre 2023	4	4	–	–
A	67 JPY	– USD	19 octobre 2023	–	–	–	–
A	6 063 JPY	(32) USD	19 octobre 2023	44	39	–	(5)
A	1 442 JPY	(8) USD	19 octobre 2023	11	10	–	(1)
A	4 USD	(653) JPY	19 octobre 2023	(5)	(4)	1	–
A	6 USD	(1 066) JPY	19 octobre 2023	(8)	(7)	1	–
A	559 JPY	(3) USD	19 octobre 2023	4	4	–	–
A	540 JPY	(3) USD	19 octobre 2023	4	4	–	–
A	9 USD	(15 383) KOR	19 octobre 2023	(12)	(11)	1	–
A	6 USD	(10 641) KOR	19 octobre 2023	(8)	(7)	1	–
A	4 USD	(6 559) KOR	19 octobre 2023	(5)	(5)	–	–
A	11 153 KOR	(7) USD	19 octobre 2023	9	9	–	–
A	5 063 KOR	(3) USD	19 octobre 2023	4	4	–	–
A	3 USD	(5 521) KOR	19 octobre 2023	(4)	(4)	–	–
A	248 MXN	(10) USD	19 octobre 2023	14	14	–	–
A	79 MXN	(4) USD	19 octobre 2023	5	5	–	–
A	100 MXN	(4) USD	19 octobre 2023	6	6	–	–
A	4 USD	(80) MXN	19 octobre 2023	(5)	(5)	–	–
A	92 MXN	(4) USD	19 octobre 2023	5	5	–	–
A	4 USD	(80) MXN	19 octobre 2023	(5)	(5)	–	–
A	166 NOK	(12) USD	19 octobre 2023	16	15	–	(1)
A	357 NOK	(26) USD	19 octobre 2023	35	32	–	(3)
A	102 NOK	(7) USD	19 octobre 2023	10	9	–	(1)
A	4 USD	(53) NOK	19 octobre 2023	(5)	(5)	–	–
A	104 NOK	(7) USD	19 octobre 2023	10	9	–	(1)
A	46 NOK	(3) USD	19 octobre 2023	4	4	–	–
A	61 NOK	(4) USD	19 octobre 2023	6	6	–	–
A	81 NOK	(6) USD	19 octobre 2023	8	8	–	–
A	109 NOK	(7) USD	19 octobre 2023	10	10	–	–
A	47 NOK	(3) USD	19 octobre 2023	4	4	–	–
A	16 USD	(35) NZD	19 octobre 2023	(22)	(21)	1	–
A	24 NZD	(11) USD	19 octobre 2023	15	14	–	(1)
A	32 USD	(69) NZD	19 octobre 2023	(44)	(41)	3	–
A	7 NZD	(3) USD	19 octobre 2023	4	4	–	–
A	5 USD	(11) NZD	19 octobre 2023	(7)	(7)	–	–

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	5 USD	(11) NZD	19 octobre 2023	(7)	(7)	–	–
A	7 USD	(17) NZD	19 octobre 2023	(10)	(10)	–	–
A	5 USD	(11) NZD	19 octobre 2023	(7)	(7)	–	–
A	4 USD	(276) PHP	19 octobre 2023	(5)	(5)	–	–
A	24 USD	(1 765) PHP	19 octobre 2023	(32)	(30)	2	–
A	12 USD	(870) PHP	19 octobre 2023	(16)	(15)	1	–
A	517 PHP	(7) USD	19 octobre 2023	10	9	–	(1)
A	5 USD	(390) PHP	19 octobre 2023	(7)	(7)	–	–
A	337 PHP	(4) USD	19 octobre 2023	6	6	–	–
A	4 USD	(354) PHP	19 octobre 2023	(6)	(6)	–	–
A	3 USD	(220) PHP	19 octobre 2023	(4)	(4)	–	–
A	17 PLN	(3) USD	19 octobre 2023	4	4	–	–
A	55 PLN	(10) USD	19 octobre 2023	14	12	–	(2)
A	101 PLN	(18) USD	19 octobre 2023	25	22	–	(3)
A	17 PLN	(3) USD	19 octobre 2023	4	4	–	–
A	6 USD	(34) PLN	19 octobre 2023	(8)	(7)	1	–
A	10 USD	(52) PLN	19 octobre 2023	(13)	(12)	1	–
A	3 USD	(19) PLN	19 octobre 2023	(4)	(4)	–	–
A	88 SEK	(6) USD	19 octobre 2023	8	8	–	–
A	516 SEK	(37) USD	19 octobre 2023	50	46	–	(4)
A	39 SEK	(3) USD	19 octobre 2023	4	4	–	–
A	18 USD	(243) SEK	19 octobre 2023	(24)	(22)	2	–
A	10 USD	(141) SEK	19 octobre 2023	(14)	(13)	1	–
A	7 USD	(91) SEK	19 octobre 2023	(9)	(8)	1	–
A	97 SEK	(7) USD	19 octobre 2023	9	9	–	–
A	4 USD	(68) SEK	19 octobre 2023	(6)	(6)	–	–
A	6 USD	(283) THB	19 octobre 2023	(8)	(7)	1	–
A	20 USD	(931) THB	19 octobre 2023	(27)	(25)	2	–
A	24 USD	(1 113) THB	19 octobre 2023	(32)	(29)	3	–
A	210 THB	(4) USD	19 octobre 2023	6	5	–	(1)
A	12 USD	(559) THB	19 octobre 2023	(16)	(15)	1	–
A	4 USD	(204) THB	19 octobre 2023	(6)	(6)	–	–
A	5 USD	(248) THB	19 octobre 2023	(7)	(7)	–	–
A	4 USD	(160) THB	19 octobre 2023	(5)	(5)	–	–
A	6 USD	(270) THB	19 octobre 2023	(8)	(8)	–	–
A	122 ZAR	(4) USD	19 octobre 2023	6	6	–	–
A	102 ZAR	(4) USD	19 octobre 2023	6	6	–	–
A	202 ZAR	(8) USD	19 octobre 2023	11	11	–	–
A	688 ZAR	(27) USD	19 octobre 2023	37	35	–	(2)
A	5 USD	(136) ZAR	19 octobre 2023	(7)	(7)	–	–
A	92 ZAR	(4) USD	19 octobre 2023	5	5	–	–
A	135 ZAR	(5) USD	19 octobre 2023	7	7	–	–
A	137 ZAR	(5) USD	19 octobre 2023	7	7	–	–
A	50 USD	(101) AUD	19 octobre 2023	(68)	(65)	3	–
A	138 USD	(277) AUD	19 octobre 2023	(188)	(174)	14	–
A	27 USD	(53) AUD	19 octobre 2023	(36)	(33)	3	–
A	49 USD	(98) AUD	19 octobre 2023	(67)	(62)	5	–
A	71 USD	(141) AUD	19 octobre 2023	(96)	(89)	7	–
A	30 USD	(61) AUD	19 octobre 2023	(41)	(39)	2	–
A	279 AUD	(135) USD	19 octobre 2023	183	178	–	(5)

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	28 AUD	(13) USD	19 octobre 2023	18	18	–	–
A	85 AUD	(41) USD	19 octobre 2023	55	55	–	–
A	25 AUD	(12) USD	19 octobre 2023	16	16	–	–
A	81 AUD	(39) USD	19 octobre 2023	53	53	–	–
A	6 AUD	(3) USD	19 octobre 2023	4	4	–	–
A	103 BRL	(15) USD	19 octobre 2023	21	21	–	–
A	44 USD	(295) BRL	19 octobre 2023	(60)	(58)	2	–
A	493 USD	(3 275) BRL	19 octobre 2023	(669)	(643)	26	–
A	12 305 BRL	(1 850) USD	19 octobre 2023	2 512	2 413	–	(99)
A	291 BRL	(44) USD	19 octobre 2023	60	57	–	(3)
A	121 BRL	(18) USD	19 octobre 2023	25	24	–	(1)
A	18 USD	(118) BRL	19 octobre 2023	(24)	(22)	2	–
A	69 USD	(457) BRL	19 octobre 2023	(94)	(89)	5	–
A	60 USD	(396) BRL	19 octobre 2023	(81)	(78)	3	–
A	60 USD	(415) BRL	19 octobre 2023	(82)	(82)	–	–
A	88 USD	(598) BRL	19 octobre 2023	(120)	(118)	2	–
A	86 USD	(576) BRL	19 octobre 2023	(117)	(113)	4	–
A	69 USD	(471) BRL	19 octobre 2023	(94)	(94)	–	–
A	83 USD	(565) BRL	19 octobre 2023	(113)	(111)	2	–
A	83 USD	(551) BRL	19 octobre 2023	(113)	(108)	5	–
A	141 BRL	(21) USD	19 octobre 2023	28	28	–	–
A	1 073 USD	(1 916) CAD	19 octobre 2023	1 411	1 474	63	–
A	268 USD	(478) CAD	19 octobre 2023	352	368	16	–
A	17 USD	(31) CAD	19 octobre 2023	23	24	1	–
A	119 USD	(213) CAD	19 octobre 2023	157	164	7	–
A	71 USD	(127) CAD	19 octobre 2023	93	97	4	–
A	351 CAD	(195) USD	19 octobre 2023	(259)	(267)	–	(8)
A	164 CAD	(91) USD	19 octobre 2023	(121)	(123)	–	(2)
A	17 CAD	(9) USD	19 octobre 2023	(12)	(12)	–	–
A	33 CAD	(18) USD	19 octobre 2023	(24)	(24)	–	–
A	148 USD	(272) CAD	19 octobre 2023	201	202	1	–
A	136 USD	(251) CAD	19 octobre 2023	185	183	–	(2)
A	33 USD	(62) CAD	19 octobre 2023	45	45	–	–
A	93 CAD	(52) USD	19 octobre 2023	(69)	(70)	–	(1)
A	105 CAD	(57) USD	19 octobre 2023	(77)	(78)	–	(1)
A	77 USD	(85 823) CLP	19 octobre 2023	(105)	(94)	11	–
A	20 USD	(21 826) CLP	19 octobre 2023	(27)	(24)	3	–
A	15 USD	(16 793) CLP	19 octobre 2023	(20)	(18)	2	–
A	11 463 CLP	(10) USD	19 octobre 2023	14	13	–	(1)
A	270 668 CLP	(240) USD	19 octobre 2023	326	294	–	(32)
A	4 225 CLP	(4) USD	19 octobre 2023	5	5	–	–
A	17 USD	(19 593) CLP	19 octobre 2023	(23)	(22)	1	–
A	13 USD	(14 644) CLP	19 octobre 2023	(17)	(16)	1	–
A	18 USD	(20 299) CLP	19 octobre 2023	(24)	(23)	1	–
A	32 USD	(38 181) CLP	19 octobre 2023	(44)	(43)	1	–
A	22 USD	(26 232) CLP	19 octobre 2023	(30)	(29)	1	–
A	38 USD	(46 350) CLP	19 octobre 2023	(52)	(51)	1	–
A	27 464 CLP	(23) USD	19 octobre 2023	31	31	–	–
A	15 919 CLP	(13) USD	19 octobre 2023	18	18	–	–
A	16 USD	(20 282) CLP	19 octobre 2023	(22)	(22)	–	–

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	312 USD	(3 004) CNY	19 octobre 2023	(423)	(407)	16	–
A	437 USD	(4 215) CNY	19 octobre 2023	(593)	(570)	23	–
A	1 471 CNY	(152) USD	19 octobre 2023	206	199	–	(7)
A	141 USD	(1 369) CNY	19 octobre 2023	(192)	(185)	7	–
A	212 USD	(2 042) CNY	19 octobre 2023	(288)	(276)	12	–
A	2 416 CNY	(250) USD	19 octobre 2023	339	328	–	(11)
A	290 USD	(2 826) CNY	19 octobre 2023	(393)	(384)	9	–
A	138 USD	(1 366) CNY	19 octobre 2023	(188)	(187)	1	–
A	1 584 CNY	(160) USD	19 octobre 2023	217	216	–	(1)
A	142 USD	(1 405) CNY	19 octobre 2023	(193)	(192)	1	–
A	443 CNY	(45) USD	19 octobre 2023	61	61	–	–
A	49 USD	(482) CNY	19 octobre 2023	(66)	(66)	–	–
A	3 383 CNY	(342) USD	19 octobre 2023	464	462	–	(2)
A	208 USD	(2 070) CNY	19 octobre 2023	(283)	(283)	–	–
A	80 USD	(457 529) COP	19 octobre 2023	(108)	(112)	–	(4)
A	863 449 COP	(151) USD	19 octobre 2023	205	213	8	–
A	6 021 588 COP	(1 043) USD	19 octobre 2023	1 416	1 486	70	–
A	70 781 COP	(13) USD	19 octobre 2023	17	17	–	–
A	274 USD	(1 515 229) COP	19 octobre 2023	(372)	(368)	4	–
A	10 USD	(51 874) COP	19 octobre 2023	(13)	(13)	–	–
A	13 USD	(69 173) COP	19 octobre 2023	(17)	(17)	–	–
A	24 USD	(134 746) COP	19 octobre 2023	(33)	(32)	1	–
A	9 USD	(50 097) COP	19 octobre 2023	(12)	(12)	–	–
A	12 USD	(69 008) COP	19 octobre 2023	(16)	(16)	–	–
A	27 USD	(153 561) COP	19 octobre 2023	(37)	(37)	–	–
A	32 USD	(176 356) COP	19 octobre 2023	(44)	(43)	1	–
A	21 USD	(112 305) COP	19 octobre 2023	(28)	(26)	2	–
A	157 777 COP	(29) USD	19 octobre 2023	39	39	–	–
A	63 USD	(1 843) CZK	19 octobre 2023	(85)	(79)	6	–
A	42 USD	(1 230) CZK	19 octobre 2023	(57)	(52)	5	–
A	285 USD	(8 318) CZK	19 octobre 2023	(387)	(350)	37	–
A	873 CZK	(30) USD	19 octobre 2023	41	37	–	(4)
A	64 USD	(1 874) CZK	19 octobre 2023	(87)	(79)	8	–
A	79 USD	(2 338) CZK	19 octobre 2023	(107)	(99)	8	–
A	50 USD	(1 494) CZK	19 octobre 2023	(68)	(63)	5	–
A	131 USD	(3 913) CZK	19 octobre 2023	(178)	(167)	11	–
A	23 USD	(680) CZK	19 octobre 2023	(31)	(29)	2	–
A	20 USD	(593) CZK	19 octobre 2023	(27)	(26)	1	–
A	27 USD	(789) CZK	19 octobre 2023	(36)	(34)	2	–
A	1 561 CZK	(50) USD	19 octobre 2023	68	67	–	(1)
A	19 USD	(586) CZK	19 octobre 2023	(26)	(26)	–	–
A	424 CZK	(14) USD	19 octobre 2023	19	19	–	–
A	25 USD	(782) CZK	19 octobre 2023	(34)	(34)	–	–
A	126 USD	(153) EUR	19 octobre 2023	(171)	(159)	12	–
A	10 EUR	(9) USD	19 octobre 2023	12	11	–	(1)
A	85 EUR	(71) USD	19 octobre 2023	96	88	–	(8)
A	649 EUR	(535) USD	19 octobre 2023	726	669	–	(57)
A	60 EUR	(49) USD	19 octobre 2023	66	62	–	(4)
A	276 USD	(340) EUR	19 octobre 2023	(374)	(354)	20	–
A	114 USD	(140) EUR	19 octobre 2023	(155)	(146)	9	–
A	8 USD	(10) EUR	19 octobre 2023	(11)	(10)	1	–

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	54 USD	(67) EUR	19 octobre 2023	(73)	(70)	3	–
A	7 USD	(9) EUR	19 octobre 2023	(10)	(10)	–	–
A	146 EUR	(115) USD	19 octobre 2023	156	153	–	(3)
A	247 USD	(312) EUR	19 octobre 2023	(335)	(329)	6	–
A	38 USD	(48) EUR	19 octobre 2023	(51)	(50)	1	–
A	20 USD	(25) EUR	19 octobre 2023	(27)	(27)	–	–
A	225 GBP	(215) USD	19 octobre 2023	292	266	–	(26)
A	529 USD	(553) GBP	19 octobre 2023	(718)	(658)	60	–
A	14 GBP	(13) USD	19 octobre 2023	18	16	–	(2)
A	44 USD	(47) GBP	19 octobre 2023	(60)	(56)	4	–
A	12 GBP	(12) USD	19 octobre 2023	16	15	–	(1)
A	111 GBP	(105) USD	19 octobre 2023	142	134	–	(8)
A	177 USD	(189) GBP	19 octobre 2023	(240)	(226)	14	–
A	76 USD	(81) GBP	19 octobre 2023	(103)	(97)	6	–
A	52 USD	(56) GBP	19 octobre 2023	(71)	(67)	4	–
A	103 USD	(110) GBP	19 octobre 2023	(140)	(132)	8	–
A	35 GBP	(32) USD	19 octobre 2023	43	42	–	(1)
A	54 USD	(58) GBP	19 octobre 2023	(73)	(71)	2	–
A	60 USD	(66) GBP	19 octobre 2023	(82)	(80)	2	–
A	95 USD	(106) GBP	19 octobre 2023	(129)	(129)	–	–
A	2 217 816 IDR	(108) USD	19 octobre 2023	146	142	–	(4)
A	27 USD	(537 794) IDR	19 octobre 2023	(36)	(34)	2	–
A	117 515 IDR	(6) USD	19 octobre 2023	8	8	–	–
A	10 792 168 IDR	(530) USD	19 octobre 2023	720	686	–	(34)
A	114 USD	(2 331 423) IDR	19 octobre 2023	(155)	(148)	7	–
A	1 969 833 IDR	(97) USD	19 octobre 2023	131	126	–	(5)
A	2 361 475 IDR	(116) USD	19 octobre 2023	157	151	–	(6)
A	3 754 436 IDR	(182) USD	19 octobre 2023	247	240	–	(7)
A	3 754 436 IDR	(181) USD	19 octobre 2023	246	240	–	(6)
A	4 796 711 IDR	(232) USD	19 octobre 2023	315	307	–	(8)
A	1 966 403 IDR	(94) USD	19 octobre 2023	128	126	–	(2)
A	946 588 IDR	(46) USD	19 octobre 2023	62	61	–	(1)
A	1 038 692 IDR	(50) USD	19 octobre 2023	68	66	–	(2)
A	732 253 IDR	(35) USD	19 octobre 2023	48	47	–	(1)
A	78 251 IDR	(4) USD	19 octobre 2023	5	5	–	–
A	375 210 IDR	(18) USD	19 octobre 2023	24	24	–	–
A	232 279 IDR	(11) USD	19 octobre 2023	15	15	–	–
A	1 403 ILS	(284) USD	19 octobre 2023	386	360	–	(26)
A	680 USD	(3 354) ILS	19 octobre 2023	(923)	(865)	58	–
A	29 USD	(142) ILS	19 octobre 2023	(40)	(37)	3	–
A	71 USD	(350) ILS	19 octobre 2023	(97)	(90)	7	–
A	92 USD	(463) ILS	19 octobre 2023	(125)	(120)	5	–
A	83 ILS	(17) USD	19 octobre 2023	23	21	–	(2)
A	14 USD	(72) ILS	19 octobre 2023	(19)	(18)	1	–
A	30 USD	(153) ILS	19 octobre 2023	(41)	(40)	1	–
A	73 ILS	(14) USD	19 octobre 2023	19	19	–	–
A	24 USD	(119) ILS	19 octobre 2023	(32)	(32)	–	–
A	109 ILS	(21) USD	19 octobre 2023	28	28	–	–
A	68 USD	(349) ILS	19 octobre 2023	(92)	(92)	–	–
A	54 ILS	(10) USD	19 octobre 2023	14	14	–	–

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	35 USD	(181) ILS	19 octobre 2023	(47)	(47)	–	–
A	1 339 INR	(12) USD	19 octobre 2023	16	16	–	–
A	69 940 INR	(626) USD	19 octobre 2023	850	836	–	(14)
A	11 198 INR	(100) USD	19 octobre 2023	136	134	–	(2)
A	669 USD	(74 971) INR	19 octobre 2023	(908)	(898)	10	–
A	4 USD	(389) INR	19 octobre 2023	(5)	(5)	–	–
A	17 293 INR	(155) USD	19 octobre 2023	210	206	–	(4)
A	21 301 INR	(191) USD	19 octobre 2023	259	254	–	(5)
A	9 525 INR	(85) USD	19 octobre 2023	115	114	–	(1)
A	132 USD	(14 850) INR	19 octobre 2023	(179)	(178)	1	–
A	1 840 INR	(16) USD	19 octobre 2023	22	22	–	–
A	57 USD	(6 430) INR	19 octobre 2023	(77)	(77)	–	–
A	6 412 INR	(57) USD	19 octobre 2023	77	76	–	(1)
A	10 717 INR	(95) USD	19 octobre 2023	129	129	–	–
A	11 063 INR	(98) USD	19 octobre 2023	133	132	–	(1)
A	7 027 INR	(63) USD	19 octobre 2023	85	85	–	–
A	6 004 INR	(53) USD	19 octobre 2023	72	72	–	–
A	2 479 JPY	(13) USD	19 octobre 2023	18	16	–	(2)
A	22 USD	(4 091) JPY	19 octobre 2023	(30)	(27)	3	–
A	797 JPY	(4) USD	19 octobre 2023	6	5	–	(1)
A	367 918 JPY	(1 987) USD	19 octobre 2023	2 697	2 387	–	(310)
A	52 USD	(9 742) JPY	19 octobre 2023	(71)	(63)	8	–
A	19 434 JPY	(103) USD	19 octobre 2023	140	127	–	(13)
A	13 275 JPY	(70) USD	19 octobre 2023	95	87	–	(8)
A	948 JPY	(5) USD	19 octobre 2023	7	7	–	–
A	12 828 JPY	(66) USD	19 octobre 2023	90	85	–	(5)
A	20 044 JPY	(102) USD	19 octobre 2023	139	132	–	(7)
A	11 739 JPY	(60) USD	19 octobre 2023	81	78	–	(3)
A	26 837 JPY	(136) USD	19 octobre 2023	185	178	–	(7)
A	11 580 JPY	(58) USD	19 octobre 2023	79	77	–	(2)
A	64 648 JPY	(326) USD	19 octobre 2023	442	432	–	(10)
A	31 USD	(6 226) JPY	19 octobre 2023	(42)	(41)	1	–
A	3 907 JPY	(19) USD	19 octobre 2023	26	26	–	–
A	512 USD	(882 018) KOR	19 octobre 2023	(695)	(638)	57	–
A	278 USD	(478 283) KOR	19 octobre 2023	(378)	(345)	33	–
A	17 USD	(29 084) KOR	19 octobre 2023	(23)	(21)	2	–
A	12 USD	(20 852) KOR	19 octobre 2023	(16)	(15)	1	–
A	27 USD	(47 103) KOR	19 octobre 2023	(37)	(34)	3	–
A	97 769 KOR	(56) USD	19 octobre 2023	76	71	–	(5)
A	300 730 KOR	(169) USD	19 octobre 2023	230	220	–	(10)
A	99 994 KOR	(55) USD	19 octobre 2023	75	74	–	(1)
A	122 551 KOR	(68) USD	19 octobre 2023	92	91	–	(1)
A	82 440 KOR	(46) USD	19 octobre 2023	63	61	–	(2)
A	17 USD	(31 191) KOR	19 octobre 2023	(23)	(23)	–	–
A	34 205 KOR	(19) USD	19 octobre 2023	26	25	–	(1)
A	65 734 KOR	(37) USD	19 octobre 2023	50	49	–	(1)
A	30 USD	(54 873) KOR	19 octobre 2023	(41)	(41)	–	–
A	15 755 MXN	(678) USD	19 octobre 2023	920	894	–	(26)
A	45 039 MXN	(1 938) USD	19 octobre 2023	2 631	2 555	–	(76)
A	800 USD	(18 603) MXN	19 octobre 2023	(1 086)	(1 056)	30	–

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	30 USD	(701) MXN	19 octobre 2023	(41)	(39)	2	–
A	115 USD	(2 661) MXN	19 octobre 2023	(156)	(151)	5	–
A	109 USD	(2 547) MXN	19 octobre 2023	(148)	(145)	3	–
A	35 USD	(801) MXN	19 octobre 2023	(47)	(45)	2	–
A	165 USD	(3 835) MXN	19 octobre 2023	(224)	(218)	6	–
A	113 USD	(2 658) MXN	19 octobre 2023	(153)	(151)	2	–
A	150 USD	(3 469) MXN	19 octobre 2023	(203)	(197)	6	–
A	88 USD	(2 036) MXN	19 octobre 2023	(120)	(115)	5	–
A	187 USD	(4 482) MXN	19 octobre 2023	(254)	(257)	–	(3)
A	162 USD	(3 827) MXN	19 octobre 2023	(220)	(218)	2	–
A	183 USD	(4 275) MXN	19 octobre 2023	(249)	(243)	6	–
A	38 USD	(892) MXN	19 octobre 2023	(51)	(51)	–	–
A	11 748 NOK	(857) USD	19 octobre 2023	1 164	1 076	–	(88)
A	324 USD	(4 441) NOK	19 octobre 2023	(440)	(407)	33	–
A	11 691 NOK	(853) USD	19 octobre 2023	1 158	1 070	–	(88)
A	47 USD	(638) NOK	19 octobre 2023	(64)	(59)	5	–
A	410 USD	(5 575) NOK	19 octobre 2023	(557)	(509)	48	–
A	990 NOK	(72) USD	19 octobre 2023	98	90	–	(8)
A	244 NOK	(18) USD	19 octobre 2023	24	22	–	(2)
A	24 USD	(324) NOK	19 octobre 2023	(32)	(30)	2	–
A	133 NOK	(10) USD	19 octobre 2023	13	13	–	–
A	8 USD	(119) NOK	19 octobre 2023	(11)	(11)	–	–
A	133 NOK	(10) USD	19 octobre 2023	13	13	–	–
A	24 USD	(347) NOK	19 octobre 2023	(32)	(32)	–	–
A	16 USD	(240) NOK	19 octobre 2023	(22)	(22)	–	–
A	136 NOK	(10) USD	19 octobre 2023	13	13	–	–
A	70 NOK	(5) USD	19 octobre 2023	7	7	–	–
A	26 USD	(1 077) NTD	19 octobre 2023	(35)	(33)	2	–
A	934 USD	(39 264) NTD	19 octobre 2023	(1 268)	(1 200)	68	–
A	15 USD	(646) NTD	19 octobre 2023	(21)	(20)	1	–
A	3 722 NTD	(89) USD	19 octobre 2023	121	114	–	(7)
A	3 663 NTD	(87) USD	19 octobre 2023	118	112	–	(6)
A	4 083 NTD	(96) USD	19 octobre 2023	130	126	–	(4)
A	4 555 NTD	(106) USD	19 octobre 2023	144	140	–	(4)
A	4 069 NTD	(94) USD	19 octobre 2023	128	126	–	(2)
A	4 418 NTD	(102) USD	19 octobre 2023	139	137	–	(2)
A	4 017 NTD	(94) USD	19 octobre 2023	127	124	–	(3)
A	4 293 NTD	(99) USD	19 octobre 2023	134	133	–	(1)
A	4 096 NTD	(94) USD	19 octobre 2023	128	127	–	(1)
A	4 071 NTD	(94) USD	19 octobre 2023	127	126	–	(1)
A	77 USD	(166) NZD	19 octobre 2023	(105)	(98)	7	–
A	322 NZD	(150) USD	19 octobre 2023	203	190	–	(13)
A	552 USD	(1 191) NZD	19 octobre 2023	(750)	(702)	48	–
A	38 NZD	(18) USD	19 octobre 2023	24	22	–	(2)
A	99 USD	(214) NZD	19 octobre 2023	(134)	(127)	7	–
A	84 USD	(184) NZD	19 octobre 2023	(114)	(108)	6	–
A	52 USD	(116) NZD	19 octobre 2023	(71)	(69)	2	–
A	124 USD	(278) NZD	19 octobre 2023	(169)	(166)	3	–
A	166 USD	(377) NZD	19 octobre 2023	(225)	(225)	–	–
A	94 USD	(214) NZD	19 octobre 2023	(127)	(128)	–	(1)

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	57 USD	(129) NZD	19 octobre 2023	(77)	(77)	–	–
A	5 USD	(12) NZD	19 octobre 2023	(7)	(7)	–	–
A	24 USD	(55) NZD	19 octobre 2023	(33)	(33)	–	–
A	11 NZD	(5) USD	19 octobre 2023	7	7	–	–
A	57 USD	(4 349) PHP	19 octobre 2023	(78)	(76)	2	–
A	895 USD	(66 297) PHP	19 octobre 2023	(1 215)	(1 152)	63	–
A	197 USD	(14 657) PHP	19 octobre 2023	(268)	(255)	13	–
A	8 813 PHP	(119) USD	19 octobre 2023	162	153	–	(9)
A	29 USD	(2 123) PHP	19 octobre 2023	(39)	(37)	2	–
A	26 USD	(1 905) PHP	19 octobre 2023	(35)	(33)	2	–
A	146 USD	(10 869) PHP	19 octobre 2023	(198)	(190)	8	–
A	7 527 PHP	(99) USD	19 octobre 2023	134	132	–	(2)
A	1 434 PHP	(18) USD	19 octobre 2023	25	25	–	–
A	3 684 PHP	(48) USD	19 octobre 2023	65	65	–	–
A	6 USD	(470) PHP	19 octobre 2023	(8)	(8)	–	–
A	130 USD	(9 996) PHP	19 octobre 2023	(176)	(177)	–	(1)
A	69 USD	(5 308) PHP	19 octobre 2023	(94)	(94)	–	–
A	38 USD	(2 922) PHP	19 octobre 2023	(51)	(51)	–	–
A	94 USD	(7 270) PHP	19 octobre 2023	(127)	(129)	–	(2)
A	1 485 PLN	(273) USD	19 octobre 2023	370	328	–	(42)
A	2 771 PLN	(509) USD	19 octobre 2023	691	613	–	(78)
A	242 USD	(1 319) PLN	19 octobre 2023	(329)	(290)	39	–
A	159 PLN	(29) USD	19 octobre 2023	40	35	–	(5)
A	522 PLN	(96) USD	19 octobre 2023	130	115	–	(15)
A	509 PLN	(93) USD	19 octobre 2023	126	113	–	(13)
A	83 USD	(454) PLN	19 octobre 2023	(112)	(101)	11	–
A	192 USD	(1 058) PLN	19 octobre 2023	(261)	(235)	26	–
A	5 USD	(27) PLN	19 octobre 2023	(7)	(6)	1	–
A	28 USD	(159) PLN	19 octobre 2023	(38)	(35)	3	–
A	58 PLN	(10) USD	19 octobre 2023	14	13	–	(1)
A	379 PLN	(65) USD	19 octobre 2023	88	87	–	(1)
A	61 PLN	(10) USD	19 octobre 2023	14	14	–	–
A	18 USD	(103) PLN	19 octobre 2023	(24)	(24)	–	–
A	1 448 SEK	(100) USD	19 octobre 2023	136	131	–	(5)
A	11 357 SEK	(809) USD	19 octobre 2023	1 098	1 019	–	(79)
A	33 USD	(466) SEK	19 octobre 2023	(45)	(42)	3	–
A	394 USD	(5 527) SEK	19 octobre 2023	(535)	(497)	38	–
A	176 USD	(2 429) SEK	19 octobre 2023	(239)	(217)	22	–
A	51 USD	(718) SEK	19 octobre 2023	(69)	(64)	5	–
A	2 584 SEK	(180) USD	19 octobre 2023	245	234	–	(11)
A	28 USD	(399) SEK	19 octobre 2023	(38)	(36)	2	–
A	404 SEK	(27) USD	19 octobre 2023	37	36	–	(1)
A	43 USD	(636) SEK	19 octobre 2023	(58)	(58)	–	–
A	621 SEK	(43) USD	19 octobre 2023	58	57	–	(1)
A	806 SEK	(53) USD	19 octobre 2023	72	74	2	–
A	8 USD	(125) SEK	19 octobre 2023	(11)	(11)	–	–
A	15 USD	(226) SEK	19 octobre 2023	(20)	(21)	–	(1)
A	479 SEK	(32) USD	19 octobre 2023	44	44	–	–
A	68 USD	(3 165) THB	19 octobre 2023	(92)	(85)	7	–
A	576 USD	(26 860) THB	19 octobre 2023	(782)	(716)	66	–

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	690 USD	(32 169) THB	19 octobre 2023	(937)	(857)	80	–
A	3 476 THB	(76) USD	19 octobre 2023	103	92	–	(11)
A	35 USD	(1 645) THB	19 octobre 2023	(48)	(43)	5	–
A	62 USD	(2 875) THB	19 octobre 2023	(84)	(77)	7	–
A	118 USD	(5 463) THB	19 octobre 2023	(160)	(146)	14	–
A	267 USD	(12 645) THB	19 octobre 2023	(362)	(341)	21	–
A	121 USD	(5 780) THB	19 octobre 2023	(164)	(156)	8	–
A	3 311 THB	(70) USD	19 octobre 2023	95	89	–	(6)
A	1 529 THB	(32) USD	19 octobre 2023	44	41	–	(3)
A	2 583 THB	(54) USD	19 octobre 2023	73	70	–	(3)
A	2 404 THB	(50) USD	19 octobre 2023	68	66	–	(2)
A	1 277 THB	(27) USD	19 octobre 2023	36	35	–	(1)
A	15 USD	(775) THB	19 octobre 2023	(21)	(21)	–	–
A	1 906 ZAR	(75) USD	19 octobre 2023	102	100	–	(2)
A	15 135 ZAR	(608) USD	19 octobre 2023	825	789	–	(36)
A	84 USD	(2 094) ZAR	19 octobre 2023	(114)	(109)	5	–
A	4 015 ZAR	(161) USD	19 octobre 2023	219	209	–	(10)
A	27 USD	(652) ZAR	19 octobre 2023	(36)	(33)	3	–
A	2 367 ZAR	(97) USD	19 octobre 2023	131	123	–	(8)
A	98 ZAR	(4) USD	19 octobre 2023	5	5	–	–
A	605 ZAR	(24) USD	19 octobre 2023	32	32	–	–
A	86 ZAR	(3) USD	19 octobre 2023	4	4	–	–
A	13 USD	(322) ZAR	19 octobre 2023	(17)	(17)	–	–
A	15 USD	(390) ZAR	19 octobre 2023	(21)	(21)	–	–
A	395 ZAR	(15) USD	19 octobre 2023	21	21	–	–
A	13 USD	(349) ZAR	19 octobre 2023	(18)	(18)	–	–
A	242 ZAR	(10) USD	19 octobre 2023	13	13	–	–
A	10 USD	(241) ZAR	19 octobre 2023	(13)	(13)	–	–
A	3 USD	(20) BRL	19 octobre 2023	(4)	(4)	–	–
A	1 USD	(2 000) CLP	19 octobre 2023	(2)	(2)	–	–
A	2 USD	(1 000) HUF	19 octobre 2023	(3)	(3)	–	–
A	40 PEN	(8) USD	19 octobre 2023	11	11	–	–
A	4 USD	(20) PLN	19 octobre 2023	(5)	(5)	–	–
A	200 THB	(4) USD	19 octobre 2023	6	6	–	–
A	3 USD	(70) ZAR	19 octobre 2023	(4)	(4)	–	–
AA	133 CAD	(90) EUR	20 octobre 2023	(133)	(129)	4	–
A	321 CAD	(244) USD	27 octobre 2023	(321)	(331)	–	(10)
A	16 CAD	(11) EUR	27 octobre 2023	(16)	(16)	–	–
A	9 847 CAD	(7 475) USD	27 octobre 2023	(9 847)	(10 148)	–	(301)
A	89 AUD	(43) USD	3 novembre 2023	58	58	–	–
A	6 USD	(11) CAD	3 novembre 2023	8	8	–	–
A	166 USD	(205) CHF	3 novembre 2023	(225)	(225)	–	–
A	2 EUR	(1) USD	3 novembre 2023	2	2	–	–
A	119 GBP	(107) USD	3 novembre 2023	145	145	–	–
A	820 NOK	(57) USD	3 novembre 2023	77	76	–	(1)
A	201 NZD	(89) USD	3 novembre 2023	121	121	–	–
A	75 USD	(1 110) SEK	3 novembre 2023	(102)	(101)	1	–
A	125 USD	(170) CAD	3 novembre 2023	170	170	–	–
AA	5 USD	(7) CAD	3 novembre 2023	7	7	–	–
A	110 USD	(149) CAD	3 novembre 2023	149	150	1	–

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
AA	110	USD	(149)	CAD	3 novembre 2023	149	149	–	–
A	82	USD	(16 500)	JPY	6 novembre 2023	(111)	(111)	–	–
A	246	CAD	(280)	AUD	8 novembre 2023	(246)	(245)	1	–
A	414	CAD	(280)	EUR	8 novembre 2023	(414)	(402)	12	–
A	131	CAD	(77)	GBP	8 novembre 2023	(131)	(127)	4	–
A	517	CAD	(55 000)	JPY	8 novembre 2023	(517)	(503)	14	–
A	126	CAD	(1 000)	SEK	8 novembre 2023	(126)	(125)	1	–
A	2 256	CAD	(1 680)	USD	8 novembre 2023	(2 256)	(2 280)	–	(24)
AA	163	CAD	(120)	USD	9 novembre 2023	(163)	(163)	–	–
A	7	CAD	(5)	USD	12 janvier 2024	(7)	(7)	–	–
A	388	CAD	(285)	USD	12 janvier 2024	(388)	(387)	1	–
A	1 099	CAD	(810)	USD	12 janvier 2024	(1 099)	(1 098)	1	–
AA	158	CAD	(117)	USD	19 janvier 2024	(158)	(159)	–	(1)
AA	1 930	USD	(2 598)	CAD	19 janvier 2024	2 598	2 616	18	–
A	105	CAD	(73)	EUR	26 janvier 2024	(105)	(105)	–	–
A	633	USD	(6 673)	HKD	19 avril 2024	(859)	(854)	5	–
A	1 266	USD	(13 345)	HKD	19 avril 2024	(1 718)	(1 709)	9	–
<b>Total des contrats de change à terme de gré à gré</b>								<b>1 678</b>	<b>(1 881)</b>
<b>Total des actifs dérivés</b>									<b>1 916</b>
<b>Total des passifs dérivés</b>									<b>(2 129)</b>

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 canadiens, 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 MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

### 3. Principales méthodes comptables (suite)

#### b) Évaluation de la juste valeur

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 MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

### 3. Principales méthodes comptables (suite)

#### c) Comptabilisation des revenus et des charges

Les revenus d'intérêts et les charges d'intérêts aux fins de distribution correspondent à l'intérêt nominal reçu ou payé 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. Le revenu et les charges de dividendes sont constatés à la date ex-dividende. Les dividendes et les intérêts versés découlant de la vente à découvert d'actions et d'obligations sont comptabilisés à l'état du résultat global aux postes Dividendes et Revenu d'intérêts, respectivement. 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 les charges, 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 canadien 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 canadiens 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 canadiens 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.

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

### 3. Principales méthodes comptables (suite)

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.

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) Frais de vente à découvert et d'emprunt

Le Fonds peut effectuer des ventes à découvert d'actions et d'obligations dans le cadre de sa stratégie de placement globale. Lorsque le Fonds procède à la vente à découvert d'une action ou d'une obligation, il doit emprunter ce titre d'un courtier et verser en échange des frais d'emprunt au courtier, afin de finaliser la vente. Le Fonds peut réaliser un profit sur la vente à découvert si le cours du titre diminue entre le moment de la vente à découvert et la date à laquelle le Fonds dénoue sa position vendeur, en rachetant le titre à un cours inférieur et en le remettant au courtier. Une perte surviendra si le cours du titre augmente. Les restrictions prévues par la stratégie de placement du Fonds en matière de ventes à découvert et d'emprunt comprennent ce qui suit : i) la valeur marchande globale de tous les titres vendus à découvert par le Fonds ne doit pas dépasser 50 % de l'actif net total du Fonds; ii) la valeur marchande globale de tous les titres d'un émetteur en particulier vendus à découvert par le Fonds ne doit pas dépasser 20 % de l'actif net total du Fonds; iii) le Fonds peut emprunter des liquidités correspondant à un maximum de 50 % de sa valeur liquidative; et iv) le recours à la vente à découvert combinée à l'emprunt de liquidités par le Fonds est assujéti à une limite globale de 50 % de sa valeur liquidative. Les profits et les pertes réalisé(e)s sur la vente à découvert d'actions et d'obligations sont comptabilisé(e)s à l'état du résultat global au poste Profit (perte) net(te) réalisé(e).

m) 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 canadien 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 assujétiées 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.

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

### 5. Impôts sur le résultat

Le Fonds est admissible à titre de fiducie 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.

### 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 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.

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).

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

### 8. Risques découlant des instruments financiers (suite)

#### 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 canadien, 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 canadien baisse (par rapport aux devises). À l'inverse, lorsque la valeur du dollar canadien 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 canadiens, sur l'actif net du Fonds d'une hausse ou d'une baisse de 5 % du dollar canadien 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.

#### 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 et titres vendus à découvert, 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. Dans le cas de titres vendus à découvert, la perte pour le Fonds continue d'augmenter, sans limite, au fur et à mesure que la juste valeur de l'élément sous-jacent augmente. Ce risque est atténué au moyen de restrictions quant à la capacité du Fonds de vendre des titres à découvert. Ces restrictions sont décrites à la note 3 I).

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 MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU 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 MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

### 10. Renseignements propres au Fonds (en milliers, sauf pour a))

#### a) Constitution du Fonds et renseignements sur les séries

Date de constitution : 27 avril 2018

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 titres de série A sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$.

Les titres de série F sont offerts aux particuliers 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 \$; ils sont également proposés aux employés de Mackenzie et de ses filiales, et aux administrateurs de Mackenzie.

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 titres de série O sont offerts seulement aux investisseurs qui investissent un minimum de 500 000 \$ et qui participent au Service d'architecture de portefeuille ou au Service d'architecture ouverte de Mackenzie; ils sont également proposés à certains investisseurs institutionnels, à certains investisseurs d'un régime collectif admissible et à certains employés admissibles de Mackenzie et de ses filiales.

Les titres de série PW sont offerts à certains investisseurs à valeur nette élevée de nos Solutions Patrimoine privé qui investissent un minimum de 100 000 \$.

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 titres de série PWX 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 titres de série R sont offerts exclusivement à d'autres fonds gérés par Mackenzie et non visés par un prospectus relativement à des ententes de fonds de fonds.

Les titres de série S sont offerts à La Compagnie d'Assurance du Canada sur la Vie et à certains autres fonds communs, mais peuvent être vendus à d'autres investisseurs comme le déterminera Mackenzie.

Les titres de série CL ne sont pas offerts à la vente.

Chaque série est offerte selon le mode de souscription avec frais d'acquisition. Les frais du mode de souscription avec frais d'acquisition sont négociés entre l'investisseur et son courtier. Pour de plus amples renseignements sur ce mode de souscription, 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	23 mai 2018	2,10 %	0,28 %
Série CL	Aucun titre émis <sup>3)</sup>	s.o.	s.o.
Série F	23 mai 2018	1,00 %	0,15 %
Série FB	23 mai 2018	1,10 %	0,28 %
Série O	23 mai 2018	— <sup>1)</sup>	s.o.
Série PW	23 mai 2018	2,00 %	0,15 %
Série PWFB	23 mai 2018	1,00 %	0,15 %
Série PWX	23 mai 2018	— <sup>2)</sup>	— <sup>2)</sup>
Série R	23 mai 2018	s.o.	s.o.
Série S	4 novembre 2020	— <sup>1)</sup>	0,03 %

1) Ces frais sont négociables et sont payables directement à Mackenzie par les investisseurs dans cette série.

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

3) La date d'établissement initiale de la série est le 11 janvier 2021. Tous les titres de la série ont été rachetés le 25 avril 2023.

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

### 10. Renseignements propres au Fonds (en milliers, 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 \$	
11 091	9 723	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3 112	2 280	4 331

#### c) Prêt de titres

Au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023, aucune opération de prêt, de mise en pension ou de prise en pension de titres n'était en cours.

#### d) Commissions

	(\$)
30 septembre 2023	32
30 septembre 2022	18

#### e) Risques découlant des instruments financiers

##### i. Exposition au risque et gestion du risque

Le Fonds vise un rendement positif sur un cycle de marché, peu importe la conjoncture, en employant une ou plusieurs des stratégies suivantes : une stratégie alternative de crédit, une stratégie macroéconomique mondiale, une stratégie de positions acheteur-vendeur sur actions et/ou une stratégie de neutralité par rapport aux marchés boursiers. Le Fonds a accès à une vaste gamme de catégories d'actifs, notamment des titres de capitaux propres, des titres à revenu fixe et/ou des titres convertibles émis par des sociétés situées partout dans le monde, y compris les marchés émergents. Le Fonds peut également investir jusqu'à 100 % de son actif dans des devises et/ou des marchandises. Le Fonds peut également effectuer des ventes à découvert et/ou des emprunts aux fins de placement.

L'exposition globale du Fonds à ses sources de levier correspond à la somme des sources de levier suivantes et ne doit pas dépasser 300 % de sa valeur liquidative :

i) la valeur de marché globale des titres vendus à découvert; ii) l'encours total des emprunts aux termes des conventions d'emprunt aux fins de placement; et iii) la valeur notionnelle globale des positions sur dérivés visés du Fonds, à l'exception des dérivés visés utilisés aux fins de couverture.

L'effet cumulatif du recours au levier financier dans un marché qui évolue au détriment d'un placement avec effet de levier pourrait se solder par une perte importante plus lourde qu'en l'absence de recours au levier financier. Par conséquent, toute incidence défavorable découlant d'un événement sur la valeur d'un placement du Fonds sera amplifiée dans la mesure selon laquelle est employé le levier financier.

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

### 10. Renseignements propres au Fonds (en milliers, 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 %	
					(\$)	%	(\$)	%
USD	12 353	3 564	(9 455)	6 462				
JPY	(136)	385	3 000	3 249				
IDR	–	–	2 127	2 127				
BRL	373	17	1 068	1 458				
NOK	(79)	80	1 403	1 404				
ZAR	–	7	1 156	1 163				
COP	–	–	1 137	1 137				
INR	–	–	942	942				
PLN	–	–	641	641				
MXN	–	13	586	599				
SEK	(62)	172	441	551				
CNY	1 787	25	(1 322)	490				
EUR	336	949	(871)	414				
SGD	106	67	–	173				
AUD	(18)	554	(368)	168				
DKK	60	1	–	61				
NTD	–	8	12	20				
CLP	–	–	18	18				
PEN	–	–	11	11				
HUF	–	–	(3)	(3)				
CHF	(73)	85	(224)	(212)				
KOR	–	–	(540)	(540)				
GBP	137	243	(1 054)	(674)				
HKD	1 679	1	(2 563)	(883)				
ILS	–	1	(926)	(925)				
CZK	–	–	(943)	(943)				
NZD	8	8	(1 475)	(1 459)				
PHP	–	–	(1 879)	(1 879)				
THB	–	–	(2 140)	(2 140)				
<b>Total</b>	<b>16 471</b>	<b>6 180</b>	<b>(11 221)</b>	<b>11 430</b>				
% de l'actif net	26,6	10,0	(18,1)	18,5				
<b>Total de la sensibilité aux variations des taux de change</b>					<b>(754)</b>	<b>(1,2)</b>	<b>754</b>	<b>1,2</b>

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

### 10. Renseignements propres au Fonds (en milliers, 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 %	
					(\$)	%	(\$)	%
USD	18 619	4 001	(17 671)	4 949				
MXN	–	(2)	4 371	4 369				
BRL	141	38	3 022	3 201				
EUR	835	634	951	2 420				
HKD	2 071	11	–	2 082				
COP	–	–	1 964	1 964				
PLN	–	–	1 616	1 616				
ZAR	60	(24)	1 363	1 399				
IDR	–	–	1 201	1 201				
NOK	(147)	90	1 148	1 091				
CNY	2 298	45	(1 384)	959				
SEK	(140)	209	607	676				
CLP	–	–	540	540				
AUD	19	200	202	421				
DKK	65	1	–	66				
SGD	(30)	81	(17)	34				
HUF	–	–	(3)	(3)				
PEN	–	–	(5)	(5)				
NZD	(26)	(7)	(69)	(102)				
CHF	(124)	157	(519)	(486)				
CZK	–	–	(606)	(606)				
JPY	(160)	661	(1 144)	(643)				
ILS	79	1	(795)	(715)				
GBP	(130)	184	(1 027)	(973)				
THB	–	–	(1 315)	(1 315)				
KOR	101	–	(1 518)	(1 417)				
PHP	–	–	(1 649)	(1 649)				
NTD	78	8	(1 987)	(1 901)				
INR	–	–	(2 578)	(2 578)				
<b>Total</b>	<b>23 609</b>	<b>6 288</b>	<b>(15 302)</b>	<b>14 595</b>				
% de l'actif net	24,7	6,6	(16,0)	15,3				
<b>Total de la sensibilité aux variations des taux de change</b>					<b>(1 083)</b>	<b>(1,1)</b>	<b>1 083</b>	<b>1,1</b>

\* Comprend les instruments financiers monétaires et non monétaires.

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

### 10. Renseignements propres au Fonds (en milliers, sauf pour a)) (suite)

#### e) Risques découlant des instruments financiers (suite)

##### 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 selon la durée jusqu'à l'échéance et des dérivés.

30 septembre 2023 (\$)				
Durée jusqu'à l'échéance	Obligations		Instruments dérivés	
	Positions acheteur	Positions vendeur	Positions acheteur	Positions vendeur
Moins de 1 an	419	–	13 611	(12 728)
1 an à 5 ans	5 379	(836)	–	–
5 ans à 10 ans	5 812	(169)	–	–
Plus de 10 ans	2 558	–	–	–
Total	14 168	(1 005)	13 611	(12 728)

31 mars 2023 (\$)				
Durée jusqu'à l'échéance	Obligations		Instruments dérivés	
	Positions acheteur	Positions vendeur	Positions acheteur	Positions vendeur
Moins de 1 an	878	–	6 098	(18 571)
1 an à 5 ans	8 434	(616)	–	–
5 ans à 10 ans	10 937	(429)	–	–
Plus de 10 ans	4 418	–	–	–
Total	24 667	(1 045)	6 098	(18 571)

Au 30 septembre 2023, si les taux d'intérêt en vigueur avaient connu une hausse de 1 %, la courbe des taux évoluant en parallèle et toute autre variable demeurant constante, l'actif net aurait diminué d'environ 192 \$ ou 0,3 % du total de l'actif net (diminution d'environ 83 \$ ou 0,1 % au 31 mars 2023). De même, si les taux d'intérêt en vigueur avaient connu une baisse de 1 %, toute autre variable demeurant constante, l'actif net aurait augmenté d'environ 261 \$ ou 0,4 % du total de l'actif net (augmentation d'environ 16 \$ ou 0,0 % au 31 mars 2023). En pratique, les résultats réels de négociation peuvent différer et l'écart pourrait être important.

##### 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	1 440	2,3	(1 229)	(2,0)
31 mars 2023	1 440	1,5	(1 208)	(1,3)

##### 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 0,6 % de l'actif net du Fonds (1,7 % 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
AA	0,5	1,9
A	0,7	1,2
BBB	1,1	2,4
Inférieure à BBB	16,1	17,0
Sans note	2,8	2,2
Total	21,2	24,7

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

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

### 10. Renseignements propres au Fonds (en milliers, sauf pour a)) (suite)

#### 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 – Positions acheteur	131	14 037	–	14 168	–	24 667	–	24 667
Obligations – Positions vendeur	–	(1 005)	–	(1 005)	–	(1 045)	–	(1 045)
Actions – Positions acheteur	19 008	5 161	18	24 187	28 787	9 172	18	37 977
Actions – Positions vendeur	(13 042)	(1 645)	(9)	(14 696)	(23 208)	(4 631)	(12)	(27 851)
Options	–	484	–	484	–	505	–	505
Fonds/billets négociés en bourse – Positions acheteur	1 356	–	–	1 356	1 092	–	–	1 092
Fonds/billets négociés en bourse – Positions vendeur	(186)	–	–	(186)	(185)	–	–	(185)
Fonds communs de placement	3 812	–	–	3 812	7 125	–	–	7 125
Fonds privés	–	–	196	196	–	–	185	185
Actifs dérivés	238	1 678	–	1 916	329	1 909	–	2 238
Passifs dérivés	(232)	(1 964)	–	(2 196)	(645)	(1 162)	–	(1 807)
Placements à court terme	5 490	11 251	–	16 741	15 490	9 061	–	24 551
<b>Total</b>	<b>16 565</b>	<b>28 007</b>	<b>205</b>	<b>44 777</b>	<b>28 785</b>	<b>38 476</b>	<b>191</b>	<b>67 452</b>

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).

Au cours de la période close le 30 septembre 2023, des obligations d'une juste valeur de néant (133 \$ au 31 mars 2023) ont été transférées du niveau 1 au niveau 2 et d'une juste valeur de 131 \$ (néant au 31 mars 2023) ont été transférées du niveau 2 au niveau 1 en raison de changements en matière de données utilisées pour l'évaluation.

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 (\$)	Fonds privés (\$)	Total (\$)	Actions (\$)	Fonds privés (\$)	Total (\$)
Solde, à l'ouverture	6	185	191	16	38	54
Achats	–	2	2	8	146	154
Ventes	–	–	–	(10)	–	(10)
Transferts entrants	–	–	–	(14)	–	(14)
Transferts sortants	–	–	–	–	–	–
Profits (pertes) au cours de la période :						
Réalisé(e)s	–	–	–	–	–	–
Latent(e)s	3	9	12	6	1	7
<b>Solde, à la clôture</b>	<b>9</b>	<b>196</b>	<b>205</b>	<b>6</b>	<b>185</b>	<b>191</b>
Variation des profits (pertes) latent(e)s au cours de la période attribuables aux titres détenus à la clôture de la période	3	9	12	4	1	5

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.

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

### 10. Renseignements propres au Fonds (en milliers, sauf pour a)) (suite)

#### 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	–	–
Autres fonds gérés par le gestionnaire	57 102	69 116
Fonds gérés par des sociétés affiliées au gestionnaire	54	17 512

#### 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	863	(842)	–	21
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(915)	842	1 205	1 132
Obligation pour options vendues	(67)	–	–	(67)
Total	(119)	–	1 205	1 086

	31 mars 2023			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	796	(610)	–	186
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(942)	610	2 111	1 779
Obligation pour options vendues	(73)	–	–	(73)
Total	(219)	–	2 111	1 892

#### i) Intérêts dans une entité structurée non consolidée

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 (\$)
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF	0,0	(18)
iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF	0,0	101
Fonds toutes actions Chine Mackenzie ChinaAMC, série R	3,3	3 812
Sagard Credit Partners II LP	0,0	196
SPDR Bloomberg Barclays Convertible Securities ETF	0,0	(168)
SPDR Bloomberg High Yield Bond ETF	0,0	110
SPDR S&P Oil & Gas Exploration & Production ETF	0,0	1 145

# FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

### 10. Renseignements propres au Fonds (en milliers, sauf pour a)) (suite)

#### i) Intérêts dans une entité structurée non consolidée (suite)

31 mars 2023	% de l'actif net du Fonds sous-jacent	Juste valeur des placements du Fonds (\$)
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF	0,0	(19)
iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF	0,0	108
Fonds toutes actions Chine Mackenzie ChinaAMC, série R	4,7	7 125
Sagard Credit Partners II LP	0,1	185
SPDR Bloomberg Barclays Convertible Securities ETF	0,0	(166)
SPDR S&P Oil & Gas Exploration & Production ETF	0,0	984

#### j) Dividendes et revenu d'intérêts

Des dividendes et des intérêts versés découlant de la vente à découvert de titres de 557 \$ et de 34 \$ (471 \$ et 44 \$ au 30 septembre 2022), respectivement, sont inclus dans les dividendes et le revenu d'intérêts pour la période close le 30 septembre 2023.

#### k) Effet de levier

L'effet de levier survient lorsqu'un Fonds emprunte de l'argent ou des titres, ou a recours à des produits dérivés, pour effectuer des placements qui n'auraient autrement pas été possibles. L'exposition globale du Fonds à ses sources de levier est calculée comme étant la somme des éléments suivants : i) la valeur marchande des titres vendeur; ii) le montant en espèces emprunté aux fins de placement; et iii) la valeur notionnelle des positions sur dérivés du Fonds, à l'exception des dérivés utilisés aux fins de couverture. Cette exposition ne peut dépasser 300 % de la valeur liquidative du Fonds.

Au cours de la période de six mois close le 30 septembre 2023, l'exposition globale du Fonds aux sources de levier a varié entre 58 % et 105 % de la valeur liquidative du Fonds. Le haut de la fourchette a été atteint en juillet 2023, lorsque la stratégie macro mondiale a ajouté une exposition aux contrats à terme standardisés sur obligations à 2 ans. Le bas de la fourchette a été atteint en juin 2023, lorsqu'une réduction à court terme de l'effet de levier a été rendue nécessaire pour permettre un rachat au sein du Fonds. Les sources de levier ont été les positions vendeur physiques sur actions et titres à revenu fixe de sociétés, et les placements dans les produits dérivés. Incluant la valeur notionnelle des dérivés utilisés aux fins de couverture, les montants de levier minimaux et maximaux ont varié entre 190 % et 271 %.

Au cours de l'exercice clos le 31 mars 2023, l'exposition globale du Fonds aux sources de levier a varié entre 37 % et 104 % de la valeur liquidative du Fonds. Le haut de la fourchette a été atteint en avril 2022, lorsque les positions actives du Fonds ont nécessité un levier accru pour atteindre les objectifs en matière de profil risque/rendement. Le bas de la fourchette a été atteint en juillet 2022, lorsque les expositions dans l'ensemble du portefeuille étaient généralement plus basses en réaction à la volatilité élevée des marchés. Les sources de levier ont été les positions vendeur physiques sur actions et titres à revenu fixe de sociétés, et les placements dans les produits dérivés. Incluant la valeur notionnelle des dérivés utilisés aux fins de couverture, les montants de levier minimaux et maximaux ont varié entre 150 % et 229 %.

#### l) Engagement

	30 septembre 2023		31 mars 2023	
	Montant appelé (\$ US)	Engagement d'investissement total (\$ US)	Montant appelé (\$ US)	Engagement d'investissement total (\$ US)
Sagard Credit Partners II LP <sup>1)</sup>	136	400	136	400

<sup>1)</sup> Ce fonds est géré par Sagard Holdings Inc., une société affiliée à Mackenzie.

#### m) Placements donnés en garantie

Au 30 septembre 2023, des placements dans des titres d'une juste valeur de 16 826 \$ (21 325 \$ au 31 mars 2023) ont été donnés en garantie en contrepartie de titres vendus à découvert, de contrats de swap et de contrats de change à terme de gré à gré.