

États financiers intermédiaires non audités

Pour la période de six mois close le 30 septembre 2023

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

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

AVIS DE NON-AUDIT DES ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES

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

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



FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL 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)	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)	
ACTIF	\$	\$					
Actifs courants							
Placements à la juste valeur	1 933 801	1 884 531	Série A	12,53	13,15	422 170	460 461
Trésorerie et équivalents de trésorerie	16 895	95 659	Série AR	12,84	13,21	70 164	71 327
Intérêts courus à recevoir	7 215	5 672	Série B	21,08	21,68	4 183	4 707
Dividendes à recevoir	1 624	1 284	Série D	13,75	14,35	5 150	4 343
Sommes à recevoir pour placements vendus	22 230	1 583	Série F	12,51	13,05	405 602	415 435
Sommes à recevoir pour titres émis	548	581	Série F8	11,47	12,15	4 835	5 315
Sommes à recevoir du gestionnaire	662	4	Série FB	9,61	10,04	1 788	2 080
Marge sur instruments dérivés	1 832	23 200	Série G	11,44	11,77	14	14
Actifs dérivés	6 459	3 964	Série GF	14,46	–	26 835	–
Total de l'actif	1 991 266	2 016 478	Série GF8	14,31	–	1 056	–
			Série GLF	14,46	–	4 413	–
			Série GO	14,50	–	48	–
PASSIF			Série GPW	14,41	–	34 068	–
Passifs courants			Série GPWFB	14,46	–	3 977	–
Sommes à payer pour placements achetés	12 090	4 804	Série GPWT8	14,26	–	160	–
Sommes à payer pour titres rachetés	1 808	1 871	Série GPWX	14,50	–	2 543	–
Distributions à verser	–	1	Série GPWX8	14,35	–	2	–
Sommes à payer au gestionnaire	361	313	Série GW	14,41	–	962	–
Obligation pour options vendues	–	204	Série I	13,76	14,16	90	92
Passifs dérivés	7 106	14 501	Série OJ	11,48	11,80	90	92
Total du passif	21 365	21 694	Série O	14,09	14,63	47 574	48 455
Actif net attribuable aux porteurs de titres	1 969 901	1 994 784	Série O5	14,04	14,59	65	3
			Série PW	10,69	11,20	773 056	809 851
			Série PWFB	9,02	9,40	19 870	21 798
			Série PWR	10,48	10,78	28 706	26 500
			Série PWT5	12,45	13,05	54 464	59 395
			Série PWT8	9,99	10,63	5 582	6 458
			Série PWX	14,95	15,53	9 750	10 232
			Série PWX8	11,00	11,60	463	482
			Série R	9,76	–	1	–
			Série S	10,85	11,17	1	1
			Série T5	10,57	11,09	41 354	46 669
			Série T8	11,57	12,33	860	1 074
			Série LB	14,41	–	1	–
			Série LF	14,47	–	1	–
			Série LW	14,41	–	3	–
						1 969 901	1 994 784

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

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

	2023 \$	2022 \$	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	2023	2022
Revenus						
Dividendes	16 893	17 057				
Revenus d'intérêts aux fins de distribution	22 392	20 144				
Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets						
Profit (perte) net(te) réalisé(e)	28 856	(17 685)				
Profit (perte) net(te) latent(e)	(85 709)	(215 157)				
Revenu tiré du prêt de titres	113	78				
Revenu provenant des rabais sur les frais	93	83				
Total des revenus (pertes)	(17 362)	(195 480)				
Charges (note 6)						
Frais de gestion	16 213	16 218				
Rabais sur les frais de gestion	(17)	(13)				
Frais d'administration	1 914	1 919				
Intérêts débiteurs	10	18				
Commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille	337	255				
Frais du comité d'examen indépendant	3	3				
Autre	2	1				
Charges avant les montants absorbés par le gestionnaire	18 462	18 401				
Charges absorbées par le gestionnaire	–	–				
Charges nettes	18 462	18 401				
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, avant impôt	(35 824)	(213 881)				
Impôt étranger retenu à la source	1 779	1 993				
Charge d'impôt étranger sur le résultat (recouvrée)	60	(118)				
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation	(37 663)	(215 756)				
Série A	(0,27)	(1,46)	(9 326)	(54 227)		
Série AR	(0,29)	(1,41)	(1 562)	(7 245)		
Série B	(0,44)	(2,31)	(92)	(557)		
Série D	(0,28)	(1,44)	(89)	(414)		
Série F	(0,19)	(1,34)	(6 193)	(42 361)		
Série F8	(0,16)	(1,31)	(68)	(525)		
Série FB	(0,15)	(1,07)	(29)	(201)		
Série G	(0,22)	(1,23)	–	(1)		
Série GF	(0,28)	–	(533)	–		
Série GF8	(0,29)	–	(20)	–		
Série GLF	(0,29)	–	(90)	–		
Série GO	(0,22)	–	(1)	–		
Série GPW	(0,32)	–	(813)	–		
Série GPWFB	(0,30)	–	(83)	–		
Série GPWT8	(0,33)	–	(3)	–		
Série GPWX	(0,24)	–	(45)	–		
Série GPWX8	(0,25)	–	–	–		
Série GW	(0,29)	–	(22)	–		
Série I	(0,26)	(1,47)	(1)	(10)		
Série OJ	(0,24)	(1,24)	(2)	(10)		
Série O	(0,15)	(1,44)	(507)	(4 570)		
Série O5	(1,92)	(1,42)	(2)	–		
Série PW	(0,22)	(1,22)	(16 047)	(86 312)		
Série PWFB	(0,12)	(0,96)	(282)	(2 084)		
Série PWR	(0,23)	(1,12)	(601)	(2 275)		
Série PWT5	(0,25)	(1,43)	(1 113)	(6 191)		
Série PWT8	(0,19)	(1,20)	(112)	(723)		
Série PWX	(0,15)	(1,72)	(99)	(1 989)		
Série PWX8	(0,11)	(1,17)	(5)	(64)		
Série R	1,60	–	1 018	–		
Série S	(0,11)	(1,06)	–	–		
Série T5	(0,23)	(1,23)	(922)	(5 889)		
Série T8	(0,24)	(1,43)	(19)	(108)		
Série LB	(0,35)	–	–	–		
Série LF	(0,28)	–	–	–		
Série LW	(0,59)	–	–	–		
			(37 663)	(215 756)		

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE LA SITUATION FINANCIÈRE

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

	Total		Série A		Série AR		Série B		Série D	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	1 994 784	2 133 614	460 461	536 000	71 327	68 722	4 707	5 490	4 343	2 732
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(37 663)	(215 756)	(9 326)	(54 227)	(1 562)	(7 245)	(92)	(557)	(89)	(414)
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(17 769)	(16 872)	(2 637)	(2 835)	(408)	(426)	(29)	(34)	(59)	(47)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(33 581)	(38 205)	(8 908)	(11 132)	–	–	–	–	(65)	(71)
Rabais sur les frais de gestion	(17)	(13)	(1)	–	–	–	(1)	(1)	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	(51 367)	(55 090)	(11 546)	(13 967)	(408)	(426)	(30)	(35)	(124)	(118)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	222 350	142 596	30 748	34 727	5 200	5 448	1	5	1 518	2 070
Titres émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	46 171	48 937	11 146	13 440	408	426	27	32	111	107
Paievements au rachat de titres	(204 374)	(195 962)	(59 313)	(65 916)	(4 801)	(3 627)	(430)	(331)	(609)	(358)
Total des opérations sur les titres	64 147	(4 429)	(17 419)	(17 749)	807	2 247	(402)	(294)	1 020	1 819
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	(24 883)	(275 275)	(38 291)	(85 943)	(1 163)	(5 424)	(524)	(886)	807	1 287
À la clôture	1 969 901	1 858 339	422 170	450 057	70 164	63 298	4 183	4 604	5 150	4 019
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :			Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres
Titres en circulation, à l'ouverture			35 021	37 992	5 401	5 071	217	247	303	179
Émis			2 362	2 635	395	429	–	–	107	141
Émis et rachetés à la fusion (note 10)			–	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions			861	1 038	31	33	1	2	8	8
Rachetés			(4 558)	(4 995)	(364)	(283)	(20)	(16)	(43)	(26)
Titres en circulation, à la clôture			33 686	36 670	5 463	5 250	198	233	375	302

	Série F		Série F8		Série FB		Série G		Série GF	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	415 435	431 789	5 315	5 262	2 080	1 935	14	14	–	–
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(6 193)	(42 361)	(68)	(525)	(29)	(201)	–	(1)	(533)	–
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(5 579)	(5 356)	(70)	(66)	(23)	(22)	–	–	(197)	–
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(5 552)	(6 254)	(148)	(164)	(28)	(31)	–	–	(278)	–
Rabais sur les frais de gestion	(1)	(2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	(11 132)	(11 612)	(218)	(230)	(51)	(53)	–	–	(475)	–
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	36 796	32 028	185	716	363	778	–	–	–	–
Titres émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	–	–	–	–	–	–	–	29 198	–
Réinvestissement des distributions	8 543	8 617	26	17	51	53	–	–	451	–
Paievements au rachat de titres	(37 847)	(34 922)	(405)	(577)	(626)	(683)	–	–	(1 806)	–
Total des opérations sur les titres	7 492	5 723	(194)	156	(212)	148	–	–	27 843	–
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	(9 833)	(48 250)	(480)	(599)	(292)	(106)	–	(1)	26 835	–
À la clôture	405 602	383 539	4 835	4 663	1 788	1 829	14	13	26 835	–
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :			Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres
Titres en circulation, à l'ouverture			31 838	31 237	437	395	1	1	–	–
Émis			2 838	2 470	16	58	–	–	–	–
Émis et rachetés à la fusion (note 10)			–	–	–	–	–	–	1 946	–
Réinvestissement des distributions			663	677	2	1	–	–	31	–
Rachetés			(2 923)	(2 715)	(34)	(47)	–	–	(121)	–
Titres en circulation, à la clôture			32 416	31 669	421	407	1	1	1 856	–

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL 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 GF8		Série GLF		Série GO		Série GPW		Série GPWFB	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(20)	-	(90)	-	(1)	-	(813)	-	(83)	-
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(8)	-	(31)	-	-	-	(128)	-	(29)	-
Gains en capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	(22)	-	(44)	-	-	-	(495)	-	(40)	-
Rabais sur les frais de gestion	-	-	-	-	-	-	(1)	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de titres	(30)	-	(75)	-	-	-	(624)	-	(69)	-
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	-	-	-	-	-	-	7	-	-	-
Titres émis et rachetés à la fusion (note 10)	1 106	-	4 503	-	64	-	38 385	-	4 796	-
Réinvestissement des distributions	3	-	75	-	-	-	616	-	69	-
Paiements au rachat de titres	(3)	-	-	-	(15)	-	(3 503)	-	(736)	-
Total des opérations sur les titres	1 106	-	4 578	-	49	-	35 505	-	4 129	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	1 056	-	4 413	-	48	-	34 068	-	3 977	-
À la clôture	1 056	-	4 413	-	48	-	34 068	-	3 977	-
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :	Titres		Titres		Titres		Titres		Titres	
Titres en circulation, à l'ouverture	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Émis	-	-	-	-	-	-	1	-	2	-
Émis et rachetés à la fusion (note 10)	74	-	300	-	4	-	2 559	-	320	-
Réinvestissement des distributions	-	-	5	-	-	-	42	-	5	-
Rachetés	-	-	-	-	(1)	-	(238)	-	(50)	-
Titres en circulation, à la clôture	74	-	305	-	3	-	2 364	-	277	-

	Série GPWT8		Série GPWX		Série GPWX8		Série GW		Série I	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	-	-	-	-	-	-	-	-	92	93
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(3)	-	(45)	-	-	-	(22)	-	(1)	(10)
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(1)	-	(26)	-	-	-	(3)	-	(1)	(1)
Gains en capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	(4)	-	(18)	-	-	-	(14)	-	-	-
Rabais sur les frais de gestion	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de titres	(5)	-	(44)	-	-	-	(17)	-	(1)	(1)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	-	-	-	-	-	-	1	-	-	-
Titres émis et rachetés à la fusion (note 10)	166	-	2 711	-	2	-	1 137	-	-	-
Réinvestissement des distributions	4	-	44	-	-	-	17	-	1	1
Paiements au rachat de titres	(2)	-	(123)	-	-	-	(154)	-	(1)	-
Total des opérations sur les titres	168	-	2 632	-	2	-	1 001	-	-	1
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	160	-	2 543	-	2	-	962	-	(2)	(10)
À la clôture	160	-	2 543	-	2	-	962	-	90	83
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :	Titres		Titres		Titres		Titres		Titres	
Titres en circulation, à l'ouverture	-	-	-	-	-	-	-	-	6	6
Émis	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Émis et rachetés à la fusion (note 10)	11	-	181	-	-	-	76	-	-	-
Réinvestissement des distributions	-	-	3	-	-	-	1	-	1	-
Rachetés	-	-	(9)	-	-	-	(10)	-	-	-
Titres en circulation, à la clôture	11	-	175	-	-	-	67	-	7	6

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL 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 OJ		Série O		Série O5		Série PW		Série PWFB	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	92	101	48 455	46 696	3	3	809 851	843 290	21 798	21 396
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(2)	(10)	(507)	(4 570)	(2)	–	(16 047)	(86 312)	(282)	(2 084)
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(1)	(1)	(893)	(833)	–	–	(5 963)	(5 709)	(290)	(269)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	(423)	(473)	–	–	(14 960)	(16 843)	(290)	(311)
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	(10)	(9)	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	(1)	(1)	(1 316)	(1 306)	–	–	(20 933)	(22 561)	(580)	(580)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	–	–	2 662	7 499	64	–	45 255	45 374	1 833	2 086
Titres émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	1	1	1 143	1 101	–	–	20 200	21 733	578	577
Paievements au rachat de titres	–	–	(2 863)	(5 567)	–	–	(65 270)	(62 501)	(3 477)	(1 516)
Total des opérations sur les titres	1	1	942	3 033	64	–	185	4 606	(1 066)	1 147
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	(2)	(10)	(881)	(2 843)	62	–	(36 795)	(104 267)	(1 928)	(1 517)
À la clôture	90	91	47 574	43 853	65	3	773 056	739 023	19 870	19 879
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres
Titres en circulation, à l'ouverture	8	8	3 311	3 039	–	–	72 299	70 341	2 318	2 148
Émis	–	–	184	517	5	–	4 077	4 034	198	227
Émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	–	–	79	78	–	–	1 830	1 974	62	63
Rachetés	–	–	(197)	(393)	–	–	(5 890)	(5 589)	(374)	(160)
Titres en circulation, à la clôture	8	8	3 377	3 241	5	–	72 316	70 760	2 204	2 278

	Série PWR		Série PWT5		Série PWT8		Série PWX		Série PWX8	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	26 500	21 075	59 395	59 582	6 458	6 820	10 232	22 815	482	496
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(601)	(2 275)	(1 113)	(6 191)	(112)	(723)	(99)	(1 989)	(5)	(64)
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(211)	(179)	(427)	(408)	(46)	(49)	(186)	(320)	(9)	(12)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	(1 063)	(1 215)	(208)	(259)	(88)	(180)	(11)	(18)
Rabais sur les frais de gestion	–	–	(3)	(1)	–	–	–	–	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	(211)	(179)	(1 493)	(1 624)	(254)	(308)	(274)	(500)	(20)	(30)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	3 754	2 853	3 701	4 515	145	804	206	197	–	203
Titres émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	211	179	970	999	124	128	265	489	9	11
Paievements au rachat de titres	(947)	(868)	(6 996)	(3 699)	(779)	(515)	(580)	(7 932)	(3)	(6)
Total des opérations sur les titres	3 018	2 164	(2 325)	1 815	(510)	417	(109)	(7 246)	6	208
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	2 206	(290)	(4 931)	(6 000)	(876)	(614)	(482)	(9 735)	(19)	114
À la clôture	28 706	20 785	54 464	53 582	5 582	6 206	9 750	13 080	463	610
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres
Titres en circulation, à l'ouverture	2 458	1 905	4 552	4 266	608	579	659	1 399	42	39
Émis	348	274	286	347	14	72	13	13	–	17
Émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	20	17	75	78	12	12	17	32	1	1
Rachetés	(88)	(83)	(539)	(287)	(75)	(47)	(37)	(533)	(1)	(1)
Titres en circulation, à la clôture	2 738	2 113	4 374	4 404	559	616	652	911	42	56

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL 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 R		Série S		Série T5		Série T8	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES								
À l'ouverture	–	–	1	1	46 669	58 158	1 074	1 144
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	1 018	–	–	–	(922)	(5 889)	(19)	(108)
Distributions aux porteurs de titres :								
Revenu de placement	(251)	–	–	–	(257)	(300)	(6)	(5)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	–	–	(888)	(1 215)	(34)	(39)
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	(251)	–	–	–	(1 145)	(1 515)	(40)	(44)
Opérations sur les titres :								
Produit de l'émission de titres	87 213	–	–	–	2 666	3 173	27	120
Titres émis et rachetés à la fusion (note 10)	(82 068)	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	251	–	–	–	813	1 013	14	13
Paiements au rachat de titres	(6 162)	–	–	–	(6 727)	(6 633)	(196)	(311)
Total des opérations sur les titres	(766)	–	–	–	(3 248)	(2 447)	(155)	(178)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	1	–	–	–	(5 315)	(9 851)	(214)	(330)
À la clôture	1	–	1	1	41 354	48 307	860	814
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :	Titres		Titres		Titres		Titres	
Titres en circulation, à l'ouverture	–	–	–	–	4 208	4 886	87	83
Émis	8 777	–	–	–	244	286	2	11
Émis et rachetés à la fusion (note 10)	(8 187)	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	25	–	–	–	74	93	1	1
Rachetés	(615)	–	–	–	(613)	(599)	(16)	(25)
Titres en circulation, à la clôture	–	–	–	–	3 913	4 666	74	70

	Série LB		Série LF		Série LW	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES						
À l'ouverture	–	–	–	–	–	–
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	–	–	–	–	–	–
Distributions aux porteurs de titres :						
Revenu de placement	–	–	–	–	–	–
Gains en capital	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	–	–	–	–
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	–	–	–	–	–	–
Opérations sur les titres :						
Produit de l'émission de titres	1	–	1	–	3	–
Titres émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	–	–	–	–	–	–
Paiements au rachat de titres	–	–	–	–	–	–
Total des opérations sur les titres	1	–	1	–	3	–
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	1	–	1	–	3	–
À la clôture	1	–	1	–	3	–
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :	Titres		Titres		Titres	
Titres en circulation, à l'ouverture	–	–	–	–	–	–
Émis	–	–	–	–	–	–
Émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	–	–	–	–	–	–
Rachetés	–	–	–	–	–	–
Titres en circulation, à la clôture	–	–	–	–	–	–

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL 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
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation	(37 663)	(215 756)
Ajustements pour :		
Perte (profit) net(te) réalisé(e) sur les placements	(28 066)	41 833
Variation de la perte (du profit) net(te) latent(e) sur les placements	85 883	216 059
Achat de placements	(637 761)	(454 820)
Produit de la vente et de l'échéance de placements	506 974	398 538
(Augmentation) diminution des sommes à recevoir et autres actifs	18 827	(756)
Augmentation (diminution) des sommes à payer et autres passifs	48	19
Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités d'exploitation	(91 758)	(14 883)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de titres	192 984	109 312
Paiements au rachat de titres	(175 039)	(161 483)
Distributions versées, déduction faite des réinvestissements	(5 197)	(6 151)
Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités de financement	12 748	(58 322)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie	(79 010)	(73 205)
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à l'ouverture	95 659	131 141
Incidence des fluctuations des taux de change sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie	246	1 255
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture	16 895	59 191
Trésorerie	16 895	59 191
Équivalents de trésorerie	–	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture	16 895	59 191
Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :		
Dividendes reçus	16 553	16 905
Impôts étrangers payés	1 839	1 875
Intérêts reçus	20 849	19 540
Intérêts versés	10	18

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL 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 \$)
OBLIGATIONS					
407 International Inc. 1,80 % 22-05-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 036 000	1 045	978
407 International Inc. 4,22 % 14-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	790 000	790	753
407 International Inc. 3,14 % 06-03-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	300 000	303	268
407 International Inc. 3,43 % 01-06-2033, série MTN	Canada	Sociétés – Non convertibles	256 000	278	221
407 International Inc. 4,19 % 25-04-2042, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	154 000	172	133
407 International Inc. 3,60 % 21-05-2047, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	710 000	713	545
407 International Inc. 4,86 % 31-07-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	750 000	749	700
AerCap Ireland Capital DAC 3,00 % 29-10-2028	Irlande	Sociétés – Non convertibles	450 000 USD	518	524
Aéroports de Montréal 3,92 % 12-06-2045, rachetables 2044	Canada	Sociétés – Non convertibles	54 000	50	44
AES Panama Generation Holdings SRL 4,38 % 31-05-2030, rachetables 2030	Panama	Sociétés – Non convertibles	5 480 491 USD	7 039	6 344
AIMCo Realty Investors LP 2,20 % 04-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	630 000	630	569
AIMCo Realty Investors LP 2,71 % 01-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000	90	86
Albertsons Cos. Inc. 4,63 % 15-01-2027, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	750 000 USD	1 034	962
Algonquin Power & Utilities Corp. 4,60 % 29-01-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	117 000	112	110
Algonquin Power & Utilities Corp. 2,85 % 15-07-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 455 000	2 989	2 801
Algonquin Power & Utilities Corp., taux variable 18-01-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	780 000	780	620
Alimentation Couche-Tard inc. 2,95 % 25-01-2030, rachetables 2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	620 000 USD	815	703
Alimentation Couche-Tard inc. 5,59 % 25-09-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 610 000	1 610	1 608
AltaGas Ltd. 4,64 % 15-05-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	380 000	380	369
AltaGas Ltd. 2,17 % 16-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	410 000	410	362
AltaGas Ltd., taux variable 11-01-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	490 000	490	388
AltaGas Ltd., taux variable 17-08-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	119 000	119	115
AltaLink, L.P. 1,51 % 11-09-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	440 000	440	346
Altice International SARL 5,00 % 15-01-2028, rachetables 2023 144A	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	227	233
Amaggi Luxembourg International SARL 5,25 % 28-01-2028	Bésil	Sociétés – Non convertibles	830 000 USD	1 048	1 033
Amazon.com Inc. 4,70 % 01-12-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 150 000 USD	1 562	1 496
América Móvil SAB de CV 9,50 % 27-01-2031	Mexique	Sociétés – Non convertibles	99 110 000 MXN	7 629	7 274
American Tower Corp. 1,88 % 15-10-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	500 000 USD	666	514
Anglian Water Services Financing PLC 4,53 % 26-08-2032	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	550 000	550	493
Apple Inc. 3,35 % 10-01-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 810 000 AUD	1 747	1 576
Apple Inc. 2,65 % 11-05-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	4 799 000 USD	4 724	4 011
ARC Resources Ltd. 2,35 % 10-03-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	506 000	506	467
ARD Finance SA 6,50 % 30-06-2027 144A	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	133	103
Ardagh Packaging Finance PLC 5,25 % 15-08-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	144 000 USD	164	163
Ascend Wellness Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 27-08-2025	États-Unis	Prêts à terme	390 000 USD	490	451
Athene Global Funding, taux variable 09-04-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 540 000	1 540	1 535
Athene Global Funding 3,13 % 10-03-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	590 000	590	562
Athene Global Funding 2,10 % 24-09-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	840 000	839	771
Bank of America Corp., taux variable 15-09-2027 (taux variable différé)	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	259 000	247	231
Bank of America Corp., taux variable 16-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	730 000	730	676
Bank of America Corp., taux variable 04-04-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	611 000	611	531
Banque de Montréal 2,70 % 11-09-2024, série DPNT	Canada	Sociétés – Non convertibles	160 000	164	156
Banque de Montréal 4,71 % 07-12-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	48 000	49	46
Banque de Montréal, taux variable 27-10-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	60 000	62	60
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 327 000	2 328	2 255
La Banque de Nouvelle-Écosse 2,16 % 03-02-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	761 000	725	726
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 27-07-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 543 000	1 528	1 477
BCE Inc. 2,20 % 29-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	870 000	869	750
BCE Inc. 3,00 % 17-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	766 000	679	637
BCE Inc. 5,85 % 10-11-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	460 000	469	459
BCI QuadReal Realty 2,55 % 24-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 340 000	1 340	1 237
bclMC Realty Corp. 1,06 % 12-03-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	400 000	400	392
bclMC Realty Corp. 1,07 % 04-02-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	558 000	558	502
Bece SAB de CV 2,50 % 14-10-2031	Mexique	Sociétés – Non convertibles	2 370 000 USD	2 970	2 462
Bell Canada 5,15 % 14-11-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	670 000	669	656
BP Capital Markets PLC 3,47 % 15-05-2025	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	110 000	114	106
Broadcast Media Partners Holdings Inc. 4,50 % 01-05-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	170 000 USD	206	189
Broadcom Inc. 4,11 % 15-09-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	214 000 USD	268	269

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL 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 \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Brookfield Infrastructure Finance ULC 4,20 % 11-09-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	522 000	518	483
Brookfield Infrastructure Finance ULC 2,86 % 01-09-2032, rachetables 2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	133 000	133	103
Brookfield Renewable Energy Partners ULC 3,63 % 15-01-2027, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 199 000	2 235	2 056
Brookfield Renewable Partners ULC 4,25 % 15-01-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	676 000	676	630
Brookfield Residential Properties Inc. 5,13 % 15-06-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	221 000	221	182
Bruce Power L.P. 2,68 % 21-12-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	355 000	355	309
Bruce Power L.P. 4,00 % 21-06-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	677 000	664	615
CAE Inc. 5,54 % 12-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	540 000	540	529
Canadian Core Real Estate LP 3,30 % 02-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	670 000	670	604
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 21-04-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 232 000	1 232	1 107
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 28-07-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	54 000	54	52
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada 4,40 % 10-05-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	600 000	599	558
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 2,54 % 28-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 905 000	1 842	1 691
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 3,15 % 13-03-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 830 000	3 008	2 530
CAP SA 3,90 % 27-04-2031	Chili	Sociétés – Non convertibles	800 000 USD	1 000	808
Capital Power Corp. 4,28 % 18-09-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 052 000	2 099	2 021
Capital Power Corp. 4,99 % 23-01-2026, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	700 000	700	684
Capital Power Corp. 5,82 % 15-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	590 000	590	584
Capital Power Corp. 3,15 % 01-10-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	743 000	747	587
Capital Power Corp., taux variable 09-09-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	311 000	311	299
Celulosa Arauco y Constitución SA 4,20 % 29-01-2030, rachetables 2029	Chili	Sociétés – Non convertibles	2 100 000 USD	2 758	2 443
Cemex SAB de CV, taux variable 08-09-2169	Mexique	Sociétés – Non convertibles	600 000 USD	726	764
Cenovus Energy Inc. 3,50 % 07-02-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 330 000	1 326	1 224
Cenovus Energy Inc. 3,75 % 15-02-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 228 000 USD	2 241	2 002
Centrais Elétricas Brasileiras SA 3,63 % 04-02-2025	Brésil	Sociétés – Non convertibles	530 000 USD	699	687
Charter Communications Operating LLC 2,80 % 01-04-2031, rachetables 2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	520 000 USD	727	553
Charter Communications Operating LLC 2,30 % 01-02-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	630 000 USD	821	627
Charter Communications Operating LLC 3,50 % 01-06-2041	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	330 000 USD	417	285
Chevron U.S.A. Inc. 2,34 % 12-08-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	4 455 000 USD	4 123	3 428
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 2,46 % 30-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	350 000	350	316
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 5,40 % 01-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 260 000	1 260	1 189
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 5,70 % 28-02-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	881 000	877	845
CIFI Holdings (Group) Co. Ltd. 6,00 % 16-07-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	1 066 000 USD	344	103
Ville d'Oslo 3,65 % 08-11-2023	Norvège	Gouvernements étrangers	4 000 000 NOK	713	507
The Clorox Co. 1,80 % 15-05-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	600 000 USD	838	645
Coca-Cola FEMSA SAB de CV 2,75 % 22-01-2030, rachetables 2029	Mexique	Sociétés – Non convertibles	863 000 USD	1 113	991
Cogeco Communications inc. 2,99 % 22-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	530 000	530	427
Colbún SA 3,15 % 19-01-2032	Chili	Sociétés – Non convertibles	660 000 USD	815	721
Cologix Data Centers Issuer LLC 4,94 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	200 000	200	180
Cologix Data Centers Issuer LLC 5,68 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	160 000	160	143
Columbia Care Inc. 6,00 % 29-06-2025, conv.	Canada	Sociétés – Convertibles	170 000 USD	209	179
Columbia Care Inc. 9,50 % 03-02-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000 USD	151	140
CommScope Inc. 4,75 % 01-09-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	125	99
CommScope Technologies Finance LLC 8,25 % 01-03-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	316 000 USD	417	282
Connect Finco SARL 6,75 % 01-10-2026	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	140 000 USD	186	178
Continental Resources Inc. 5,75 % 15-01-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 468 000 USD	4 406	4 439
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	490 910	491	445
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-09-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	494 827	495	448
Corp Nacional del Cobre de Chile 4,50 % 16-09-2025	Chili	Sociétés – Non convertibles	1 972 000 USD	2 632	2 612
Corus Entertainment Inc. 5,00 % 11-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	207 000	207	140
Country Garden Holdings Co. Ltd. 2,70 % 12-07-2026	Chine	Sociétés – Non convertibles	1 625 000 USD	1 382	148
Country Garden Holdings Co. Ltd. 5,63 % 14-01-2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	2 349 000 USD	1 948	206
CPPIB Capital Inc. 1,95 % 30-09-2029	Canada	Gouvernement fédéral	1 442 000	1 441	1 240
CPPIB Capital Inc. 3,95 % 02-06-2032	Canada	Gouvernement fédéral	912 000	909	858

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL 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 \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Credicorp Ltd. 2,75 % 17-06-2025, rachetables 2025	Pérou	Sociétés – Non convertibles	300 000 USD	399	382
Fonds de placement immobilier Crombie 3,92 % 21-06-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	116 000	116	107
Fonds de placement immobilier Crombie 3,21 % 09-10-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 280 000	2 342	1 860
Fonds de placement immobilier Crombie 3,13 % 12-08-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	216 000	216	170
Curaleaf Holdings Inc. 8,00 % 15-12-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	680 000 USD	872	764
DIRECTV Holdings LLC 5,88 % 15-08-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	128 000 USD	161	154
Dollarama inc. 5,08 % 27-10-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	357 000	356	353
Dollarama inc. 5,53 % 26-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	770 000	770	769
Domtar Corp. 6,75 % 01-10-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	369 000 USD	466	415
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 1,66 % 22-12-2025 (A)	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 080 000	3 079	2 797
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,54 % 07-12-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	480 000	480	429
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,06 % 17-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	520 000	520	449
Ecopetrol SA 6,88 % 29-04-2030, rachetables 2030	Colombie	Sociétés – Non convertibles	2 520 000 USD	3 384	3 134
Ecopetrol SA 4,63 % 02-11-2031	Colombie	Sociétés – Non convertibles	1 696 000 USD	1 746	1 762
Electronic Arts Inc. 2,95 % 15-02-2051	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 228 000 USD	2 100	1 845
L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie 3,63 % 17-04-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000	50	39
Empresas CMPC SA 3,00 % 06-04-2031	Chili	Sociétés – Non convertibles	985 000 USD	1 229	1 065
Enbridge Inc. 4,90 % 26-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	430 000	430	415
Enbridge Inc. 3,10 % 21-09-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 130 000	1 128	887
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	12 100 000	11 577	10 909
Enbridge Inc., taux variable 12-04-2078, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 870 000	3 864	3 643
Enel Finance International NV 5,00 % 15-06-2032 144A	Italie	Sociétés – Non convertibles	520 000 USD	634	641
Enel SPA 2,25 % 12-07-2031 144A	Italie	Sociétés – Non convertibles	270 000 USD	290	278
Énergir inc. 2,10 % 16-04-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	460 000	460	413
Énergir inc. 4,67 % 27-09-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	510 000	510	485
EPCOR Utilities Inc. 3,55 % 27-11-2047, rachetables 2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	750 000	750	569
EPCOR Utilities Inc. 3,11 % 08-07-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	950 000	950	657
EPCOR Utilities Inc. 4,73 % 02-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	700 000	700	641
Exxon Mobil Corp. 3,10 % 16-08-2049	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	4 455 000 USD	4 552	3 995
Fairfax Financial Holdings Ltd. 8,30 % 15-04-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 070 000 USD	1 617	1 507
Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,23 % 14-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	370 000	370	335
Fairfax Financial Holdings Ltd. 3,95 % 03-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	752 000	754	634
Fairfax India Holdings Corp. 5,00 % 26-02-2028 144A	Inde	Sociétés – Non convertibles	1 360 000 USD	1 702	1 588
Fonds de placement immobilier First Capital 3,45 % 01-03-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	440 000	389	382
First West Credit Union 9,19 % 09-08-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	550 000	550	545
Flynn America LP, prêt à terme B de premier rang, taux variable 23-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	506 813 USD	618	654
Compagnie Crédit Ford du Canada 2,96 % 16-09-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	350 000	350	313
Ford Motor Credit Co. LLC 6,78 % 15-09-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 170 000	1 170	1 169
Fortified Trust 1,96 % 23-10-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 470 000	1 470	1 315
Fortis Inc. 4,43 % 31-05-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 165 000	1 166	1 102
Frontera Generation Holdings LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 28-07-2026	États-Unis	Prêts à terme	24 442 USD	31	8
Frontera Generation Holdings LLC, prêt à terme de second rang, taux variable 26-04-2028	États-Unis	Prêts à terme	23 724 USD	17	1
Financière General Motors du Canada Ltée 5,20 % 09-02-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	420 000	420	402
GFL Environmental Inc. 5,13 % 15-12-2026 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	140 000 USD	185	181
GFL Environmental Inc. 3,50 % 01-09-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	52 000 USD	66	61
Gibson Energy Inc. 2,85 % 14-07-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	320 000	325	287
Gibson Energy Inc., taux variable 22-12-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	225 000	226	184
GoDaddy Operating Co. LLC 3,50 % 01-03-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	15 000 USD	18	17
The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 30-11-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 440 000	1 440	1 300
The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 28-02-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	567 000	567	480
Gouvernement de l'Australie 1,75 % 21-06-2051	Australie	Gouvernements étrangers	13 600 000 AUD	7 347	6 312
Gouvernement des Bahamas 5,75 % 16-01-2024	Bahamas	Gouvernements étrangers	1 210 000 USD	1 677	1 626
Gouvernement des Bahamas 6,95 % 20-11-2029	Bahamas	Gouvernements étrangers	1 460 000 USD	2 152	1 619
Gouvernement des Bahamas 8,95 % 15-10-2032	Bahamas	Gouvernements étrangers	1 200 000 USD	1 581	1 405
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2027	Brésil	Gouvernements étrangers	4 100 000 BRL	10 379	10 813
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2029	Brésil	Gouvernements étrangers	5 000 000 BRL	14 599	12 837
Gouvernement du Canada 0,75 % 01-02-2024	Canada	Gouvernement fédéral	125 000	121	123
Gouvernement du Canada 3,75 % 01-02-2025	Canada	Gouvernement fédéral	100 000	99	98

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL 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 \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Gouvernement du Canada 3,75 % 01-05-2025	Canada	Gouvernement fédéral	3 000	3	3
Gouvernement du Canada 1,25 % 01-03-2027	Canada	Gouvernement fédéral	1 204 000	1 108	1 083
Gouvernement du Canada 3,50 % 01-03-2028	Canada	Gouvernement fédéral	13 600 000	13 258	13 158
Gouvernement du Canada 2,50 % 01-12-2032	Canada	Gouvernement fédéral	301 000	289	266
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-06-2033	Canada	Gouvernement fédéral	1 583 000	1 496	1 422
Gouvernement du Canada 2,00 % 01-12-2051	Canada	Gouvernement fédéral	300 000	237	206
Gouvernement du Canada 1,75 % 01-12-2053	Canada	Gouvernement fédéral	85 000	55	54
Gouvernement de l'Allemagne 0 % 15-08-2052	Allemagne	Gouvernements étrangers	23 760 000 EUR	23 615	14 664
Gouvernement d'Israël 0 % 11-10-2023	Israël	Gouvernements étrangers	23 900 000 ILS	9 066	8 511
Gouvernement du Japon 0 % 02-10-2023	Japon	Gouvernements étrangers	2 037 000 000 JPY	19 120	18 505
Gouvernement du Mexique 8,50 % 31-05-2029	Mexique	Gouvernements étrangers	211 600 000 MXN	16 290	15 463
Gouvernement du Mexique 2,66 % 24-05-2031	Mexique	Gouvernements étrangers	8 800 000 USD	10 531	9 428
Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 4,50 % 15-05-2030	Nouvelle-Zélande	Gouvernements étrangers	7 700 000 NZD	6 329	5 836
Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 3,50 % 14-04-2033	Nouvelle-Zélande	Gouvernements étrangers	34 100 000 NZD	25 658	24 029
Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 4,25 % 15-05-2034	Nouvelle-Zélande	Gouvernements étrangers	15 910 000 NZD	12 823	11 796
Gouvernement de l'Afrique du Sud 8,88 % 28-02-2035	Afrique du Sud	Gouvernements étrangers	256 000 000 ZAR	15 138	14 500
Gouvernement des Bahamas 9,00 % 16-06-2029	Bahamas	Gouvernements étrangers	1 500 000 USD	1 524	1 828
GPS Blue Financing DAC 5,65 % 09-11-2041	Irlande	Sociétés – Non convertibles	4 600 000 USD	6 486	6 021
Fiducie de placement immobilier Granite 3,06 % 04-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	330 000	308	298
Fiducie de placement immobilier Granite 2,19 % 30-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 093 000	2 788	2 589
Fiducie de placement immobilier Granite 2,38 % 18-12-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	760 000	627	593
Gray Escrow Inc. 7,00 % 15-05-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	80 000 USD	97	93
Gray Television Inc. 5,38 % 15-11-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	570 000 USD	706	506
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 1,54 % 03-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 950 000	2 602	2 533
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 6,47 % 02-02-2034, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	128 000	148	139
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 3,15 % 05-10-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000	97	84
Grupo GICSA SAB de CV 9,50 % 18-12-2034	Mexique	Sociétés – Non convertibles	19 428 500 MXN	1 328	920
Fonds de placement immobilier H&R 3,37 % 30-01-2024, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	400 000	415	397
HCA Healthcare Inc. 3,50 % 01-09-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	228 000 USD	303	263
Heathrow Funding Ltd. 3,25 % 21-05-2025	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	346 000	364	331
Heathrow Funding Ltd. 2,69 % 13-10-2027	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	960 000	960	854
Heathrow Funding Ltd. 3,79 % 04-09-2030, rachetables 2030	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	990 000	990	867
Heathrow Funding Ltd. 3,73 % 13-04-2033	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	510 000	529	421
Hidrovias do Brasil SA 4,95 % 08-02-2031	Brésil	Sociétés – Non convertibles	300 000 USD	383	327
Compagnie Home Trust 5,32 % 13-06-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	720 000	720	711
Honda Canada Finance Inc. 4,87 % 23-09-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 359 000	1 362	1 319
Honda Canada Finance Inc. 5,73 % 28-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	520 000	520	521
Hydro One Inc. 1,69 % 16-01-2031, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 017 000	1 958	1 592
Hydro One Inc. 2,23 % 17-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 524 000	2 436	2 040
Hydro One Ltd. 1,41 % 15-10-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	620 000	620	535
iA Société financière inc., taux variable 20-06-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	450 000	450	440
iA Société financière inc., taux variable 25-02-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 490 000	1 490	1 353
L'Ordre Indépendant des Forestiers, taux variable 15-10-2035, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	490 000	490	385
Indy US Bidco LLC, prêt à terme B3 de premier rang, taux variable 05-03-2028	États-Unis	Prêts à terme	251 856 USD	320	328
Intact Corporation financière 5,46 % 22-09-2032 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	470 000 USD	623	606
Intact Corporation financière, taux variable 31-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	180 000	180	154
Inter Pipeline Ltd. 2,73 % 18-04-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	922 000	942	907
Inter Pipeline Ltd. 3,48 % 16-12-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	670 000	656	621
Inter Pipeline Ltd. 4,23 % 01-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 884 000	1 934	1 768
Inter Pipeline Ltd. 5,76 % 17-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	450 000	450	443
Inter Pipeline Ltd. 5,71 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	470 000	470	452
Inter Pipeline Ltd. 3,98 % 25-11-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 580 000	3 580	3 007
Inter Pipeline Ltd., taux variable 26-03-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	380 000	380	351
Inter Pipeline Ltd., taux variable 19-11-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	660 000	660	595
Interconexión Eléctrica SA ESP 3,83 % 26-11-2033	Colombie	Sociétés – Non convertibles	3 650 000 USD	4 414	4 069
Banque internationale pour la reconstruction et le développement 6,25 % 12-01-2028	Supranationales	s.o.	53 000 000 000 IDR	4 664	4 659
Société Financière Internationale 0 % 22-02-2038	Supranationales	s.o.	280 000 000 MXN	5 458	5 185
Ivanhoe Cambridge II Inc. 2,30 % 12-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	379 000	379	364
Jadex Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 12-02-2028	États-Unis	Prêts à terme	548 005 USD	709	703

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL 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 \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Jazz Pharmaceuticals PLC 4,38 % 15-01-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	250	238
JPMorgan Chase & Co. 1,90 % 05-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 580 000	1 580	1 389
Kaisa Group Holdings Ltd. 9,38 % 30-06-2024	Chine	Sociétés – Non convertibles	400 000 USD	359	33
Kaisa Group Holdings Ltd. 11,70 % 11-11-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	1 200 000 USD	1 447	98
Kaisa Group Holdings 8,65 % 27-10-2023	Chine	Sociétés – Non convertibles	900 000 USD	396	72
Kaisa Group Holdings 10,50 % 27-10-2023	Chine	Sociétés – Non convertibles	1 900 000 USD	1 132	153
Keyera Corp. 3,96 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 270 000	2 466	2 013
Keyera Corp., taux variable 13-06-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	440 000	441	408
Keyera Corp., taux variable 10-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	610 000	610	520
Kleopatra Finco SARL 4,25 % 01-03-2026	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	100 000 EUR	121	120
Knight Health Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 17-12-2028	États-Unis	Prêts à terme	520 725 USD	622	183
KP Germany Erste GmbH, prêt à terme B de premier rang, taux variable 04-02-2026	Allemagne	Prêts à terme	320 000 EUR	489	434
Kronos Acquisition Holdings Inc. 5,00 % 31-12-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	30 000 USD	37	37
Produits Kruger S.E.C. 6,00 % 24-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000	200	193
Produits Kruger S.E.C. 5,38 % 09-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	110 000	110	94
LABL Escrow Issuer LLC 6,75 % 15-07-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	136 000 USD	182	179
LABL Escrow Issuer LLC 10,50 % 15-07-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	233 000 USD	310	297
LABL Inc. 8,25 % 01-11-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	246 000 USD	279	273
Liberty Utilities (Canada) LP 3,32 % 14-02-2050, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	360 000	360	242
LifeScan Global Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 31-12-2026	États-Unis	Prêts à terme	358 940 USD	456	390
Les Compagnies Loblaw Itée 4,49 % 11-12-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000	44	38
Les Compagnies Loblaw Itée 2,28 % 07-05-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	498 000	501	411
Les Compagnies Loblaw Itée 5,34 % 13-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	470 000	470	444
Logan Group Co. Ltd. 4,70 % 06-07-2026	Chine	Sociétés – Non convertibles	3 483 000 USD	2 636	342
Lower Mattagami Energy LP 2,43 % 14-05-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	680 000	680	561
LSF10 XL Bidco SCA, prêt à terme B de premier rang, taux variable 30-03-2028	Luxembourg	Prêts à terme	315 784 EUR	465	392
Luxembourg Investment Co. 428 SARL, prêt à terme B de premier rang, taux variable 22-10-2028	Luxembourg	Prêts à terme	391 147 USD	477	390
Magenta Buyer LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 03-05-2028	États-Unis	Prêts à terme	330 884 USD	404	337
Magna International Inc. 4,95 % 31-01-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	570 000	570	546
Banque Manuvie du Canada 1,54 % 14-09-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 030 000	1 030	918
Société Financière Manuvie, taux variable 10-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 210 000	1 210	1 175
Société Financière Manuvie, taux variable 19-03-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	780 000	780	568
Société Financière Manuvie, taux variable 19-06-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	800 000	800	769
MARB BondCo PLC 3,95 % 29-01-2031	Brésil	Sociétés – Non convertibles	500 000 USD	515	504
Mattamy Group Corp. 4,63 % 01-03-2030, rachetables 2025 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	161 000 USD	180	186
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 7,88 % 15-08-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	366 000 USD	490	480
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 9,25 % 15-04-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	666 000 USD	904	792
Metro inc. 4,66 % 07-02-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	165 000	162	154
Mexico Remittances Funding Fiduciary Estate Management SARL 4,88 % 15-01-2028	Mexique	Sociétés – Non convertibles	1 737 000 USD	2 197	2 122
Micron Technology Inc. 5,38 % 15-04-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 606 000 USD	2 159	2 106
Microsoft Corp. 2,53 % 01-06-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	7 425 000 USD	7 155	6 211
Minerva Luxembourg SA 8,88 % 13-09-2033	Brésil	Sociétés – Non convertibles	300 000 USD	409	405
Minerva Merger Sub Inc. 6,50 % 15-02-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	470 000 USD	599	534
Mozart Debt Merger Sub Inc. 3,88 % 01-04-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	473 000 USD	599	543
Mozart Debt Merger Sub Inc. 5,25 % 01-10-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	700 000 USD	884	822
NAV CANADA 2,06 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	420 000	420	349
Nederlandse Waterschapsbank NV 1,00 % 28-05-2030	Pays-Bas	Gouvernements étrangers	1 200 000 USD	1 655	1 272
Nestlé Holdings Inc. 2,19 % 26-01-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	760 000	760	657
New Red Finance Inc. 4,00 % 15-10-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	130 000 USD	171	147
Nexstar Escrow Inc. 5,63 % 15-07-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	232 000 USD	308	281
North West Redwater Partnership Co. Ltd. 2,80 % 01-06-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 460 000	1 457	1 212
North West Redwater Partnership Co. Ltd. 3,70 % 23-02-2043, rachetables 2042	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000	99	78
North West Redwater Partnership 3,20 % 22-07-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	680 000	681	667
Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc. 4,11 % 31-03-2042	Canada	Sociétés – Non convertibles	747 798	748	614
NVIDIA Corp. 3,50 % 01-04-2050, rachetables 2049	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 228 000 USD	2 457	2 211

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Occidental Petroleum Corp. 6,13 % 01-01-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 296 000 USD	4 400	4 413
OMERS Finance Trust 2,60 % 14-05-2029	Canada	Gouvernements provinciaux	852 000	851	760
Ontario Power Generation Inc. 2,89 % 08-04-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	420 000	403	404
Ontario Power Generation Inc. 1,17 % 22-04-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	280 000	249	252
Ontario Power Generation Inc. 2,98 % 13-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	696 000	731	615
Ontario Teachers' Finance Trust 1,10 % 19-10-2027	Canada	Gouvernements provinciaux	490 000	489	423
Régime de retraite des enseignantes et des enseignants de l'Ontario 4,45 % 02-06-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	720 000	718	695
Corporation Parkland du Canada 3,88 % 16-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 860 000	1 860	1 723
Corporation Parkland du Canada 4,38 % 26-03-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	140 000	140	122
Corporation Parkland du Canada 4,50 % 01-10-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	390 000 USD	491	457
Corporation Pétroles Parkland 5,88 % 15-07-2027 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	26 000 USD	34	34
Corporation Pétroles Parkland 6,00 % 23-06-2028, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 080 000	1 075	1 031
PayPal Holdings Inc. 2,65 % 01-10-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	600 000 USD	794	752
PayPal Holdings Inc. 2,30 % 01-06-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	370 000 USD	518	412
Pembina Pipeline Corp. 4,02 % 27-03-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 470 000	2 590	2 291
Pembina Pipeline Corp. 4,81 % 25-03-2044	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000	32	25
Pembina Pipeline Corp., taux variable 25-01-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	810 000	810	653
Petróleos de Venezuela SA 6,00 % 16-05-2024	Venezuela	Sociétés – Non convertibles	480 000 USD	153	38
Petróleos Mexicanos 5,95 % 28-01-2031 144A	Mexique	Sociétés – Non convertibles	4 626 000 USD	5 551	4 495
Petróleos Mexicanos 6,70 % 16-02-2032	Mexique	Sociétés – Non convertibles	3 381 000 USD	4 338	3 403
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 4,65 % 19-05-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 600 000 USD	3 499	3 383
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 4,75 % 19-05-2033	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	800 000 USD	1 077	1 030
Pioneer Natural Resources Co. 2,15 % 15-01-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 228 000 USD	2 410	2 388
Province de l'Alberta 4,15 % 01-06-2033	Canada	Gouvernements provinciaux	890 000	869	848
Province de l'Alberta 3,10 % 01-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	5 210 000	4 867	3 852
Province du Manitoba 3,80 % 05-09-2053	Canada	Gouvernements provinciaux	70 000	65	58
Province de l'Ontario 4,05 % 02-02-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	4 670 000	4 666	4 449
Province de l'Ontario 3,65 % 02-06-2033	Canada	Gouvernements provinciaux	4 247 000	3 942	3 882
Province de l'Ontario 4,15 % 02-12-2054	Canada	Gouvernements provinciaux	842 000	803	760
Province de Québec 3,65 % 20-05-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	1 410 000	1 410	1 303
Province de Québec 4,40 % 01-12-2055	Canada	Gouvernements provinciaux	80 000	85	75
Province de la Saskatchewan 3,10 % 02-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	10 000	10	7
PSP Capital Inc. 2,05 % 15-01-2030	Canada	Gouvernement fédéral	185 000	186	159
PSP Capital Inc. 2,60 % 01-03-2032	Canada	Gouvernement fédéral	1 320 000	1 316	1 122
Quasar Intermediate Holdings Ltd., prêt à terme B de premier rang, taux variable 20-01-2029	États-Unis	Prêts à terme	396 000 USD	490	450
Reliance LP 2,68 % 01-12-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	430 000	430	375
Reliance LP 2,67 % 01-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	650 000	650	555
Renesas Electronics Corp. 1,54 % 26-11-2024	Japon	Sociétés – Non convertibles	560 000 USD	706	717
Renesas Electronics Corp. 2,17 % 25-11-2026	Japon	Sociétés – Non convertibles	650 000 USD	819	780
Fonds de placement immobilier RioCan 5,96 % 01-10-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	780 000	780	757
Rogers Communications Inc. 3,10 % 15-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 709 000	1 635	1 638
Rogers Communications Inc. 5,70 % 21-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 440 000	1 438	1 425
Rogers Communications Inc. 3,75 % 15-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 879 000	1 869	1 688
Rogers Communications Inc. 2,90 % 09-12-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 390 000	1 407	1 134
Rogers Communications Inc. 5,25 % 15-04-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	329 000	327	282
Rogers Communications Inc., taux variable 15-03-2082 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	368 000 USD	467	443
Banque Royale du Canada 4,61 % 26-07-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	101 000	100	97
Banque Royale du Canada, taux variable 03-11-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	301 000	268	266
Sagen MI Canada Inc. 3,26 % 05-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	570 000	570	446
Sagen MI Canada Inc., taux variable 24-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	420 000	420	350
Saputo inc. 2,88 % 19-11-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	360 000	360	349
Secure Energy Services Inc. 7,25 % 30-12-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	150 000	151	148
Sienna Senior Living Inc. 3,11 % 04-11-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	260 000	260	250
Sienna Senior Living Inc. 3,45 % 27-02-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	330 000	330	305
Sienna Senior Living Inc. 2,82 % 31-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 310 000	2 408	2 028
Signal Parent Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-04-2028	États-Unis	Prêts à terme	177 838 USD	223	205
Silgan Holdings Inc. 4,13 % 01-02-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	132	122
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 5,95 % 04-02-2027	Chine	Sociétés – Non convertibles	300 000 USD	93	16
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 4,75 % 05-08-2029	Chine	Sociétés – Non convertibles	2 959 000 USD	1 434	157
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 4,75 % 14-01-2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	675 000 USD	217	49

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL 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 \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Sorenson Communications LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 12-03-2026	États-Unis	Prêts à terme	205 000 USD	253	267
Source Energy Services Canada LP 10,50 % 15-03-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	299 748	309	259
South Coast British Columbia Transportation Authority 1,60 % 03-07-2030	Canada	Administrations municipales	840 000	840	690
Spa US HoldCo Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 12-03-2028	États-Unis	Prêts à terme	398 832 USD	495	529
Specialty Pharma III Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 24-02-2028	États-Unis	Prêts à terme	382 200 USD	474	508
Stitch Acquisition Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 27-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	460 600 USD	537	489
Financière Sun Life inc., taux variable 21-11-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 390 000	1 390	1 191
Financière Sun Life inc., taux variable 10-08-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	499 000	499	468
Financière Sun Life inc., taux variable 04-07-2035	Canada	Sociétés – Non convertibles	291 000	291	281
Financière Sun Life inc., taux variable 01-10-2035	Canada	Sociétés – Non convertibles	860 000	859	663
Sunac China Holdings Ltd. 5,95 % 26-04-2024	Chine	Sociétés – Non convertibles	1 229 000 USD	448	221
Sunac China Holdings Ltd. 6,50 % 10-01-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	1 613 000 USD	462	288
Suncor Énergie Inc. 3,75 % 04-03-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 228 000 USD	2 349	2 030
Suncor Énergie Inc. 3,95 % 04-03-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	460 000	455	334
Supérieur Plus S.E.C. 4,50 % 15-03-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	150 000 USD	191	177
Suzano Austria GmbH 2,50 % 15-09-2028	Brésil	Sociétés – Non convertibles	985 000 USD	1 135	1 119
Suzano SA 3,75 % 15-01-2031	Brésil	Sociétés – Non convertibles	490 000 USD	677	553
TELUS Corp. 3,30 % 02-05-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	404 000	391	358
TELUS Corp. 3,15 % 19-02-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	900 000	898	774
TELUS Corp. 2,05 % 07-10-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	243 000	241	190
TELUS Corp. 2,85 % 13-11-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	610 000	509	490
TELUS Corp. 4,95 % 28-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	370 000	369	342
Tencent Holdings Ltd. 2,39 % 03-06-2030, rachetables 2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	420 000 USD	578	457
Tencent Music Entertainment Group 1,38 % 03-09-2025, rachetables 2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	290 000 USD	381	360
Tencent Music Entertainment Group 2,00 % 03-09-2030, rachetables 2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	210 000 USD	275	217
Tenet Healthcare Corp. 4,38 % 15-01-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	110 000 USD	138	129
Teranet Holdings LP 3,72 % 23-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 520 000	1 520	1 342
TerraForm Power Operating LLC 4,75 % 15-01-2030, rachetables 2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	40 000 USD	53	46
Thomson Reuters Corp. 2,24 % 14-05-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	930 000	930	880
Timber Servicios Empresariales SA, prêt à terme B de premier rang, taux variable 29-03-2029	Espagne	Prêts à terme	260 000 EUR	370	353
T-Mobile USA Inc. 3,50 % 15-04-2025, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	450 000 USD	638	590
T-Mobile USA Inc. 2,55 % 15-02-2031, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	380 000 USD	516	411
T-Mobile USA Inc. 5,20 % 15-01-2033	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	730 000 USD	942	937
Groupe TMX Ltée 2,30 % 11-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	400 000	401	388
Groupe TMX Ltée 3,78 % 05-06-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	470 000	472	438
Groupe TMX Ltée 2,02 % 12-02-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	360 000	360	283
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 25-07-2029, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	42 000	41	41
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-10-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 190 000	1 190	1 153
Total Capital International SA 2,83 % 10-01-2030, rachetables 2029	France	Sociétés – Non convertibles	1 623 000 USD	1 916	1 913
Tourmaline Oil Corp. 2,53 % 12-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	380 000	380	325
Crédit Toyota Canada Inc. 4,45 % 26-01-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 107 000	1 097	1 080
Toyota Motor Corp. 1,34 % 25-03-2026	Japon	Sociétés – Non convertibles	380 000 USD	476	468
TransCanada PipeLines Ltd. 3,80 % 05-04-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 206 000	1 324	1 131
TransCanada PipeLines Ltd. 5,28 % 15-07-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 240 000	1 240	1 194
TransCanada PipeLines Ltd. 4,20 % 04-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 479 000	1 479	1 125
TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 555 000	3 628	3 111
Trulieve Cannabis Corp. 9,75 % 18-06-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	130 000 USD	170	173
Trulieve Cannabis Corp. 8,00 % 06-10-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	213 000 USD	268	236
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,25 % 15-07-2029	États-Unis	Gouvernements étrangers	11 600 000 USD	18 633	16 786
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2031	États-Unis	Gouvernements étrangers	27 100 000 USD	43 428	36 982
Obligations du Trésor des États-Unis 1,13 % 15-02-2031	États-Unis	Gouvernements étrangers	54 000 USD	63	58

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL 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 \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2032	États-Unis	Gouvernements étrangers	30 400 000 USD	44 867	38 167
Obligations du Trésor des États-Unis 2,75 % 15-08-2032	États-Unis	Gouvernements étrangers	1 318 000 USD	1 643	1 550
Obligations du Trésor des États-Unis 3,50 % 15-02-2033	États-Unis	Gouvernements étrangers	34 655 100 USD	45 714	43 185
Obligations du Trésor des États-Unis 3,88 % 15-08-2033	États-Unis	Gouvernements étrangers	11 500 000 USD	15 304	14 754
Obligations du Trésor des États-Unis 2,38 % 15-02-2042	États-Unis	Gouvernements étrangers	2 780 000 USD	3 119	2 607
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,25 % 15-02-2050	États-Unis	Gouvernements étrangers	7 370 000 USD	12 517	7 022
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2051	États-Unis	Gouvernements étrangers	7 130 000 USD	11 797	6 342
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052	États-Unis	Gouvernements étrangers	29 600 000 USD	39 259	24 286
Obligations du Trésor des États-Unis 3,00 % 15-08-2052	États-Unis	Gouvernements étrangers	618 000 USD	741	611
UPC Broadband Finco BV 4,88 % 15-07-2031 144A	Pays-Bas	Sociétés – Non convertibles	2 780 000 USD	3 508	3 057
Upfield BV, prêt à terme B de premier rang, taux variable 31-01-2028	Pays-Bas	Prêts à terme	390 000 EUR	618	548
Administration de l'aéroport de Vancouver 1,76 % 20-09-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	213 000	180	172
Ventas Canada Finance Ltd. 5,40 % 21-04-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	830 000	830	803
Verizon Communications Inc., taux variable 20-03-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	224 000 USD	280	305
Verizon Communications Inc. 2,38 % 22-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 288 000	1 259	1 119
Vidéotron ltée 3,63 % 15-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	970 000	970	847
Vidéotron ltée 4,50 % 15-01-2030, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 310 000	1 310	1 143
Visa Inc. 2,00 % 15-08-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	4 455 000 USD	3 799	3 337
VTR Comunicaciones SPA 5,13 % 15-01-2028, rachetables 2023 144A	Chili	Sociétés – Non convertibles	682 000 USD	929	525
VTR Finance NV 6,38 % 15-07-2028, rachetables 2023 144A	Chili	Sociétés – Non convertibles	500 000 USD	681	263
Weatherford International Ltd. 8,63 % 30-04-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	5 600 000 USD	6 925	7 657
Wells Fargo & Co. 2,57 % 01-05-2026, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	260 000	270	246
Wells Fargo & Co. 2,98 % 19-05-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	231 000	244	215
Groupe WSP Global Inc. 2,41 % 19-04-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	770 000	770	670
Zoetis Inc. 2,00 % 15-05-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 000 000 USD	1 098	1 089
Total des obligations				832 211	721 693
ACTIONS					
AbbVie Inc.	États-Unis	Soins de santé	82 688	11 386	16 732
AIA Group Ltd.	Hong Kong	Services financiers	613 740	7 216	6 739
Air Liquide SA	France	Matériaux	50 430	5 947	11 537
Alphabet Inc., cat. A	États-Unis	Services de communication	169 453	25 639	30 102
Altria Group Inc.	États-Unis	Consommation de base	314 682	19 688	17 963
Amadeus IT Group SA	Espagne	Consommation discrétionnaire	161 953	13 829	13 249
Amazon.com Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	140 989	23 926	24 330
Analog Devices Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	44 871	10 328	10 665
Aon PLC	États-Unis	Services financiers	47 800	14 177	21 038
Apple Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	100 251	9 477	23 300
AstraZeneca PLC	Royaume-Uni	Soins de santé	118 407	21 506	21 635
Atlas Copco AB, A	Suède	Produits industriels	345 406	3 206	6 283
AutoZone Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	2 567	9 287	8 851
BCE Inc., priv., série AA	Canada	Services de communication	16 472	256	248
BCE Inc., priv., série AI	Canada	Services de communication	2 512	38	35
BCE Inc. 4,54 %, à div. cumulatif rachetable, priv. de premier rang, série R, rachetables	Canada	Services de communication	13 980	253	201
Becton, Dickinson and Co.	États-Unis	Soins de santé	51 450	13 378	18 057
Broadcom Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	20 815	9 256	23 469
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 46	Canada	Biens immobiliers	25 630	646	451
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 48	Canada	Biens immobiliers	10 409	260	192
Brookfield Renewable Partners L.P., priv., série 13	Canada	Services publics	7 357	182	136
Cenovus Energy Inc., priv., série 3	Canada	Énergie	4 970	104	96
Cenovus Energy Inc., priv., série 7	Canada	Énergie	41 640	835	783
Chevron Corp.	États-Unis	Énergie	112 756	15 765	25 810
CME Group Inc.	États-Unis	Services financiers	75 438	14 159	20 504
The Coca-Cola Co.	États-Unis	Consommation de base	222 753	14 795	16 928
Colgate-Palmolive Co.	États-Unis	Consommation de base	91 052	9 264	8 789
ConocoPhillips	États-Unis	Énergie	72 701	10 075	11 823

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL 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 \$)
ACTIONS (suite)					
Corteva Inc.	États-Unis	Matériaux	120 895	5 399	8 396
CRH PLC	Irlande	Matériaux	117 151	8 340	8 704
Crown Castle International Corp.	États-Unis	Biens immobiliers	56 533	12 213	7 063
DBS Group Holdings Ltd.	Singapour	Services financiers	416 790	12 786	13 895
Deutsche Börse AG	Allemagne	Services financiers	101 551	14 851	23 828
Diageo PLC	Royaume-Uni	Consommation de base	137 358	6 219	6 878
Emera Inc., priv., série L	Canada	Services publics	14 740	369	242
Equifax Inc.	États-Unis	Produits industriels	24 357	3 322	6 057
Eurofins Scientific	Luxembourg	Soins de santé	61 407	3 662	4 700
Frontera Generation Holdings LLC	États-Unis	Énergie	1 737	4	4
Glencore PLC	Australie	Matériaux	2 685 766	14 473	20 854
Hannover Rueckversicherung SE, nom.	Allemagne	Services financiers	39 150	8 434	11 679
HDFC Bank Ltd.	Inde	Services financiers	283 973	5 731	7 046
Heineken Holding NV, A	Pays-Bas	Consommation de base	116 230	12 439	11 875
Honeywell International Inc.	États-Unis	Produits industriels	55 158	9 859	13 833
Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	Hong Kong	Services financiers	143 809	6 191	7 278
Hoya Corp.	Japon	Soins de santé	60 700	8 160	8 492
Intelsat Jackson Holdings SA, A, bons de souscription éch. 05-12-2025	Luxembourg	Services de communication	1 034	7	11
Intelsat Jackson Holdings SA, B, bons de souscription éch. 05-12-2025	Luxembourg	Services de communication	1 034	5	7
Intelsat Jackson Holdings SA	Luxembourg	Services de communication	9 877	422	342
ITOCHU Corp.	Japon	Produits industriels	189 400	9 948	9 290
Japan Exchange Group Inc.	Japon	Services financiers	425 700	8 808	10 719
Johnson & Johnson	États-Unis	Soins de santé	112 447	20 027	23 775
JPMorgan Chase & Co.	États-Unis	Services financiers	136 580	20 394	26 888
Kenvue Inc.	États-Unis	Consommation de base	246 225	8 461	6 712
Keyence Corp.	Japon	Technologie de l'information	12 340	4 329	6 227
Kweichow Moutai Co. Ltd., cat. A	Chine	Consommation de base	15 828	588	5 337
Lam Research Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	14 798	10 707	12 591
Linde PLC (Bourse de New York)	Royaume-Uni	Matériaux	22 765	4 884	11 507
Les Compagnies Loblaw Itée 5,30 %, à div. cumulatif rachetable, priv. de second rang, Série B	Canada	Consommation de base	2 273	59	47
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	France	Consommation discrétionnaire	7 653	4 288	7 838
McDonald's Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	32 080	5 976	11 472
McKesson Corp.	États-Unis	Soins de santé	23 874	12 276	14 093
Meta Platforms Inc., cat. A	États-Unis	Services de communication	18 310	7 488	7 462
Microsoft Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	117 979	18 052	50 568
Moody's Corp.	États-Unis	Services financiers	11 784	1 779	5 058
Motorola Solutions Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	53 290	12 129	19 694
Nestlé SA, nom.	États-Unis	Consommation de base	99 881	10 490	15 307
Northrop Grumman Corp.	États-Unis	Produits industriels	17 571	11 605	10 500
Novo Nordisk AS, B	Danemark	Soins de santé	141 166	4 903	17 433
Oracle Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	53 583	8 312	7 704
PepsiCo Inc.	États-Unis	Consommation de base	43 222	8 011	9 942
¹ Pernod Ricard SA	France	Consommation de base	20 459	3 427	4 623
Philip Morris International Inc.	États-Unis	Consommation de base	163 143	18 142	20 503
Polymetal International PLC	Russie	Matériaux	393	1	2
Roche Holding AG Genussscheine	États-Unis	Soins de santé	45 325	16 779	16 778
S&P Global Inc.	États-Unis	Services financiers	30 597	13 595	15 177
Safran SA	France	Produits industriels	65 324	8 230	13 865
SAP AG	Allemagne	Technologie de l'information	157 859	22 283	27 817
Schlumberger Ltd.	États-Unis	Énergie	119 131	6 617	9 428
Shell PLC (actions en livres sterling)	Pays-Bas	Énergie	490 640	17 982	21 150
The Sherwin-Williams Co.	États-Unis	Matériaux	19 806	2 953	6 857
Siemens AG	Allemagne	Produits industriels	37 712	8 524	7 339
Sika AG	Suisse	Matériaux	17 051	3 145	5 865
Sony Corp.	Japon	Consommation discrétionnaire	117 240	8 808	13 020
Source Energy Services Ltd.	Canada	Énergie	15 480	38	87
Starbucks Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	49 971	3 688	6 191
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	Taiwan	Technologie de l'information	577 120	6 576	12 726
Texas Instruments Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	39 236	5 733	8 469
Thales SA	France	Produits industriels	34 446	6 969	6 561
Thermo Fisher Scientific Inc.	États-Unis	Soins de santé	14 315	10 134	9 836

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
ACTIONS (suite)					
TransAlta Corp., perpétuelles, priv., série C	Canada	Services publics	3 910	73	65
TransAlta Corp., priv., série A	Canada	Services publics	34 458	450	404
Union Pacific Corp.	États-Unis	Produits industriels	47 318	13 241	13 080
UnitedHealth Group Inc.	États-Unis	Soins de santé	22 615	15 911	15 479
Visa Inc., cat. A	États-Unis	Services financiers	55 709	9 230	17 394
The Williams Companies Inc.	États-Unis	Énergie	310 804	13 043	14 214
Wolters Kluwer NV	Pays-Bas	Produits industriels	56 142	5 718	9 230
Total des actions				812 568	1 067 454
OPTIONS					
Options achetées (se reporter au tableau des options achetées)				91	22
Total des options				91	22
FONDS/BILLETS NÉGOCIÉS EN BOURSE					
² FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	191 493	17 618	14 652
² FNB de revenu à taux variable Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	504 408	8 785	8 807
² FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	340 000	6 845	5 671
² FINB Obligations américaines totales Mackenzie (couvert en \$ CA)	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	50 000	4 298	3 926
² FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	54 435	5 075	4 468
² FINB TIPS américains Mackenzie (couvert en \$ CA)	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	110 571	9 678	9 227
Total des fonds/billets négociés en bourse				52 299	46 751
FONDS COMMUNS DE PLACEMENT					
³ Fonds international de dividendes Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	387 927	3 967	5 252
³ Fonds de revenu fixe sans contraintes Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	171 510	1 697	1 442
Total des fonds communs de placement				5 664	6 694
FONDS PRIVÉS					
⁴ Northleaf Private Credit II LP	Canada	Services financiers	811	8 536	8 919
⁵ Sagard Credit Partners II LP	Canada	Services financiers	811	3 786	3 974
Total des fonds privés				12 322	12 893
BILLETS À COURT TERME					
Banque Royale du Canada 4,95 % 03-10-2023	Canada	Obligations de sociétés	2 484 000	2 484	2 484
Banque Royale du Canada 4,95 % 03-10-2023	Canada	Obligations de sociétés	5 316 000	5 316	5 317
Gouvernement du Canada 4,50 % 07-12-2023	Canada	Gouvernement fédéral	160 000	154	159
Gouvernement du Canada 4,71 % 29-02-2024	Canada	Gouvernement fédéral	451 000	431	443
Obligations du Trésor des États-Unis 5,39 % 08-08-2024	États-Unis	Gouvernement fédéral	50 000 000	64 485	64 894
Obligations du Trésor des États-Unis 5,39 % 08-08-2024	États-Unis	Gouvernement fédéral	3 850 000	4 965	4 997
Total des billets à court terme				77 835	78 294
Coûts de transaction				(1 191)	–
Total des placements				1 791 799	1 933 801
Instruments dérivés (se reporter au tableau des instruments dérivés)					(647)
Trésorerie et équivalents de trésorerie					16 895
Autres éléments d'actif moins le passif					19 852
Actif net attribuable aux porteurs de titres					1 969 901

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

² Ce fonds négocié en bourse est géré par Mackenzie.

³ Ce fonds est géré par Mackenzie.

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

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

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

APERÇU DU PORTEFEUILLE

30 SEPTEMBRE 2023

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Actions	54,2
Obligations	40,1
<i>Obligations</i>	36,6
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)</i>	3,3
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)</i>	0,2
Fonds/billets négociés en bourse	2,4
Placements à court terme	1,4
Autres éléments d'actif (de passif)	0,9
Fonds privés	0,7
Fonds communs de placement	0,3
Options sur swaps achetées	—

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	54,8
Canada	13,1
Autre	6,6
Allemagne	4,4
Japon	3,5
Mexique	2,4
France	2,4
Pays-Bas	2,4
Royaume-Uni	2,2
Nouvelle-Zélande	2,1
Brésil	1,4
Australie	1,4
Danemark	0,9
Autres éléments d'actif (de passif)	0,9
Irlande	0,8
Afrique du Sud	0,7

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations d'État étrangères	21,5
Obligations de sociétés	15,9
Technologie de l'information	10,3
Services financiers	9,6
Soins de santé	8,5
Consommation de base	6,3
Produits industriels	4,9
Consommation discrétionnaire	4,3
Énergie	4,2
Matériaux	3,7
Fonds/billets négociés en bourse	2,4
Services de communication	1,9
Autre	1,6
Billets à escompte de gouvernements étrangers à court terme	1,0
Obligations fédérales	1,0
Obligations provinciales	0,9
Autres éléments d'actif (de passif)	0,9
Fonds privés	0,7
Billets à escompte de sociétés à court terme	0,4

31 MARS 2023

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Actions	54,8
Obligations	35,8
<i>Obligations</i>	36,3
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)</i>	—
<i>Options achetées</i>	—
<i>Options vendues</i>	—
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)</i>	(0,5)
Trésorerie et placements à court terme	4,8
Fonds/billets négociés en bourse	2,0
Autres éléments d'actif (de passif)	1,2
Fonds communs de placement	0,8
Fonds privés	0,6
Options sur devises achetées	—

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	52,1
Canada	13,3
Autre	5,8
Trésorerie et placements à court terme	4,8
Allemagne	4,5
Pays-Bas	3,1
Mexique	2,9
Japon	2,5
France	2,4
Royaume-Uni	2,4
Suisse	1,5
Autres éléments d'actif (de passif)	1,2
Hong Kong	0,9
Brésil	0,9
Danemark	0,9
Espagne	0,8

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations d'État étrangères	16,3
Obligations de sociétés	15,8
Services financiers	10,0
Technologie de l'information	9,6
Soins de santé	9,2
Consommation de base	6,8
Trésorerie et placements à court terme	4,8
Produits industriels	4,6
Énergie	4,4
Consommation discrétionnaire	4,3
Matériaux	4,0
Autre	2,0
Fonds/billets négociés en bourse	2,0
Obligations fédérales	1,8
Services de communication	1,4
Obligations provinciales	1,2
Autres éléments d'actif (de passif)	1,2
Fonds privés	0,6

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL 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 \$)
Indice Markit North American Investment Grade CDX	27 492 000	Vente	20 décembre 2023	100,00 USD	91	22
Total des options					91	22

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS

au 30 septembre 2023

Tableau des contrats à terme standardisés

Type de contrat	Nombre de contrats	Date d'échéance	Prix moyen des contrats (\$)	Montant notionnel* (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
Contrats à terme standardisés sur obligations euro-OAT, décembre 2023	(138)	7 décembre 2023	127,41 EUR	(24 401)	832	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans, décembre 2023	(91)	13 décembre 2023	146,28 JPY	(119 838)	1 094	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor américain à 10 ans, décembre 2023	452	19 décembre 2023	109,98 USD	66 306	–	(1 385)
Contrats à terme standardisés à très long terme sur obligations du Trésor américain, décembre 2023	(168)	19 décembre 2023	127,42 USD	(27 068)	1 990	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du Royaume-Uni, décembre 2023	(127)	27 décembre 2023	94,77 GBP	(19 810)	135	–
Total des contrats à terme standardisés				(124 811)	4 051	(1 385)

* 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	381 USD	(798) AUD	3 octobre 2023	(517)	(512)	5	–
A	798 AUD	(379) USD	3 octobre 2023	515	513	–	(2)
A	909 CAD	(495) USD	3 octobre 2023	(670)	(673)	–	(3)
A	495 USD	(909) CAD	3 octobre 2023	670	674	4	–
A	1 016 USD	(1 214) CHF	3 octobre 2023	(1 379)	(1 308)	71	–
A	1 214 CHF	(978) USD	3 octobre 2023	1 327	1 326	–	(1)
A	430 USD	(537) EUR	3 octobre 2023	(584)	(563)	21	–
A	537 EUR	(419) USD	3 octobre 2023	569	568	–	(1)
A	4 081 GBP	(3 810) USD	3 octobre 2023	5 172	4 911	–	(261)
A	3 669 USD	(4 081) GBP	3 octobre 2023	(4 981)	(4 980)	1	–
A	5 145 USD	(1 012 300) JPY	3 octobre 2023	(6 984)	(6 706)	278	–
A	1 012 300 JPY	(4 997) USD	3 octobre 2023	6 784	6 778	–	(6)
A	2 171 USD	(31 320) NOK	3 octobre 2023	(2 947)	(2 924)	23	–
A	31 320 NOK	(2 168) USD	3 octobre 2023	2 943	2 925	–	(18)
A	3 757 NZD	(1 648) USD	3 octobre 2023	2 237	2 257	20	–
A	1 663 USD	(3 757) NZD	3 octobre 2023	(2 257)	(2 250)	7	–
A	5 630 SEK	(379) USD	3 octobre 2023	515	516	1	–
A	382 USD	(5 630) SEK	3 octobre 2023	(518)	(514)	4	–
AA	3 386 CAD	(44 210) MXN	6 octobre 2023	(3 386)	(3 440)	–	(54)
AA	16 174 CAD	(211 955) MXN	6 octobre 2023	(16 174)	(16 490)	–	(316)
A	10 816 CAD	(141 593) MXN	6 octobre 2023	(10 816)	(11 016)	–	(200)
AA	136 310 MXN	(10 521) CAD	6 octobre 2023	10 521	10 605	84	–
A	6 030 MXN	(469) CAD	6 octobre 2023	469	469	–	–
AA	16 920 MXN	(1 332) CAD	6 octobre 2023	1 332	1 316	–	(16)
A	90 760 MXN	(7 114) CAD	6 octobre 2023	7 114	7 061	–	(53)
A	5 163 CAD	(3 910) USD	6 octobre 2023	(5 163)	(5 308)	–	(145)
A	128 CAD	(145) AUD	18 octobre 2023	(128)	(127)	1	–
A	205 AUD	(179) CAD	18 octobre 2023	179	179	–	–
A	75 CAD	(85) AUD	18 octobre 2023	(75)	(75)	–	–
A	110 AUD	(96) CAD	18 octobre 2023	96	96	–	–
A	8 424 CAD	(23 226) ILS	18 octobre 2023	(8 424)	(8 278)	146	–
A	89 CAD	(250) ILS	18 octobre 2023	(89)	(89)	–	–
A	520 USD	(3 440) BRL	19 octobre 2023	(706)	(674)	32	–
A	257 USD	(299 000) CLP	19 octobre 2023	(349)	(330)	19	–
A	444 USD	(218 000) HUF	19 octobre 2023	(603)	(585)	18	–

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL 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 DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

NOTES ANNEXES

3. Principales méthodes comptables (suite)

b) Évaluation de la juste valeur (suite)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

NOTES ANNEXES

3. Principales méthodes comptables (suite)

c) Comptabilisation des produits

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

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

d) Commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille

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

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

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

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

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

f) Compensation

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

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

g) Devise

Le dollar 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.

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

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

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

NOTES ANNEXES

3. Principales méthodes comptables (suite)

k) Fusions

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

l) Modifications comptables futures

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

4. Estimations et jugements comptables critiques

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

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

Utilisation d'estimations

Juste valeur des titres non cotés sur un marché actif

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

Utilisation de jugements

Classement et évaluation des placements

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

Monnaie fonctionnelle

Le dollar 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 assujetties à des restrictions aux termes de leurs documents de placement;
- III. les Fonds sous-jacents ont des objectifs de placement précis et bien définis visant à offrir des occasions de placement aux investisseurs tout en leur transmettant les risques et avantages connexes.

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

5. Impôts sur le résultat

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

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

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

NOTES ANNEXES

6. Frais de gestion et frais d'exploitation

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

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

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

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

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

7. Capital du Fonds

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

8. Risques découlant des instruments financiers

i. Exposition au risque et gestion du risque

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

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

ii. Risque de liquidité

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

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

iii. Risque de change

Le risque de change est le risque que les instruments financiers libellés ou échangés dans une monnaie autre que le dollar 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.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

NOTES ANNEXES

8. Risques découlant des instruments financiers (suite)

iv. Risque de taux d'intérêt

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

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

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

v. Autre risque de prix

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

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

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

vi. Risque de crédit

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

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

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

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

vii. Fonds sous-jacents

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

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

NOTES ANNEXES

9. Autres renseignements

Abréviations

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

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

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL 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 : 29 septembre 2006

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 des séries A, T5 et T8 sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$ (5 000 \$ pour les séries T5 et T8). Les investisseurs des séries A et T5 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année, et les investisseurs de série T8 désirent recevoir un flux de revenu mensuel de 8 % par année.

Les titres de série AR sont offerts aux particuliers dans un régime enregistré d'épargne-invalidité offert par Mackenzie.

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

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

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

Les titres des séries O et O5 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 investisseurs des séries O et O5 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année.

Les titres des séries PW, PWT5 et PWT8 sont offerts à certains investisseurs à valeur nette élevée de nos Solutions Patrimoine privé qui investissent un minimum de 100 000 \$. Les investisseurs des séries PW et PWT5 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année. Les investisseurs de série PWT8 désirent recevoir un flux de revenu mensuel de 8 % par année.

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

Les titres de série PWR sont offerts à certains investisseurs à valeur nette élevée de nos Solutions Patrimoine privé qui investissent un minimum de 100 000 \$ dans un régime enregistré d'épargne-invalidité offert par Mackenzie.

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

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 de placement, mais peuvent être vendus à d'autres investisseurs comme le déterminera Mackenzie.

Les titres des séries B, GF, GF8, GLF, GO, GPW, GPWFB, GPWT8, GPWX, GPWX8, GW et OJ ont été créés exclusivement afin de mettre en œuvre les fusions touchant le Fonds et ne sont pas offerts à la vente.

Les titres de série I ne sont plus offerts à la vente.

Les titres de série G ne sont plus offerts à la vente.

Séries distribuées par BLC Services Financiers inc. (1360, boul. René-Lévesque Ouest, 13^e étage, Montréal (Québec) H3G 0A9; 1-800-252-1846; www.banquelaurentienne.ca/mackenzie)

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

Les titres de série LF sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$, qui participent à un programme de services rémunérés à l'acte parrainé par Gestion privée Banque Laurentienne.

Les titres de série LW sont offerts à certains investisseurs à valeur nette élevée du programme de tarification préférentielle qui investissent un minimum de 100 000 \$.

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

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

NOTES ANNEXES

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

a) Constitution du Fonds et renseignements sur les séries (suite)

Série	Date d'établissement/ de rétablissement	Frais de gestion	Frais d'administration
Série A	31 mars 2008	1,85 %	0,24 %
Série AR	19 novembre 2014	1,85 %	0,27 %
Série B	24 novembre 2006	1,85 %	0,24 %
Série D	19 mars 2014	0,85 % ³⁾	0,16 %
Série F	23 octobre 2006	0,70 %	0,15 %
Série F8	1 ^{er} juin 2018	0,70 %	0,15 %
Série FB	26 octobre 2015	0,85 %	0,24 %
Série G	25 novembre 2016	1,35 %	0,24 %
Série GF	17 juin 2023	0,65 %	0,15 %
Série GF8	17 juin 2023	0,65 %	0,15 %
Série GLF	17 juin 2023	0,65 %	0,15 %
Série GO	17 juin 2023	— ¹⁾	s.o.
Série GPW	17 juin 2023	1,65 %	0,15 %
Série GPWFB	17 juin 2023	0,65 %	0,15 %
Série GPWT8	17 juin 2023	1,65 %	0,15 %
Série GPWX	17 juin 2023	— ²⁾	— ²⁾
Série GPWX8	17 juin 2023	— ²⁾	— ²⁾
Série GW	17 juin 2023	1,65 %	0,15 %
Série I	24 novembre 2006	1,25 %	0,24 %
Série OJ	25 novembre 2016	1,70 %	0,20 %
Série O	24 novembre 2006	— ¹⁾	s.o.
Série O5	12 janvier 2016	— ¹⁾	s.o.
Série PW	30 octobre 2013	1,70 %	0,15 %
Série PWFB	3 avril 2017	0,70 %	0,15 %
Série PWR	1 ^{er} avril 2019	1,70 %	0,15 %
Série PWT5	3 avril 2017	1,70 %	0,15 %
Série PWT8	16 décembre 2013	1,70 %	0,15 %
Série PWX	30 juin 2014	— ²⁾	— ²⁾
Série PWX8	10 février 2015	— ²⁾	— ²⁾
Série R	6 juin 2023	s.o.	s.o.
Série S	31 octobre 2017	— ¹⁾	0,025 %
Série T5	23 octobre 2006	1,85 %	0,24 %
Série T8	24 octobre 2018	1,85 %	0,24 %
Série LB	17 juin 2023	1,85 %	0,24 %
Série LF	17 juin 2023	0,70 %	0,15 %
Série LW	17 juin 2023	1,70 %	0,15 %

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

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL 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 \$	
67 159	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	

c) Prêt de titres

	30 septembre 2023	31 mars 2023
	(\$)	(\$)
Valeur des titres prêtés	74 059	38 635
Valeur des biens reçus en garantie	77 832	40 684

	30 septembre 2023		30 septembre 2022	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
Revenus de prêts de titres bruts	140	100,0	104	100,0
Impôt retenu à la source	(2)	(1,4)	(9)	(8,7)
	138	98,6	95	91,3
Paiements à l'agent de prêt de titres	(25)	(17,9)	(17)	(16,3)
Revenu tiré du prêt de titres	113	80,7	78	75,0

d) Commissions

	(\$)
30 septembre 2023	105
30 septembre 2022	29

e) Risques découlant des instruments financiers

i. Exposition au risque et gestion du risque

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

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL 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	1 045 441	84 614	(459 916)	670 139				
EUR	170 652	(564)	(15 727)	154 361				
GBP	70 519	789	6 226	77 534				
JPY	66 253	(656)	(3 552)	62 045				
CHF	37 950	–	(9 566)	28 384				
BRL	23 650	–	(674)	22 976				
MXN	28 842	157	(11 495)	17 504				
DKK	17 433	–	–	17 433				
ZAR	14 500	815	(697)	14 618				
HKD	14 017	157	–	14 174				
SGD	13 895	206	–	14 101				
NTD	12 726	62	–	12 788				
INR	7 046	–	–	7 046				
CNY	5 337	127	–	5 464				
IDR	4 659	–	–	4 659				
NZD	41 661	–	(37 400)	4 261				
NOK	507	–	2 746	3 253				
AUD	7 888	–	(5 517)	2 371				
SEK	6 283	–	(4 317)	1 966				
PEN	–	–	1 808	1 808				
THB	–	–	897	897				
ILS	8 511	–	(8 367)	144				
CLP	–	–	(330)	(330)				
HUF	–	–	(585)	(585)				
PLN	–	–	(810)	(810)				
Total	1 597 770	85 707	(547 276)	1 136 201				
% de l'actif net	81,1	4,4	(27,8)	57,7				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					(56 810)	(2,9)	56 810	2,9

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL 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)

Devise	31 mars 2023				Incidence sur l'actif net			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Renforcement de 5 %		Affaiblissement de 5 %	
					(\$)	%	(\$)	%
USD	1 073 062	27 054	(442 180)	657 936				
EUR	198 899	5 470	(30 228)	174 141				
GBP	72 424	459	31 646	104 529				
JPY	47 293	3 777	(7 289)	43 781				
CHF	42 564	436	(8 468)	34 532				
HKD	18 854	–	–	18 854				
DKK	17 731	102	–	17 833				
BRL	13 834	–	(362)	13 472				
SGD	14 409	–	(2 143)	12 266				
NTD	14 369	–	(2 549)	11 820				
INR	7 536	–	1 841	9 377				
CNY	5 698	62	–	5 760				
NZD	11 246	–	(7 994)	3 252				
EGP	–	–	3 009	3 009				
AUD	9 659	32	(7 441)	2 250				
SEK	5 909	–	(3 927)	1 982				
MXN	34 843	157	(33 824)	1 176				
NOK	4 390	–	(3 399)	991				
ZAR	–	–	640	640				
ILS	8 770	–	(8 730)	40				
HUF	–	–	(404)	(404)				
COP	–	–	(423)	(423)				
KOR	–	–	(720)	(720)				
PEN	–	–	(761)	(761)				
IDR	–	–	(1 318)	(1 318)				
Total	1 601 490	37 549	(525 024)	1 114 015				
% de l'actif net	80,3	1,9	(26,3)	55,9				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					(55 701)	(2,8)	55 701	2,8

* Comprend les instruments financiers monétaires et non monétaires.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL 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 et des instruments dérivés selon la durée jusqu'à l'échéance.

	Obligations (\$)	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
			Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
			(\$)	(%)	(\$)	(%)
30 septembre 2023						
Moins de 1 an	38 324	(124 811)				
1 an à 5 ans	124 381	–				
5 ans à 10 ans	378 761	–				
Plus de 10 ans	180 227	–				
Total	721 693	(124 811)				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt			(44 317)	(2,2)	44 317	2,2

	Obligations (\$)	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
			Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
			(\$)	(%)	(\$)	(%)
31 mars 2023						
Moins de 1 an	21 322	(366 636)				
1 an à 5 ans	170 667	–				
5 ans à 10 ans	290 752	–				
Plus de 10 ans	240 850	–				
Total	723 591	(366 636)				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt			(33 615)	(1,7)	33 751	1,7

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	113 380	5,8	(113 380)	(5,8)
31 mars 2023	116 052	5,8	(116 052)	(5,8)

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 9,8 % de l'actif net du Fonds (10,5 % au 31 mars 2023).

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

Note des obligations*	30 septembre 2023	31 mars 2023
	% de l'actif net	% de l'actif net
AAA	5,1	5,3
AA	11,4	13,4
A	4,1	3,4
BBB	7,9	7,7
Inférieure à BBB	4,8	3,7
Sans note	3,3	2,8
Total	36,6	36,3

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

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL 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	–	721 693	–	721 693	–	723 591	–	723 591
Actions	679 995	387 095	364	1 067 454	677 061	415 174	343	1 092 578
Options	–	22	–	22	–	422	–	422
Fonds/billets négociés en bourse	46 751	–	–	46 751	39 807	–	–	39 807
Fonds communs de placement	6 694	–	–	6 694	15 361	–	–	15 361
Fonds privés	–	–	12 893	12 893	–	–	12 772	12 772
Actifs dérivés	4 051	2 408	–	6 459	1	3 963	–	3 964
Passifs dérivés	(1 385)	(5 721)	–	(7 106)	(9 071)	(5 634)	–	(14 705)
Placements à court terme	–	78 294	–	78 294	–	70 089	–	70 089
Total	736 106	1 183 791	13 257	1 933 154	723 159	1 207 605	13 115	1 943 879

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

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

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

	30 septembre 2023				31 mars 2023			
	Obligations (\$)	Actions (\$)	Fonds privés (\$)	Total (\$)	Obligations (\$)	Actions (\$)	Fonds privés (\$)	Total (\$)
Solde, à l'ouverture	–	343	12 772	13 115	414	417	5 534	6 365
Achats	–	–	23	23	–	–	7 010	7 010
Ventes	–	–	–	–	(7 084)	–	–	(7 084)
Transferts entrants	–	–	–	–	–	12	–	12
Transferts sortants	–	–	–	–	–	–	–	–
Profits (pertes) au cours de la période :								
Réalisé(e)s	–	–	–	–	(18 125)	–	–	(18 125)
Latent(e)s	–	21	98	119	24 795	(86)	228	24 937
Solde, à la clôture	–	364	12 893	13 257	–	343	12 772	13 115
Variation des profits (pertes) latent(e)s au cours de la période attribuables aux titres détenus à la clôture de la période	–	21	98	119	–	(86)	228	142

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

g) Placements détenus par le gestionnaire et des sociétés affiliées

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

	30 septembre 2023	31 mars 2023
	(\$)	(\$)
Gestionnaire	1 241	1 264
Autres fonds gérés par le gestionnaire	1	–
Fonds gérés par des sociétés affiliées au gestionnaire	1	1

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

NOTES ANNEXES

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

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	5 758	(2 085)	–	3 673
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(3 832)	2 085	1 832	85
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	1 926	–	1 832	3 758

	31 mars 2023			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	1 210	(764)	–	446
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(12 953)	764	23 200	11 011
Obligation pour options vendues	(204)	–	–	(204)
Total	(11 947)	–	23 200	11 253

i) Intérêts dans des entités structurées non consolidées

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

30 septembre 2023	% de l'actif net du Fonds sous-jacent	Juste valeur des placements du Fonds (\$)
FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	3,2	14 652
FNB de revenu à taux variable Mackenzie	1,5	8 807
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	3,2	5 671
Fonds international de dividendes Mackenzie, série R	1,0	5 252
FINB Obligations américaines totales Mackenzie (couvert en \$ CA)	13,2	3 926
Fonds de revenu fixe sans contraintes Mackenzie, série R	0,1	1 442
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	0,9	4 468
FINB TIPS américains Mackenzie (couvert en \$ CA)	2,3	9 227
Northleaf Private Credit II LP	1,0	8 919
Sagard Credit Partners II LP	0,7	3 974

31 mars 2023	% de l'actif net du Fonds sous-jacent	Juste valeur des placements du Fonds (\$)
FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	3,0	13 098
Fonds mondial chinois Mackenzie, série R	18,9	5 560
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	3,2	5 933
Fonds international de dividendes Mackenzie, série R	1,5	8 303
FINB Obligations américaines totales Mackenzie (couvert en \$ CA)	14,7	4 158
Fonds de revenu fixe sans contraintes Mackenzie, série R	0,1	1 498
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,6	8 335
FINB TIPS américains Mackenzie (couvert en \$ CA)	2,1	8 283
Northleaf Private Credit II LP	1,1	9 029
Sagard Credit Partners II LP	1,1	3 743

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

NOTES ANNEXES

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

j) Engagement

	30 septembre 2023		31 mars 2023	
	Montant appelé (\$ US)	Engagement d'investissement total (\$ US)	Montant appelé (\$ US)	Engagement d'investissement total (\$ US)
Northleaf Private Credit II LP ¹⁾	6 556	8 114	6 459	8 114
Sagard Credit Partners II LP ²⁾	2 761	8 114	2 761	8 114

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

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

k) Fusion de fonds

La fusion du Mandat privé équilibré de revenu mondial Mackenzie (le « Fonds dissous ») avec le Fonds a eu lieu le 16 juin 2023. Cette fusion a été réalisée avec report d'impôt. Puisque le Fonds dissous investissait la totalité de son actif net dans la série R du Fonds avant la fusion, la fusion a été effectuée en échangeant 8 187 titres de série R contre d'autres titres du Fonds à la juste valeur de marché, ne donnant lieu à aucun transfert d'actif net au Fonds.

Séries du Fonds dissous	Séries du Fonds	Titres émis
Série LF	Série GLF	300
Série LW	Série GW	76
Série O	Série GO	4
Série PW	Série GPW	2 559
Série PWF	Série GF	1 946
Série PWF8	Série GF8	74
Série PWFB	Série GPWFB	320
Série PWT8	Série GPWT8	11
Série PWX	Série GPWX	181
Série PWX8	Série GPWX8	0,2

Par suite de la fusion, le Fonds dissous a été fermé. Les charges engagées dans le cadre de la fusion ont été acquittées par Mackenzie.