

## **États financiers intermédiaires non audités**

*Pour la période de six mois close le 30 septembre 2023*

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

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

### **AVIS DE NON-AUDIT DES ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES**

*Corporation Financière Mackenzie, le gestionnaire du Fonds d'obligations tactique 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 D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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)
<b>ACTIF</b>	\$	\$					
<b>Actifs courants</b>			Série A	7,81	8,28	1 174	1 554
Placements à la juste valeur	244 180	262 662	Série AR	7,83	8,29	844	832
Trésorerie et équivalents de trésorerie	3 307	25 962	Série B	7,84	8,30	844	1 052
Intérêts courus à recevoir	2 282	1 982	Série CL	7,66	8,11	13 856	14 550
Dividendes à recevoir	55	–	Série D	7,83	8,29	600	505
Sommes à recevoir pour placements vendus	6 298	145	Série F	7,85	8,31	20 930	22 471
Sommes à recevoir pour titres émis	1	345	Série F5	9,03	9,58	3	3
Sommes à recevoir du gestionnaire	4	10	Série FB	7,81	8,28	83	87
Marge sur instruments dérivés	552	8 424	Série GA	9,25	9,80	31	36
Actifs dérivés	2 077	1 928	Série GAR	9,25	9,80	34	38
<b>Total de l'actif</b>	<b>258 756</b>	<b>301 458</b>	Série GD	9,26	9,80	15	19
			Série GDF	9,26	9,80	834	1 966
<b>PASSIF</b>			Série GDPW	9,25	9,80	1 336	1 628
<b>Passifs courants</b>			Série GDPWX	9,25	9,80	3	166
Sommes à payer pour placements achetés	3 247	195	Série GF	9,26	9,80	3 451	4 690
Sommes à payer pour titres rachetés	41	99	Série GF5	13,50	14,33	64	67
Sommes à payer au gestionnaire	2	2	Série GPW	9,25	9,80	924	1 230
Obligation pour options vendues	–	69	Série GPWR	9,25	9,80	27	28
Passifs dérivés	1 997	5 128	Série GPWT5	13,40	14,27	224	239
<b>Total du passif</b>	<b>5 287</b>	<b>5 493</b>	Série GPWX	9,26	9,80	3	3
<b>Actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>253 469</b>	<b>295 965</b>	Série GSC	9,25	9,80	609	924
			Série GW	9,25	9,80	150	294
			Série IG	8,30	8,79	892	921
			Série O	7,69	8,14	769	1 006
			Série PW	7,83	8,29	12 545	14 377
			Série PWFB	7,74	8,19	631	684
			Série PWR	8,23	8,72	581	570
			Série PWT5	9,61	10,23	301	310
			Série PWT8	7,29	7,89	60	64
			Série PWX	7,64	8,09	1 159	1 533
			Série PWX8	7,57	8,13	23	186
			Série R	7,66	8,11	174 468	205 910
			Série S	7,81	8,28	702	734
			Série SC	7,74	8,19	8 624	9 884
			Série S5	8,52	9,08	70	78
			Série U	7,84	8,30	1 658	1 920
			Série GLF	9,25	9,80	103	135
			Série LB	7,84	8,30	1 013	1 106
			Série LF	8,32	8,81	1 626	1 560
			Série LF5	11,47	12,18	1	1
			Série LW	8,00	8,47	2 125	2 454
			Série LW5	10,09	10,75	25	94
			Série LX	7,80	8,31	54	56
						<b>253 469</b>	<b>295 965</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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	2023	2022
<b>Revenus</b>								
Dividendes	445	355						
Revenus d'intérêts aux fins de distribution	6 787	6 682						
Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets								
Profit (perte) net(te) réalisé(e)	(9 930)	(6 191)						
Profit (perte) net(te) latent(e)	(5 762)	(23 030)						
Revenu tiré du prêt de titres	8	14						
Revenu provenant des rabais sur les frais	22	26						
<b>Total des revenus (pertes)</b>	<b>(8 430)</b>	<b>(22 144)</b>						
<b>Charges (note 6)</b>								
Frais de gestion	308	373						
Rabais sur les frais de gestion	(1)	–						
Frais d'administration	60	75						
Intérêts débiteurs	3	5						
Commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille	25	57						
Frais du comité d'examen indépendant	–	–						
Autre	–	1						
<b>Charges avant les montants absorbés par le gestionnaire</b>	<b>395</b>	<b>511</b>						
Charges absorbées par le gestionnaire	–	–						
<b>Charges nettes</b>	<b>395</b>	<b>511</b>						
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, avant impôt</b>	<b>(8 825)</b>	<b>(22 655)</b>						
Charge (économie) d'impôt étranger retenu à la source	(20)	10						
Charge d'impôt étranger sur le résultat (recouvrée)	–	–						
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation</b>	<b>(8 805)</b>	<b>(22 665)</b>						
Série A					(0,31)	(0,78)	(47)	(209)
Série AR					(0,33)	(0,74)	(32)	(61)
Série B					(0,31)	(0,77)	(37)	(115)
Série CL					(0,24)	(0,59)	(441)	(856)
Série D					(0,31)	(0,64)	(20)	(35)
Série F					(0,28)	(0,71)	(757)	(2 352)
Série F5					(0,32)	(1,28)	–	(3)
Série FB					(0,29)	(0,70)	(3)	(8)
Série GA					(0,37)	(0,71)	(1)	(71)
Série GAR					(0,38)	(0,39)	(1)	(3)
Série GD					(0,32)	(0,40)	–	(2)
Série GDF					(0,25)	(0,39)	(46)	(1)
Série GDPW					(0,35)	(0,36)	(56)	(76)
Série GDPWX					(0,26)	(0,37)	(4)	(64)
Série GF					(0,32)	(0,34)	(132)	(6)
Série GF5					(0,49)	(0,37)	(3)	(514)
Série GPW					(0,33)	(0,53)	(38)	(2)
Série GPWR					(0,36)	(0,39)	(1)	(71)
Série GPWT5					(0,52)	(0,39)	(10)	(1)
Série GPWX					(0,30)	(0,57)	–	(9)
Série GSC					(0,35)	(0,34)	(26)	–
Série GW					(0,35)	(0,39)	(8)	(43)
Série IG					(0,27)	(0,39)	(29)	(12)
Série O					(0,24)	(0,63)	(27)	(309)
Série PW					(0,30)	(0,73)	(499)	(1 285)
Série PWFB					(0,28)	(0,69)	(23)	(56)
Série PWR					(0,33)	(0,76)	(22)	(57)
Série PWT5					(0,37)	(0,92)	(12)	(10)
Série PWT8					(0,29)	(0,72)	(4)	(6)
Série PWX					(0,22)	(0,67)	(39)	(135)
Série PWX8					(0,11)	(0,68)	(1)	(16)
Série R					(0,25)	(0,64)	(5 854)	(14 654)
Série S					(0,26)	(0,63)	(24)	(41)
Série SC					(0,30)	(0,73)	(349)	(938)
Série S5					(0,33)	(0,89)	(4)	(11)
Série U					(0,30)	(0,73)	(68)	(208)
Série GLF					(0,32)	(0,31)	(3)	(12)
Série LB					(0,31)	(0,72)	(40)	(78)
Série LF					(0,31)	(0,76)	(58)	(133)
Série LF5					(0,41)	(1,04)	–	–
Série LW					(0,31)	(0,73)	(83)	(195)
Série LW5					(0,31)	(0,96)	(1)	(7)
Série LX					(0,31)	(0,75)	(2)	–
							<b>(8 805)</b>	<b>(22 665)</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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 CL	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	295 965	281 412	1 554	2 865	832	718	1 052	1 523	14 550	7 705
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(8 805)	(22 665)	(47)	(209)	(32)	(61)	(37)	(115)	(441)	(856)
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(6 692)	(6 857)	(24)	(36)	(14)	(11)	(17)	(20)	(375)	(287)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(5)	(27)	–	–	–	–	–	–	–	–
Rabais sur les frais de gestion	(1)	–	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>Total des distributions aux porteurs de titres</b>	<b>(6 698)</b>	<b>(6 884)</b>	<b>(24)</b>	<b>(36)</b>	<b>(14)</b>	<b>(11)</b>	<b>(17)</b>	<b>(20)</b>	<b>(375)</b>	<b>(287)</b>
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	18 642	27 084	7	20	156	43	–	–	982	9 057
Produit de l'émission de titres à la fusion	–	60 172	–	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	1 256	1 428	23	36	14	11	16	20	–	–
Paievements au rachat de titres	(46 891)	(61 011)	(339)	(766)	(112)	(23)	(170)	(274)	(860)	(1 837)
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>(26 993)</b>	<b>27 673</b>	<b>(309)</b>	<b>(710)</b>	<b>58</b>	<b>31</b>	<b>(154)</b>	<b>(254)</b>	<b>122</b>	<b>7 220</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>(42 496)</b>	<b>(1 876)</b>	<b>(380)</b>	<b>(955)</b>	<b>12</b>	<b>(41)</b>	<b>(208)</b>	<b>(389)</b>	<b>(694)</b>	<b>6 077</b>
<b>À la clôture</b>	<b>253 469</b>	<b>279 536</b>	<b>1 174</b>	<b>1 910</b>	<b>844</b>	<b>677</b>	<b>844</b>	<b>1 134</b>	<b>13 856</b>	<b>13 782</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>										
<b>Titres en circulation, à l'ouverture</b>			<b>188</b>	<b>322</b>	<b>100</b>	<b>80</b>	<b>127</b>	<b>170</b>	<b>1 794</b>	<b>882</b>
Émis			1	2	20	6	–	–	123	1 091
Émis à la fusion			–	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions			3	4	2	1	2	2	–	–
Rachetés			(42)	(90)	(14)	(3)	(21)	(31)	(108)	(223)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>			<b>150</b>	<b>238</b>	<b>108</b>	<b>84</b>	<b>108</b>	<b>141</b>	<b>1 809</b>	<b>1 750</b>

  

	Série D		Série F		Série F5		Série FB		Série GA	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	505	242	22 471	33 110	3	32	87	97	36	–
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(20)	(35)	(757)	(2 352)	–	(3)	(3)	(8)	(1)	(3)
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(12)	(9)	(487)	(599)	–	–	(2)	(2)	(1)	(1)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>Total des distributions aux porteurs de titres</b>	<b>(12)</b>	<b>(9)</b>	<b>(487)</b>	<b>(599)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(2)</b>	<b>(2)</b>	<b>(1)</b>	<b>(1)</b>
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	145	305	3 188	2 115	–	2	7	2	–	–
Produit de l'émission de titres à la fusion	–	–	–	–	–	–	–	–	–	70
Réinvestissement des distributions	10	7	371	435	–	–	2	2	1	1
Paievements au rachat de titres	(28)	(40)	(3 856)	(9 569)	–	(29)	(8)	(3)	(4)	(9)
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>127</b>	<b>272</b>	<b>(297)</b>	<b>(7 019)</b>	<b>–</b>	<b>(27)</b>	<b>1</b>	<b>1</b>	<b>(3)</b>	<b>62</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>95</b>	<b>228</b>	<b>(1 541)</b>	<b>(9 970)</b>	<b>–</b>	<b>(30)</b>	<b>(4)</b>	<b>(9)</b>	<b>(5)</b>	<b>58</b>
<b>À la clôture</b>	<b>600</b>	<b>470</b>	<b>20 930</b>	<b>23 140</b>	<b>3</b>	<b>2</b>	<b>83</b>	<b>88</b>	<b>31</b>	<b>58</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>										
<b>Titres en circulation, à l'ouverture</b>			<b>2 703</b>	<b>3 700</b>	<b>–</b>	<b>3</b>	<b>11</b>	<b>11</b>	<b>4</b>	<b>–</b>
Émis			391	250	–	–	1	–	–	–
Émis à la fusion			–	–	–	–	–	–	–	7
Réinvestissement des distributions			46	51	–	–	–	–	–	–
Rachetés			(474)	(1 133)	–	(3)	(1)	–	(1)	(1)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>77</b>	<b>58</b>	<b>2 666</b>	<b>2 868</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>11</b>	<b>11</b>	<b>3</b>	<b>6</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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 GAR		Série GD		Série GDF		Série GDPW		Série GDPWX	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	<b>38</b>	<b>-</b>	<b>19</b>	<b>-</b>	<b>1 966</b>	<b>-</b>	<b>1 628</b>	<b>-</b>	<b>166</b>	<b>-</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(1)	(2)	-	(1)	(46)	(76)	(56)	(64)	(4)	(6)
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(1)	(1)	-	-	(39)	(25)	(30)	(17)	(3)	(2)
Gains en capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Rabais sur les frais de gestion	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de titres</b>	<b>(1)</b>	<b>(1)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(39)</b>	<b>(25)</b>	<b>(30)</b>	<b>(17)</b>	<b>(3)</b>	<b>(2)</b>
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Produit de l'émission de titres à la fusion	-	64	-	24	-	2 107	-	1 886	-	165
Réinvestissement des distributions	1	1	-	-	32	21	29	17	3	2
Paiements au rachat de titres	(3)	(2)	(4)	(3)	(1 079)	(48)	(235)	(235)	(159)	-
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>(2)</b>	<b>63</b>	<b>(4)</b>	<b>21</b>	<b>(1 047)</b>	<b>2 080</b>	<b>(206)</b>	<b>1 668</b>	<b>(156)</b>	<b>167</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>(4)</b>	<b>60</b>	<b>(4)</b>	<b>20</b>	<b>(1 132)</b>	<b>1 979</b>	<b>(292)</b>	<b>1 587</b>	<b>(163)</b>	<b>159</b>
<b>À la clôture</b>	<b>34</b>	<b>60</b>	<b>15</b>	<b>20</b>	<b>834</b>	<b>1 979</b>	<b>1 336</b>	<b>1 587</b>	<b>3</b>	<b>159</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>	<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>	
Titres en circulation, à l'ouverture	4	-	2	-	201	-	166	-	17	-
Émis	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Émis à la fusion	-	6	-	2	-	211	-	189	-	17
Réinvestissement des distributions	-	-	-	-	3	2	3	2	-	-
Rachetés	-	-	-	-	(114)	(5)	(25)	(24)	(17)	-
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>4</b>	<b>6</b>	<b>2</b>	<b>2</b>	<b>90</b>	<b>208</b>	<b>144</b>	<b>167</b>	<b>-</b>	<b>17</b>

  

	Série GF		Série GF5		Série GPW		Série GPWR		Série GPWT5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	<b>4 690</b>	<b>-</b>	<b>67</b>	<b>-</b>	<b>1 230</b>	<b>-</b>	<b>28</b>	<b>-</b>	<b>239</b>	<b>-</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(132)	(514)	(3)	(2)	(38)	(71)	(1)	(1)	(10)	(9)
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(88)	(153)	(1)	-	(22)	(18)	(1)	-	(5)	-
Gains en capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	(3)	-	-	-	-	(1)	(12)
Rabais sur les frais de gestion	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de titres</b>	<b>(88)</b>	<b>(153)</b>	<b>(1)</b>	<b>(3)</b>	<b>(22)</b>	<b>(18)</b>	<b>(1)</b>	<b>-</b>	<b>(6)</b>	<b>(12)</b>
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Produit de l'émission de titres à la fusion	-	19 230	-	65	-	1 880	-	38	-	244
Réinvestissement des distributions	60	91	1	3	20	17	1	-	3	5
Paiements au rachat de titres	(1 080)	(7 011)	-	-	(266)	(95)	-	-	(2)	-
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>(1 019)</b>	<b>12 310</b>	<b>1</b>	<b>68</b>	<b>(246)</b>	<b>1 802</b>	<b>1</b>	<b>38</b>	<b>1</b>	<b>249</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>(1 239)</b>	<b>11 643</b>	<b>(3)</b>	<b>63</b>	<b>(306)</b>	<b>1 713</b>	<b>(1)</b>	<b>37</b>	<b>(15)</b>	<b>228</b>
<b>À la clôture</b>	<b>3 451</b>	<b>11 643</b>	<b>64</b>	<b>63</b>	<b>924</b>	<b>1 713</b>	<b>27</b>	<b>37</b>	<b>224</b>	<b>228</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>	<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>	
Titres en circulation, à l'ouverture	478	-	5	-	126	-	3	-	17	-
Émis	-	1	-	1	-	-	-	-	-	1
Émis à la fusion	-	1 923	-	4	-	188	-	4	-	16
Réinvestissement des distributions	6	9	-	-	2	2	-	-	-	-
Rachetés	(111)	(709)	-	-	(28)	(10)	-	-	-	-
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>373</b>	<b>1 224</b>	<b>5</b>	<b>5</b>	<b>100</b>	<b>180</b>	<b>3</b>	<b>4</b>	<b>17</b>	<b>17</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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 GPWX		Série GSC		Série GW		Série IG		Série O	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	<b>3</b>	<b>-</b>	<b>924</b>	<b>-</b>	<b>294</b>	<b>-</b>	<b>921</b>	<b>936</b>	<b>1 006</b>	<b>4 727</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	-	-	(26)	(43)	(8)	(12)	(29)	(71)	(27)	(309)
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	-	-	(14)	(11)	(4)	(3)	(24)	(23)	(24)	(105)
Gains en capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Rabais sur les frais de gestion	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de titres	-	-	(14)	(11)	(4)	(3)	(24)	(23)	(24)	(105)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	-	-	1	1	-	-	-	2	5	72
Produit de l'émission de titres à la fusion	-	3	-	1 168	-	294	-	-	-	-
Réinvestissement des distributions	-	-	12	9	4	3	24	23	24	103
Paiements au rachat de titres	-	-	(288)	(67)	(136)	(2)	-	-	(215)	(2 720)
Total des opérations sur les titres	-	3	(275)	1 111	(132)	295	24	25	(186)	(2 545)
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>-</b>	<b>3</b>	<b>(315)</b>	<b>1 057</b>	<b>(144)</b>	<b>280</b>	<b>(29)</b>	<b>(69)</b>	<b>(237)</b>	<b>(2 959)</b>
<b>À la clôture</b>	<b>3</b>	<b>3</b>	<b>609</b>	<b>1 057</b>	<b>150</b>	<b>280</b>	<b>892</b>	<b>867</b>	<b>769</b>	<b>1 768</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>	<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>	
Titres en circulation, à l'ouverture	-	-	94	-	30	-	105	99	124	539
Émis	-	-	-	-	-	-	-	-	-	7
Émis à la fusion	-	-	-	117	-	29	-	-	-	-
Réinvestissement des distributions	-	-	1	1	-	-	3	3	3	12
Rachetés	-	-	(29)	(7)	(14)	-	-	-	(27)	(334)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>66</b>	<b>111</b>	<b>16</b>	<b>29</b>	<b>108</b>	<b>102</b>	<b>100</b>	<b>224</b>

  

	Série PW		Série PWFB		Série PWR		Série PWT5		Série PWT8	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	<b>14 377</b>	<b>16 217</b>	<b>684</b>	<b>712</b>	<b>570</b>	<b>693</b>	<b>310</b>	<b>139</b>	<b>64</b>	<b>68</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(499)	(1 285)	(23)	(56)	(22)	(57)	(12)	(10)	(4)	(6)
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(263)	(274)	(15)	(14)	(11)	(12)	(6)	(2)	(1)	(1)
Gains en capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-	(2)	(2)	(1)	(2)
Rabais sur les frais de gestion	(1)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de titres	(264)	(274)	(15)	(14)	(11)	(12)	(8)	(4)	(2)	(3)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	530	1 096	3	2	102	23	5	-	-	-
Produit de l'émission de titres à la fusion	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Réinvestissement des distributions	229	238	15	14	11	12	6	1	2	2
Paiements au rachat de titres	(1 828)	(2 013)	(33)	(13)	(69)	(12)	-	(8)	-	-
Total des opérations sur les titres	(1 069)	(679)	(15)	3	44	23	11	(7)	2	2
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>(1 832)</b>	<b>(2 238)</b>	<b>(53)</b>	<b>(67)</b>	<b>11</b>	<b>(46)</b>	<b>(9)</b>	<b>(21)</b>	<b>(4)</b>	<b>(7)</b>
<b>À la clôture</b>	<b>12 545</b>	<b>13 979</b>	<b>631</b>	<b>645</b>	<b>581</b>	<b>647</b>	<b>301</b>	<b>118</b>	<b>60</b>	<b>61</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>	<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>	
Titres en circulation, à l'ouverture	1 734	1 817	83	81	65	74	30	12	8	7
Émis	65	129	-	-	13	2	-	-	-	-
Émis à la fusion	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Réinvestissement des distributions	28	28	2	2	1	1	1	-	-	-
Rachetés	(225)	(237)	(3)	(2)	(8)	(1)	-	-	-	-
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>1 602</b>	<b>1 737</b>	<b>82</b>	<b>81</b>	<b>71</b>	<b>76</b>	<b>31</b>	<b>12</b>	<b>8</b>	<b>7</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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 PWX		Série PWX8		Série R		Série S		Série SC	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	<b>1 533</b>	<b>1 964</b>	<b>186</b>	<b>208</b>	<b>205 910</b>	<b>189 285</b>	<b>734</b>	<b>360</b>	<b>9 884</b>	<b>11 947</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(39)	(135)	(1)	(16)	(5 854)	(14 654)	(24)	(41)	(349)	(938)
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(35)	(42)	(3)	(4)	(4 839)	(4 841)	(19)	(13)	(175)	(192)
Gains en capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	(1)	(5)	-	-	-	-	-	-
Rabais sur les frais de gestion	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de titres</b>	<b>(35)</b>	<b>(42)</b>	<b>(4)</b>	<b>(9)</b>	<b>(4 839)</b>	<b>(4 841)</b>	<b>(19)</b>	<b>(13)</b>	<b>(175)</b>	<b>(192)</b>
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	47	10	-	-	12 157	11 174	121	296	540	1 576
Produit de l'émission de titres à la fusion	-	-	-	-	-	32 520	-	-	-	-
Réinvestissement des distributions	31	33	-	1	-	-	19	13	155	167
Paiements au rachat de titres	(378)	(274)	(158)	(1)	(32 906)	(32 071)	(129)	(14)	(1 431)	(2 403)
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>(300)</b>	<b>(231)</b>	<b>(158)</b>	<b>-</b>	<b>(20 749)</b>	<b>11 623</b>	<b>11</b>	<b>295</b>	<b>(736)</b>	<b>(660)</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>(374)</b>	<b>(408)</b>	<b>(163)</b>	<b>(25)</b>	<b>(31 442)</b>	<b>(7 872)</b>	<b>(32)</b>	<b>241</b>	<b>(1 260)</b>	<b>(1 790)</b>
<b>À la clôture</b>	<b>1 159</b>	<b>1 556</b>	<b>23</b>	<b>183</b>	<b>174 468</b>	<b>181 413</b>	<b>702</b>	<b>601</b>	<b>8 624</b>	<b>10 157</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>	<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>	
Titres en circulation, à l'ouverture	190	226	23	23	25 387	21 671	89	40	1 206	1 355
Émis	6	1	-	-	1 531	1 355	15	35	68	188
Émis à la fusion	-	-	-	-	-	3 911	-	-	-	-
Réinvestissement des distributions	4	4	-	-	-	-	2	2	19	20
Rachetés	(48)	(33)	(20)	-	(4 137)	(3 898)	(16)	(2)	(178)	(286)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>152</b>	<b>198</b>	<b>3</b>	<b>23</b>	<b>22 781</b>	<b>23 039</b>	<b>90</b>	<b>75</b>	<b>1 115</b>	<b>1 277</b>

  

	Série S5		Série U		Série GLF		Série LB		Série LF	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	<b>78</b>	<b>152</b>	<b>1 920</b>	<b>2 599</b>	<b>135</b>	<b>-</b>	<b>1 106</b>	<b>831</b>	<b>1 560</b>	<b>1 927</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(4)	(11)	(68)	(208)	(3)	(12)	(40)	(78)	(58)	(133)
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(1)	(2)	(33)	(42)	(3)	(4)	(20)	(16)	(36)	(33)
Gains en capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	(2)	-	-	-	-	-	-	-	-
Rabais sur les frais de gestion	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de titres</b>	<b>(1)</b>	<b>(4)</b>	<b>(33)</b>	<b>(42)</b>	<b>(3)</b>	<b>(4)</b>	<b>(20)</b>	<b>(16)</b>	<b>(36)</b>	<b>(33)</b>
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	2	1	-	-	-	-	172	715	327	53
Produit de l'émission de titres à la fusion	-	-	-	-	-	414	-	-	-	-
Réinvestissement des distributions	1	2	33	42	3	4	20	16	36	33
Paiements au rachat de titres	(6)	(44)	(194)	(196)	(29)	(100)	(225)	(546)	(203)	(356)
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>(3)</b>	<b>(41)</b>	<b>(161)</b>	<b>(154)</b>	<b>(26)</b>	<b>318</b>	<b>(33)</b>	<b>185</b>	<b>160</b>	<b>(270)</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>(8)</b>	<b>(56)</b>	<b>(262)</b>	<b>(404)</b>	<b>(32)</b>	<b>302</b>	<b>(93)</b>	<b>91</b>	<b>66</b>	<b>(436)</b>
<b>À la clôture</b>	<b>70</b>	<b>96</b>	<b>1 658</b>	<b>2 195</b>	<b>103</b>	<b>302</b>	<b>1 013</b>	<b>922</b>	<b>1 626</b>	<b>1 491</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>	<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>	
Titres en circulation, à l'ouverture	9	15	231	291	14	-	133	93	177	203
Émis	-	-	-	-	-	1	22	83	37	5
Émis à la fusion	-	-	-	-	-	41	-	-	-	-
Réinvestissement des distributions	-	-	4	5	-	-	2	2	4	4
Rachetés	(1)	(4)	(23)	(23)	(3)	(10)	(28)	(64)	(23)	(38)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>8</b>	<b>11</b>	<b>212</b>	<b>273</b>	<b>11</b>	<b>32</b>	<b>129</b>	<b>114</b>	<b>195</b>	<b>174</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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 LF5		Série LW		Série LW5		Série LX	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>								
<b>À l'ouverture</b>	<b>1</b>	<b>1</b>	<b>2 454</b>	<b>2 258</b>	<b>94</b>	<b>95</b>	<b>56</b>	<b>1</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	–	–	(83)	(195)	(1)	(7)	(2)	–
Distributions aux porteurs de titres :								
Revenu de placement	–	–	(43)	(41)	–	(1)	(1)	–
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	–	–	–	(1)	–	–
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	–	–	(43)	(41)	–	(2)	(1)	–
Opérations sur les titres :								
Produit de l'émission de titres	–	–	144	519	–	–	–	–
Produit de l'émission de titres à la fusion	–	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	–	–	43	41	–	2	1	–
Paievements au rachat de titres	–	–	(390)	(227)	(68)	–	–	–
Total des opérations sur les titres	–	–	(203)	333	(68)	2	1	–
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(329)</b>	<b>97</b>	<b>(69)</b>	<b>(7)</b>	<b>(2)</b>	<b>–</b>
<b>À la clôture</b>	<b>1</b>	<b>1</b>	<b>2 125</b>	<b>2 355</b>	<b>25</b>	<b>88</b>	<b>54</b>	<b>1</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>	<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>	
Titres en circulation, à l'ouverture	–	–	290	248	9	8	7	–
Émis	–	–	18	59	–	–	–	–
Émis à la fusion	–	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	–	–	5	5	–	–	–	–
Rachetés	–	–	(47)	(26)	(6)	–	–	–
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>266</b>	<b>286</b>	<b>3</b>	<b>8</b>	<b>7</b>	<b>–</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.



# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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
	\$	\$
<b>Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation	(8 805)	(22 665)
Ajustements pour :		
Perte (profit) net(te) réalisé(e) sur les placements	10 461	14 595
Variation de la perte (du profit) net(te) latent(e) sur les placements	5 801	23 256
Distributions en nature reçues de fonds sous-jacents	–	–
Achat de placements	(122 661)	(117 039)
Produit de la vente et de l'échéance de placements	118 367	122 679
(Augmentation) diminution des sommes à recevoir et autres actifs	7 523	(515)
Augmentation (diminution) des sommes à payer et autres passifs	–	(137)
<b>Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités d'exploitation</b>	<b>10 686</b>	<b>20 174</b>
<b>Flux de trésorerie liés aux activités de financement</b>		
Produit de l'émission de titres	18 466	28 491
Paiements au rachat de titres	(46 429)	(58 474)
Distributions versées, déduction faite des réinvestissements	(5 442)	(5 452)
<b>Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités de financement</b>	<b>(33 405)</b>	<b>(35 435)</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>	<b>(22 719)</b>	<b>(15 261)</b>
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à l'ouverture	25 962	27 002
Incidence des fluctuations des taux de change sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie	64	151
<b>Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture</b>	<b>3 307</b>	<b>11 892</b>
Trésorerie	3 307	10 294
Équivalents de trésorerie	–	1 598
<b>Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture</b>	<b>3 307</b>	<b>11 892</b>
<b>Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :</b>		
Dividendes reçus	390	350
Impôt étranger payé (recouvré)	(20)	10
Intérêts reçus	6 487	6 190
Intérêts versés	3	5

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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 \$)
<b>OBLIGATIONS</b>					
407 International Inc. 1,80 % 22-05-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	220 000	217	208
407 International Inc. 4,22 % 14-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	276 000	276	263
407 International Inc. 3,14 % 06-03-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	140 000	139	125
407 International Inc. 3,43 % 01-06-2033, série MTN	Canada	Sociétés – Non convertibles	104 000	108	90
407 International Inc. 4,19 % 25-04-2042, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	72 000	78	62
407 International Inc. 3,60 % 21-05-2047, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	690 000	671	530
407 International Inc. 3,67 % 08-03-2049, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	21 000	18	16
407 International Inc. 4,86 % 31-07-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	214 000	214	200
AerCap Ireland Capital DAC 3,00 % 29-10-2028	Irlande	Sociétés – Non convertibles	180 000 USD	207	210
Aéroports de Montréal 3,92 % 12-06-2045, rachetables 2044	Canada	Sociétés – Non convertibles	32 000	30	26
AES Panama Generation Holdings SRL					
4,38 % 31-05-2030, rachetables 2030	Panama	Sociétés – Non convertibles	1 585 675 USD	2 052	1 836
AIMCo Realty Investors LP 2,20 % 04-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	232 000	228	209
AIMCo Realty Investors LP 2,71 % 01-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	46 000	42	40
Albertsons Cos. Inc. 4,63 % 15-01-2027, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	330 000 USD	440	423
Algonquin Power & Utilities Corp. 4,60 % 29-01-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	48 000	46	45
Algonquin Power & Utilities Corp. 2,85 % 15-07-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	614 000	557	498
Algonquin Power & Utilities Corp., taux variable 18-01-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	312 000	303	248
Alimentation Couche-Tard inc.					
2,95 % 25-01-2030, rachetables 2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	260 000 USD	329	295
Alimentation Couche-Tard inc. 5,59 % 25-09-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	459 000	459	458
AltaGas Ltd. 4,64 % 15-05-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	125 000	125	122
AltaGas Ltd. 2,17 % 16-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	185 000	180	164
AltaGas Ltd., taux variable 11-01-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	195 000	189	154
AltaGas Ltd., taux variable 17-08-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	42 000	42	40
AltaLink, L.P. 1,51 % 11-09-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	170 000	163	134
Alice 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	Brésil	Sociétés – Non convertibles	270 000 USD	341	336
Amazon.com Inc. 4,70 % 01-12-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	396 000 USD	538	515
América Móvil SAB de CV 9,50 % 27-01-2031	Mexique	Sociétés – Non convertibles	28 240 000 MXN	2 174	2 073
American Tower Corp. 1,88 % 15-10-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	210 000 USD	261	216
Anglian Water Services Financing PLC 4,53 % 26-08-2032	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	192 000	192	172
Apple Inc. 3,35 % 10-01-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	740 000 AUD	703	644
Apple Inc. 2,65 % 11-05-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 508 000 USD	1 484	1 260
ARC Resources Ltd. 2,35 % 10-03-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	225 000	221	207
ARD Finance SA 6,50 % 30-06-2027 144A	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	40 000 USD	53	41
Ardagh Packaging Finance PLC 5,25 % 15-08-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	49 000 USD	56	55
Ascend Wellness Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 27-08-2025	États-Unis	Prêts à terme	142 000 USD	179	164
Athene Global Funding, taux variable 09-04-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	678 000	676	676
Athene Global Funding 3,13 % 10-03-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	233 000	231	222
Athene Global Funding 2,10 % 24-09-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	360 000	352	330
Bank of America Corp., taux variable 15-09-2027 (taux variable différé)	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	115 000	108	103
Bank of America Corp., taux variable 16-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	288 000	285	267
Bank of America Corp., taux variable 04-04-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	270 000	263	235
Banque de Montréal 4,71 % 07-12-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	21 000	21	20
Banque de Montréal, taux variable 27-10-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	26 000	27	26
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	866 000	866	839
La Banque de Nouvelle-Écosse 2,16 % 03-02-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	435 000	415	415
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 27-07-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	676 000	669	647
BCE Inc. 2,20 % 29-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	342 000	332	295
BCE Inc. 3,00 % 17-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	305 000	271	254
BCE Inc. 5,85 % 10-11-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	189 000	193	188
bclMC Realty Corp. 1,06 % 12-03-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	176 000	174	173
bclMC Realty Corp. 1,07 % 04-02-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	245 000	239	220
Becle SAB de CV 2,50 % 14-10-2031	Mexique	Sociétés – Non convertibles	877 000 USD	1 057	911
Bell Canada 5,15 % 14-11-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	192 000	192	188
Broadcast Media Partners Holdings Inc. 4,50 % 01-05-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	67 000 USD	80	75
Broadcom Inc. 4,11 % 15-09-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	71 000 USD	89	89
Brookfield Infrastructure Finance ULC 4,20 % 11-09-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	289 000	286	267

# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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 \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Brookfield Infrastructure Finance ULC 2,86 % 01-09-2032, rachetables 2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	57 000	54	44
Brookfield Renewable Energy Partners ULC 3,63 % 15-01-2027, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	667 000	670	624
Brookfield Renewable Partners ULC 4,25 % 15-01-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	358 000	357	334
Brookfield Residential Properties Inc. 5,13 % 15-06-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	95 000	92	78
Bruce Power L.P. 2,68 % 21-12-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	85 000	77	74
Bruce Power L.P. 4,00 % 21-06-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	345 000	339	314
CAE Inc. 5,54 % 12-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	179 000	179	175
Canadian Core Real Estate LP 3,30 % 02-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	267 000	264	241
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 21-04-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	543 000	530	488
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 28-07-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	19
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada 4,40 % 10-05-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	199 000	199	185
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 2,54 % 28-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	671 000	640	596
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 3,15 % 13-03-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	320 000	314	286
CAP SA 3,90 % 27-04-2031	Chili	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	250	202
Capital Power Corp. 5,82 % 15-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	169 000	169	167
Capital Power Corp. 3,15 % 01-10-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	302 000	289	239
Capital Power Corp., taux variable 09-09-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	109 000	109	105
Celulosa Arauco y Constitución SA 4,20 % 29-01-2030, rachetables 2029	Chili	Sociétés – Non convertibles	900 000 USD	1 155	1 047
Cemex SAB de CV, taux variable 08-09-2169	Mexique	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	242	255
Enovus Energy Inc. 3,50 % 07-02-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	550 000	540	506
Enovus Energy Inc. 3,75 % 15-02-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	37 000 USD	37	33
Centrais Elétricas Brasileiras SA 3,63 % 04-02-2025	Brésil	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	264	259
Charter Communications Operating LLC 2,80 % 01-04-2031, rachetables 2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	259	213
Charter Communications Operating LLC 2,30 % 01-02-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	270 000 USD	331	269
Charter Communications Operating LLC 3,50 % 01-06-2041	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	150 000 USD	176	129
Chevron U.S.A. Inc. 2,34 % 12-08-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	25 000 USD	23	19
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 2,46 % 30-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	126 000	124	114
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 5,40 % 01-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	423 000	423	399
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 5,70 % 28-02-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	281 000	280	269
GIFI Holdings (Group) Co. Ltd. 6,00 % 16-07-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	393 000 USD	129	38
Ville d'Oslo 3,65 % 08-11-2023	Norvège	Gouvernements étrangers	1 000 000 NOK	134	127
The Clorox Co. 1,80 % 15-05-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	240 000 USD	315	258
Coca-Cola FEMSA SAB de CV 2,75 % 22-01-2030, rachetables 2029	Mexique	Sociétés – Non convertibles	348 000 USD	437	400
Cogeco Communications inc. 2,99 % 22-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	196 000	188	158
Colbún SA 3,15 % 19-01-2032	Chili	Sociétés – Non convertibles	202 000 USD	250	221
Cologix Data Centers Issuer LLC 4,94 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	79 000	78	71
Cologix Data Centers Issuer LLC 5,68 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	64 000	63	57
Columbia Care Inc. 6,00 % 29-06-2025, conv.	Canada	Sociétés – Convertibles	67 000 USD	83	70
Columbia Care Inc. 9,50 % 03-02-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000 USD	63	58
CommScope Inc. 4,75 % 01-09-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	40 000 USD	50	40
CommScope Technologies Finance LLC 8,25 % 01-03-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	116 000 USD	152	104
Conair Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 13-05-2028	États-Unis	Prêts à terme	441 000 USD	567	575
Connect Finco SARL 6,75 % 01-10-2026	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	70 000 USD	90	89
Continental Resources Inc. 5,75 % 15-01-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	988 000 USD	1 255	1 265
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	245 455	245	222
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-09-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	239 916	239	217
Corus Entertainment Inc. 5,00 % 11-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	90 000	88	61
Country Garden Holdings Co. Ltd. 2,70 % 12-07-2026	Chine	Sociétés – Non convertibles	600 000 USD	508	55
Country Garden Holdings Co. Ltd. 5,63 % 14-01-2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	1 054 000 USD	753	92
CPPIB Capital Inc. 1,95 % 30-09-2029	Canada	Gouvernement fédéral	550 000	536	473
CPPIB Capital Inc. 3,95 % 02-06-2032	Canada	Gouvernement fédéral	104 000	104	98
Fonds de placement immobilier Crombie 3,92 % 21-06-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	51 000	50	47
Fonds de placement immobilier Crombie 3,13 % 12-08-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	78 000	75	61

# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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 \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Curaleaf Holdings Inc. 8,00 % 15-12-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	250 000 USD	316	281
DIRECTV Holdings LLC 5,88 % 15-08-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	49 000 USD	60	59
Dollarama inc. 5,08 % 27-10-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	153 000	152	151
Dollarama inc. 5,53 % 26-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	219 000	219	219
Domtar Corp. 6,75 % 01-10-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	126	113
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 1,66 % 22-12-2025 (A)	Canada	Sociétés – Non convertibles	292 000	285	265
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,54 % 07-12-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	176 000	173	157
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,06 % 17-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	196 000	190	169
Ecopetrol SA 6,88 % 29-04-2030, rachetables 2030	Colombie	Sociétés – Non convertibles	850 000 USD	1 222	1 057
Ecopetrol SA 4,63 % 02-11-2031	Colombie	Sociétés – Non convertibles	242 000 USD	249	251
L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie 3,63 % 17-04-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	23 000	22	18
Empresas CMPC SA 3,00 % 06-04-2031	Chili	Sociétés – Non convertibles	435 000 USD	522	470
Enbridge Gas Inc. 3,20 % 15-09-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	8	7
Enbridge Inc. 4,90 % 26-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	143 000	143	138
Enbridge Inc. 3,10 % 21-09-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	414 000	395	325
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 500 000	3 473	3 156
Enbridge Inc., taux variable 12-04-2078, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 310 000	1 329	1 233
Enel Finance International NV 5,00 % 15-06-2032 144A	Italie	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	244	247
Énergir inc. 2,10 % 16-04-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	180 000	176	162
Énergir inc. 4,67 % 27-09-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	178 000	178	169
EPCOR Utilities Inc. 3,55 % 27-11-2047, rachetables 2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	580 000	561	440
EPCOR Utilities Inc. 3,11 % 08-07-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	440 000	416	304
EPCOR Utilities Inc. 4,73 % 02-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	244 000	244	223
Exxon Mobil Corp. 3,10 % 16-08-2049	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	35 000 USD	36	31
Fairfax Financial Holdings Ltd. 8,30 % 15-04-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	860 000 USD	1 290	1 211
Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,23 % 14-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	170 000	168	154
Fairfax Financial Holdings Ltd. 3,95 % 03-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	333 000	325	281
Fairfax India Holdings Corp. 5,00 % 26-02-2028 144A	Inde	Sociétés – Non convertibles	440 000 USD	551	514
Fonds de placement immobilier First Capital 3,45 % 01-03-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	146 000	129	127
First West Credit Union 9,19 % 09-08-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	157 000	157	155
Flynn America LP, prêt à terme B de premier rang taux variable 23-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	136 744 USD	167	176
Compagnie Crédit Ford du Canada 2,96 % 16-09-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	129 000	126	115
Ford Motor Credit Co. LLC 6,78 % 15-09-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	410 000	410	410
Fortified Trust 1,96 % 23-10-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	536 000	526	479
Fortis Inc. 4,43 % 31-05-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	446 000	447	422
Frontera Generation Holdings LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 28-07-2026	États-Unis	Prêts à terme	11 281 USD	14	4
Frontera Generation Holdings LLC, prêt à terme de second rang, taux variable 26-04-2028	États-Unis	Prêts à terme	10 949 USD	8	–
FXI Holdings Inc. 7,88 % 01-11-2024 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 000 USD	2	3
Financière General Motors du Canada Ltée 5,20 % 09-02-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	142 000	142	136
GFL Environmental Inc. 3,50 % 01-09-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	23 000 USD	29	27
Gibson Energy Inc. 2,85 % 14-07-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	210 000	214	188
Gibson Energy Inc., taux variable 22-12-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	105 000	102	86
GoDaddy Operating Co. LLC 3,50 % 01-03-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	5 000 USD	6	6
The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 30-11-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	526 000	516	475
The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 28-02-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	252 000	243	213
Gouvernement de l'Australie 1,75 % 21-06-2051	Australie	Gouvernements étrangers	4 700 000 AUD	2 539	2 181
Gouvernement des Bahamas 5,75 % 16-01-2024	Bahamas	Gouvernements étrangers	1 200 000 USD	1 614	1 612
Gouvernement des Bahamas 6,95 % 20-11-2029	Bahamas	Gouvernements étrangers	340 000 USD	431	377
Gouvernement des Bahamas 8,95 % 15-10-2032	Bahamas	Gouvernements étrangers	590 000 USD	709	691
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2027	Brésil	Gouvernements étrangers	1 600 000 BRL	4 112	4 220
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2029	Brésil	Gouvernements étrangers	1 200 000 BRL	3 671	3 081
Gouvernement du Canada 1,25 % 01-03-2027	Canada	Gouvernement fédéral	6 000	5	5
Gouvernement du Canada 3,50 % 01-03-2028	Canada	Gouvernement fédéral	4 700 000	4 582	4 548
Gouvernement du Canada 2,50 % 01-12-2032	Canada	Gouvernement fédéral	118 000	113	104
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-06-2033	Canada	Gouvernement fédéral	52 000	49	47
Gouvernement du Canada 2,00 % 01-12-2051	Canada	Gouvernement fédéral	100 000	79	69
Gouvernement du Canada 1,75 % 01-12-2053	Canada	Gouvernement fédéral	47 000	30	30
Gouvernement de l'Allemagne 0 % 15-08-2052	Allemagne	Gouvernements étrangers	6 850 000 EUR	7 287	4 228
Gouvernement d'Israël 0 % 11-10-2023	Israël	Gouvernements étrangers	28 500 000 ILS	10 811	10 150
Gouvernement du Japon 0 % 02-10-2023	Japon	Gouvernements étrangers	587 000 000 JPY	5 510	5 334

# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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 \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Gouvernement du Mexique 8,50 % 31-05-2029	Mexique	Gouvernements étrangers	70 900 000 MXN	5 458	5 182
Gouvernement du Mexique 2,66 % 24-05-2031	Mexique	Gouvernements étrangers	2 100 000 USD	2 474	2 250
Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 4,50 % 15-05-2030	Nouvelle-Zélande	Gouvernements étrangers	2 600 000 NZD	2 137	1 970
Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 3,50 % 14-04-2033	Nouvelle-Zélande	Gouvernements étrangers	9 800 000 NZD	7 374	6 907
Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 4,25 % 15-05-2034	Nouvelle-Zélande	Gouvernements étrangers	4 590 000 NZD	3 721	3 403
Gouvernement de l'Afrique du Sud 8,88 % 28-02-2035	Afrique du Sud	Gouvernements étrangers	74 000 000 ZAR	4 376	4 191
Gouvernement des Bahamas 9,00 % 16-06-2029	Bahamas	Gouvernements étrangers	600 000 USD	610	731
GPS Blue Financing DAC 5,65 % 09-11-2041	Irlande	Sociétés – Non convertibles	1 500 000 USD	2 115	1 963
Fiducie de placement immobilier Granite 3,06 % 04-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	148 000	138	133
Fiducie de placement immobilier Granite 2,19 % 30-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	415 000	388	347
Fiducie de placement immobilier Granite 2,38 % 18-12-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	45 000	37	35
Gray Escrow Inc. 7,00 % 15-05-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	30 000 USD	37	35
Gray Television Inc. 5,38 % 15-11-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	155 000 USD	192	138
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 1,54 % 03-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	268 000	236	230
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 6,47 % 02-02-2034, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	55 000	64	60
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 3,15 % 05-10-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000	40	35
Grupo GICSA SAB de CV 9,50 % 18-12-2034	Mexique	Sociétés – Non convertibles	8 227 375 MXN	509	390
HCA Healthcare Inc. 3,50 % 01-09-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	84 000 USD	112	97
Heathrow Funding Ltd. 3,25 % 21-05-2025	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	170 000	166	163
Heathrow Funding Ltd. 2,69 % 13-10-2027	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	420 000	411	374
Heathrow Funding Ltd. 3,79 % 04-09-2030, rachetables 2030	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	530 000	521	464
Heathrow Funding Ltd. 3,73 % 13-04-2033	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	184 000	183	152
Hidroviás do Brasil SA 4,95 % 08-02-2031	Brésil	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	256	218
Compagnie Home Trust 5,32 % 13-06-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	220 000	220	217
Honda Canada Finance Inc. 4,87 % 23-09-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	563 000	564	546
Honda Canada Finance Inc. 5,73 % 28-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	146 000	146	146
Hydro One Inc. 1,69 % 16-01-2031, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	149 000	142	118
Hydro One Inc. 2,23 % 17-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	680 000	624	550
Hydro One Ltd. 1,41 % 15-10-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	260 000	252	224
iA Société financière inc., taux variable 20-06-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	130 000	130	127
iA Société financière inc., taux variable 25-02-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	600 000	592	545
L'Ordre Indépendant des Forestiers, taux variable 15-10-2035, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	210 000	201	165
Indy US Bidco LLC, prêt à terme B3 de premier rang, taux variable 05-03-2028	États-Unis	Prêts à terme	77 419 USD	98	101
Intact Corporation financière 5,46 % 22-09-2032 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	167 000 USD	221	215
Intact Corporation financière, taux variable 31-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	81 000	79	69
Inter Pipeline Ltd. 2,73 % 18-04-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	440 000	441	433
Inter Pipeline Ltd. 3,48 % 16-12-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	500 000	490	463
Inter Pipeline Ltd. 4,23 % 01-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	612 000	616	574
Inter Pipeline Ltd. 5,76 % 17-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	155 000	155	153
Inter Pipeline Ltd. 5,71 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	184 000	184	177
Inter Pipeline Ltd. 3,98 % 25-11-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 000 000	964	840
Inter Pipeline Ltd., taux variable 26-03-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	130 000	130	120
Inter Pipeline Ltd., taux variable 19-11-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	290 000	286	262
Interconexión Eléctrica SA ESP 3,83 % 26-11-2033	Colombie	Sociétés – Non convertibles	1 200 000 USD	1 422	1 338
Banque internationale pour la reconstruction et le développement 6,25 % 12-01-2028	Supranationales	s.o.	15 100 000 000 IDR	1 329	1 327
Ivanhoe Cambridge II Inc. 2,30 % 12-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	172 000	170	165
Jadex Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 12-02-2028	États-Unis	Prêts à terme	180 132 USD	233	231
JPMorgan Chase & Co. 1,90 % 05-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	704 000	684	619
Kaisa Group Holdings Ltd. 9,38 % 30-06-2024	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	186	16
Kaisa Group Holdings Ltd. 11,70 % 11-11-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	400 000 USD	481	33
Kaisa Group Holdings 8,65 % 27-10-2023	Chine	Sociétés – Non convertibles	700 000 USD	271	56
Kaisa Group Holdings 10,50 % 27-10-2023	Chine	Sociétés – Non convertibles	700 000 USD	372	56
Keyera Corp. 3,96 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000	50	44
Keyera Corp., taux variable 13-06-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000	200	186
Keyera Corp., taux variable 10-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	270 000	264	230
Knight Health Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 17-12-2028	États-Unis	Prêts à terme	158 183 USD	189	56
KP Germany Erste GmbH, prêt à terme B de premier rang, taux variable 04-02-2026	Allemagne	Prêts à terme	100 000 EUR	153	136

# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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 \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Kronos Acquisition Holdings Inc. 5,00 % 31-12-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000 USD	12	12
Produits Kruger S.E.C. 6,00 % 24-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	140 000	140	135
Produits Kruger S.E.C. 5,38 % 09-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	49 000	48	42
LABL Escrow Issuer LLC 6,75 % 15-07-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	41 000 USD	55	54
LABL Escrow Issuer LLC 10,50 % 15-07-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	74 000 USD	98	94
LABL Inc. 8,25 % 01-11-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	74 000 USD	84	82
Liberty Utilities (Canada) LP 3,32 % 14-02-2050, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	150 000	140	101
LifeScan Global Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 31-12-2026	États-Unis	Prêts à terme	502 498 USD	637	546
Les Compagnies Loblaw Itée 4,49 % 11-12-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	21	19
Les Compagnies Loblaw Itée 2,28 % 07-05-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	208 000	201	172
Les Compagnies Loblaw Itée 5,34 % 13-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	163 000	163	154
Logan Group Co. Ltd. 4,70 % 06-07-2026	Chine	Sociétés – Non convertibles	1 322 000 USD	832	130
Lower Mattagami Energy LP 2,43 % 14-05-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	268 000	259	221
LSF10 XL Bidco SCA, prêt à terme B de premier rang, taux variable 30-03-2028	Luxembourg	Prêts à terme	102 416 EUR	151	127
Luxembourg Investment Co. 428 SARL, prêt à terme B de premier rang, taux variable 22-10-2028	Luxembourg	Prêts à terme	96 356 USD	118	96
Magenta Buyer LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 03-05-2028	États-Unis	Prêts à terme	275 277 USD	347	280
Magna International Inc. 4,95 % 31-01-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	193 000	193	185
Banque Manuvie du Canada 1,54 % 14-09-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	380 000	370	339
Société Financière Manuvie, taux variable 10-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	408 000	408	396
Société Financière Manuvie, taux variable 19-03-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	288 000	278	210
Société Financière Manuvie, taux variable 19-06-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	245 000	245	235
MARB BondCo PLC 3,95 % 29-01-2031	Brésil	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	205	202
Mattamy Group Corp. 4,63 % 01-03-2030, rachetables 2025 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	77 000 USD	85	89
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 7,88 % 15-08-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	124 000 USD	166	163
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 9,25 % 15-04-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	236 000 USD	298	281
Metro inc. 4,66 % 07-02-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	68 000	67	63
Mexico Remittances Funding Fiduciary Estate Management SARL 4,88 % 15-01-2028	Mexique	Sociétés – Non convertibles	765 000 USD	928	934
Micron Technology Inc. 5,38 % 15-04-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	533 000 USD	717	699
Microsoft Corp. 2,53 % 01-06-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 334 000 USD	2 249	1 952
Minerva Luxembourg SA 8,88 % 13-09-2033	Brésil	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	273	270
Minerva Merger Sub Inc. 6,50 % 15-02-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	190 000 USD	234	216
Morgan Stanley 3,00 % 07-02-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	340 000	335	337
Mozart Debt Merger Sub Inc. 3,88 % 01-04-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	129 000 USD	163	148
Mozart Debt Merger Sub Inc. 5,25 % 01-10-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	190 000 USD	240	223
Banque Nationale du Canada 2,55 % 12-07-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000	39	39
NAV CANADA 2,06 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	180 000	173	149
Nederlandse Waterschapsbank NV 1,00 % 28-05-2030	Pays-Bas	Gouvernements étrangers	600 000 USD	772	636
Nestlé Holdings Inc. 2,19 % 26-01-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	280 000	273	242
New Red Finance Inc. 4,00 % 15-10-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000 USD	148	135
Nexstar Escrow Inc. 5,63 % 15-07-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	83 000 USD	110	100
North West Redwater Partnership Co. Ltd. 2,80 % 01-06-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	551 000	531	457
North West Redwater Partnership Co. Ltd. 3,70 % 23-02-2043, rachetables 2042	Canada	Sociétés – Non convertibles	90 000	86	70
Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc. 4,11 % 31-03-2042	Canada	Sociétés – Non convertibles	448 679	440	368
NVIDIA Corp. 3,50 % 01-04-2050, rachetables 2049	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000 USD	22	20
Occidental Petroleum Corp. 6,13 % 01-01-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	939 000 USD	1 254	1 257
OMERS Finance Trust 2,60 % 14-05-2029	Canada	Gouvernements provinciaux	403 000	397	360
Ontario Power Generation Inc. 2,98 % 13-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	256 000	258	226
Ontario Teachers' Finance Trust 1,10 % 19-10-2027	Canada	Gouvernements provinciaux	220 000	213	190
Régime de retraite des enseignantes et des enseignants de l'Ontario 4,45 % 02-06-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	249 000	248	240
Corporation Parkland du Canada 3,88 % 16-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	520 000	520	482
Corporation Parkland du Canada 4,38 % 26-03-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	63 000	61	55
Corporation Parkland du Canada 4,50 % 01-10-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000 USD	307	293
Corporation Pétroles Parkland 5,88 % 15-07-2027 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	13 000 USD	17	17
Corporation Pétroles Parkland 6,00 % 23-06-2028, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	440 000	434	420
PayPal Holdings Inc. 2,65 % 01-10-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	280 000 USD	364	351

# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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 \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
PayPal Holdings Inc. 2,30 % 01-06-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	150 000 USD	198	167
Pembina Pipeline Corp. 4,02 % 27-03-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	490 000	519	454
Pembina Pipeline Corp. 4,81 % 25-03-2044	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	21	16
Pembina Pipeline Corp., taux variable 25-01-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	360 000	348	290
Petróleos de Venezuela SA 6,00 % 16-05-2024	Venezuela	Sociétés – Non convertibles	380 000 USD	98	30
Petróleos Mexicanos 5,95 % 28-01-2031 144A	Mexique	Sociétés – Non convertibles	1 649 000 USD	1 932	1 602
Petróleos Mexicanos 6,70 % 16-02-2032	Mexique	Sociétés – Non convertibles	481 000 USD	589	484
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 4,65 % 19-05-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	863 000 USD	1 161	1 123
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 4,75 % 19-05-2033	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	265 000 USD	357	341
Pioneer Natural Resources Co. 2,15 % 15-01-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	183 000 USD	199	196
Province de l'Alberta 4,15 % 01-06-2033	Canada	Gouvernements provinciaux	340 000	332	324
Province du Manitoba 3,80 % 05-09-2053	Canada	Gouvernements provinciaux	40 000	37	33
Province de l'Ontario 4,05 % 02-02-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	1 568 000	1 567	1 494
Province de l'Ontario 3,65 % 02-06-2033	Canada	Gouvernements provinciaux	493 000	458	451
Province de l'Ontario 4,15 % 02-12-2054	Canada	Gouvernements provinciaux	385 000	367	347
Province de Québec 3,65 % 20-05-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	552 000	553	510
Province de Québec 4,40 % 01-12-2055	Canada	Gouvernements provinciaux	53 000	56	50
PSP Capital Inc. 2,05 % 15-01-2030	Canada	Gouvernement fédéral	77 000	75	66
PSP Capital Inc. 2,60 % 01-03-2032	Canada	Gouvernement fédéral	570 000	557	485
Quasar Intermediate Holdings Ltd., prêt à terme B de premier rang, taux variable 20-01-2029	États-Unis	Prêts à terme	152 460 USD	187	173
Reliance LP 2,68 % 01-12-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	180 000	175	157
Reliance LP 2,67 % 01-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	287 000	279	245
Fonds de placement immobilier RioCan 5,96 % 01-10-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	222 000	222	215
Rogers Communications Inc. 3,10 % 15-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	300 000	287	288
Rogers Communications Inc. 5,70 % 21-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	410 000	409	406
Rogers Communications Inc. 3,75 % 15-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	745 000	734	669
Rogers Communications Inc. 2,90 % 09-12-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000	194	163
Rogers Communications Inc. 5,25 % 15-04-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	130 000	128	111
Rogers Communications Inc., taux variable 15-03-2082 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	148 000 USD	184	178
Banque Royale du Canada 4,61 % 26-07-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	43 000	43	41
Banque Royale du Canada, taux variable 03-11-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	133 000	118	118
Sagen MI Canada Inc. 3,26 % 05-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	253 000	245	198
Sagen MI Canada Inc., taux variable 24-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	185 000	181	154
Saputo inc. 2,88 % 19-11-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	160 000	159	155
Secure Energy Services Inc. 7,25 % 30-12-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	60 000	60	59
Sienna Senior Living Inc. 3,11 % 04-11-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000	119	115
Sienna Senior Living Inc. 3,45 % 27-02-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	150 000	149	139
Silgan Holdings Inc. 4,13 % 01-02-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	30 000 USD	39	37
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 5,95 % 04-02-2027	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	62	11
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 4,75 % 05-08-2029	Chine	Sociétés – Non convertibles	1 098 000 USD	543	58
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 4,75 % 14-01-2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	250 000 USD	81	18
Sorenson Communications LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 12-03-2026	États-Unis	Prêts à terme	70 833 USD	87	92
Source Energy Services Canada LP 10,50 % 15-03-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	408 744	273	353
South Coast British Columbia Transportation Authority 1,60 % 03-07-2030	Canada	Administrations municipales	350 000	336	287
Spa US HoldCo Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 12-03-2028	États-Unis	Prêts à terme	136 244 USD	169	181
Specialty Pharma III Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 24-02-2028	États-Unis	Prêts à terme	127 400 USD	158	169
Stitch Acquisition Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 27-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	123 480 USD	144	131
Financière Sun Life inc., taux variable 21-11-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	502 000	489	430
Financière Sun Life inc., taux variable 10-08-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	175 000	175	164
Financière Sun Life inc., taux variable 04-07-2035	Canada	Sociétés – Non convertibles	103 000	103	100
Financière Sun Life inc., taux variable 01-10-2035	Canada	Sociétés – Non convertibles	370 000	351	285
Sunac China Holdings Ltd. 6,50 % 10-01-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	602 000 USD	170	107
Suncor Énergie Inc. 3,95 % 04-03-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	205 000	191	149
Supérieur Plus S.E.C. 4,50 % 15-03-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	60 000 USD	76	71
Suzano Austria GmbH 2,50 % 15-09-2028	Brésil	Sociétés – Non convertibles	435 000 USD	500	494
Suzano SA 3,75 % 15-01-2031	Brésil	Sociétés – Non convertibles	210 000 USD	274	237
TELUS Corp. 3,30 % 02-05-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	178 000	171	158

# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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 \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
TELUS Corp. 3,15 % 19-02-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	400 000	390	344
TELUS Corp. 2,05 % 07-10-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	102 000	97	80
TELUS Corp. 2,85 % 13-11-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000	209	201
TELUS Corp. 4,95 % 28-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	125 000	125	115
Tenet Healthcare Corp. 4,38 % 15-01-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	40 000 USD	49	47
Teranet Holdings LP 3,72 % 23-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	607 000	599	536
TerraForm Power Operating LLC 5,00 % 31-01-2028, rachetables 2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	160 000 USD	205	197
TerraForm Power Operating LLC 4,75 % 15-01-2030, rachetables 2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	25 000 USD	33	29
Thomson Reuters Corp. 2,24 % 14-05-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	380 000	375	360
Timber Servicios Empresariales SA, prêt à terme B de premier rang, taux variable 29-03-2029	Espagne	Prêts à terme	80 000 EUR	114	108
T-Mobile USA Inc. 3,50 % 15-04-2025, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	180 000 USD	248	236
T-Mobile USA Inc. 2,55 % 15-02-2031, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	150 000 USD	193	162
T-Mobile USA Inc. 5,20 % 15-01-2033	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	254 000 USD	328	326
Groupe TMX Ltée 2,30 % 11-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	380 000	378	369
Groupe TMX Ltée 3,78 % 05-06-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	310 000	310	289
Groupe TMX Ltée 2,02 % 12-02-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	160 000	153	126
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 25-07-2029, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	33 000	32	32
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-10-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	417 000	417	404
Total Capital International SA 2,83 % 10-01-2030, rachetables 2029	France	Sociétés – Non convertibles	462 000 USD	546	545
Tourmaline Oil Corp. 2,53 % 12-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	140 000	136	120
Crédit Toyota Canada Inc. 4,45 % 26-01-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	468 000	464	456
Toyota Motor Corp. 1,34 % 25-03-2026	Japon	Sociétés – Non convertibles	167 000 USD	206	206
TransCanada PipeLines Ltd. 3,80 % 05-04-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	333 000	355	312
TransCanada PipeLines Ltd. 5,28 % 15-07-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	416 000	416	401
TransCanada PipeLines Ltd. 4,20 % 04-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	653 000	627	497
TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	931 000	899	815
Trulieve Cannabis Corp. 9,75 % 18-06-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	55 000 USD	72	73
Trulieve Cannabis Corp. 8,00 % 06-10-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	107 000 USD	135	119
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,25 % 15-07-2029	États-Unis	Gouvernements étrangers	550 000 USD	890	796
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2031	États-Unis	Gouvernements étrangers	3 500 000 USD	5 569	4 777
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2032	États-Unis	Gouvernements étrangers	800 000 USD	1 192	1 004
Obligations du Trésor des États-Unis 3,50 % 15-02-2033	États-Unis	Gouvernements étrangers	9 956 300 USD	13 179	12 408
Obligations du Trésor des États-Unis 3,88 % 15-08-2033	États-Unis	Gouvernements étrangers	2 100 000 USD	2 795	2 694
Obligations du Trésor des États-Unis 2,38 % 15-02-2042	États-Unis	Gouvernements étrangers	976 000 USD	1 095	915
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,25 % 15-02-2050	États-Unis	Gouvernements étrangers	2 870 000 USD	4 590	2 734
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2051	États-Unis	Gouvernements étrangers	2 510 000 USD	3 939	2 233
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052	États-Unis	Gouvernements étrangers	12 800 000 USD	15 736	10 503
Obligations du Trésor des États-Unis 3,00 % 15-08-2052	États-Unis	Gouvernements étrangers	218 000 USD	261	215
UPC Broadband Finco BV 4,88 % 15-07-2031 144A	Pays-Bas	Sociétés – Non convertibles	910 000 USD	1 148	1 001
Upfield BV, prêt à terme B de premier rang, taux variable 31-01-2028	Pays-Bas	Prêts à terme	280 000 EUR	417	393
Administration de l'aéroport de Vancouver 1,76 % 20-09-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	92 000	78	74
Ventas Canada Finance Ltd. 5,40 % 21-04-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	280 000	280	271
Ventas Realty LP 4,00 % 01-03-2028, rachetables 2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	50 000 USD	72	62
Verizon Communications Inc., taux variable 20-03-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	101 000 USD	127	138
Verizon Communications Inc. 2,38 % 22-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	561 000	536	487
Vidéotron Itée 3,63 % 15-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	500 000	487	437
Vidéotron Itée 4,50 % 15-01-2030, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	620 000	602	541
VTR Finance NV 6,38 % 15-07-2028, rachetables 2023 144A	Chili	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	272	105
Weatherford International Ltd. 8,63 % 30-04-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 510 000 USD	1 868	2 065
Wells Fargo & Co. 2,57 % 01-05-2026, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	120 000	122	114
Wells Fargo & Co. 2,98 % 19-05-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	108 000	111	100



# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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 \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Welltower Inc. 2,95 % 15-01-2027, rachetables 2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	22 000	20	20
Welltower Inc. 4,25 % 15-04-2028, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	38 000 USD	53	48
Groupe WSP Global Inc. 2,41 % 19-04-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	337 000	328	293
Zoetis Inc. 2,00 % 15-05-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	292 000 USD	321	318
<b>Total des obligations</b>				<b>236 488</b>	<b>205 946</b>
<b>ACTIONS</b>					
BCE Inc., priv., série AA	Canada	Services de communication	7 217	117	109
BCE Inc., priv., série AI	Canada	Services de communication	1 060	16	15
BCE Inc. 4,54 %, à div. cumulatif rachetable, priv. de premier rang, série R, rachetables	Canada	Services de communication	6 308	110	91
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 46	Canada	Biens immobiliers	19 167	481	337
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 48	Canada	Biens immobiliers	7 595	189	140
Brookfield Renewable Partners L.P., priv., série 13	Canada	Services publics	3 104	76	57
Cenovus Energy Inc., priv., série 3	Canada	Énergie	2 120	45	41
Cenovus Energy Inc., priv., série 7	Canada	Énergie	18 200	370	342
Emera Inc., priv., série L	Canada	Services publics	5 425	128	89
Frontera Generation Holdings LLC	États-Unis	Énergie	802	2	2
Intelsat Jackson Holdings SA, A, bons de souscription éch. 05-12-2025	Luxembourg	Services de communication	354	2	4
Intelsat Jackson Holdings SA, B, bons de souscription éch. 05-12-2025	Luxembourg	Services de communication	354	2	2
Intelsat Jackson Holdings SA	Luxembourg	Services de communication	3 388	145	117
Les Compagnies Loblaw Itée 5,30 %, à div. cumulatif rachetable priv. de second rang, série B	Canada	Consommation de base	899	23	18
Source Energy Services Ltd.	Canada	Énergie	21 197	49	119
TransAlta Corp., perpétuelles, priv., série C	Canada	Services publics	1 710	33	29
TransAlta Corp., priv., série A	Canada	Services publics	23 768	323	279
<b>Total des actions</b>				<b>2 111</b>	<b>1 791</b>
<b>OPTIONS</b>					
Options achetées (se reporter au tableau des options achetées)				26	6
<b>Total des options</b>				<b>26</b>	<b>6</b>
<b>FONDS/BILLETS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>					
<sup>1</sup> FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	55 772	5 098	4 267
<sup>1</sup> FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	125 500	2 459	2 093
<sup>1</sup> FINB TIPS américains Mackenzie (couvert en \$ CA)	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	32 000	2 801	2 670
<b>Total des fonds/billets négociés en bourse</b>				<b>10 358</b>	<b>9 030</b>
<b>FONDS COMMUNS DE PLACEMENT</b>					
<sup>2</sup> Fonds de revenu fixe sans contraintes Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	173 646	1 718	1 460
<b>Total des fonds communs de placement</b>				<b>1 718</b>	<b>1 460</b>
<b>FONDS PRIVÉS</b>					
<sup>3</sup> Northleaf Private Credit II LP	Canada	Services financiers	270	2 847	2 972
<sup>4</sup> Sagard Credit Partners II LP	Canada	Services financiers	270	1 262	1 324
<b>Total des fonds privés</b>				<b>4 109</b>	<b>4 296</b>

# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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 \$)
<b>BILLETS À COURT TERME</b>					
Banque Royale du Canada 4,95 % 03-10-2023	Canada	Obligations de sociétés	1 702 000	1 702	1 702
Obligations du Trésor des États-Unis 5,39 % 08-08-2024	États-Unis	Gouvernement fédéral	15 370 000	19 823	19 949
<b>Total des billets à court terme</b>				<b>21 525</b>	<b>21 651</b>
Coûts de transaction				(19)	–
<b>Total des placements</b>				<b>276 316</b>	<b>244 180</b>
Instruments dérivés					
(se reporter au tableau des instruments dérivés)					80
Trésorerie et équivalents de trésorerie					3 307
Autres éléments d'actif moins le passif					5 902
<b>Actif net attribuable aux porteurs de titres</b>					<b>253 469</b>

<sup>1</sup> Ce fonds négocié en bourse est géré par Mackenzie.

<sup>2</sup> Ce fonds est géré par Mackenzie.

<sup>3</sup> Ce fonds est géré par Northleaf Capital Partners (Canada) Ltd., une société affiliée à Mackenzie.

<sup>4</sup> Ce fonds est géré par Sagard Holdings Inc., une société affiliée à Mackenzie.

# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## APERÇU DU PORTEFEUILLE

30 SEPTEMBRE 2023

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	89,1
<i>Obligations</i>	81,3
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)</i>	7,3
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)</i>	0,5
Fonds/billets négociés en bourse	3,6
Placements à court terme	2,3
Autres éléments d'actif (de passif)	2,0
Fonds privés	1,7
Actions	0,7
Fonds communs de placement	0,6
Options sur swaps achetées	–

31 MARS 2023

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	85,3
<i>Obligations</i>	86,4
<i>Options achetées</i>	–
<i>Options vendues</i>	–
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)</i>	(1,1)
Trésorerie et placements à court terme	8,8
Autres éléments d'actif (de passif)	3,8
Fonds privés	1,4
Actions	0,7
Options sur devises achetées	–

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	36,9
Canada	28,9
Mexique	5,7
Nouvelle-Zélande	4,8
Israël	4,0
Brésil	3,7
Autre	3,4
Japon	2,3
Autres éléments d'actif (de passif)	2,0
Allemagne	1,7
Afrique du Sud	1,7
Bahamas	1,3
Colombie	1,0
Australie	0,9
Irlande	0,9
Chili	0,8

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	35,8
Canada	25,1
Trésorerie et placements à court terme	8,8
Mexique	6,0
Autres éléments d'actif (de passif)	3,8
Israël	3,5
Autre	3,3
Allemagne	3,2
Brésil	2,4
Royaume-Uni	1,7
Nouvelle-Zélande	1,3
Chine	1,2
Bahamas	1,1
Australie	1,0
Colombie	0,9
Pays-Bas	0,9

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations d'État étrangères	45,5
Obligations de sociétés	37,5
Fonds/billets négociés en bourse	3,6
Obligations fédérales	2,3
Autres éléments d'actif (de passif)	2,0
Billets à escompte de gouvernements étrangers à court terme	1,7
Fonds privés	1,7
Obligations provinciales	1,6
Prêts à terme	1,5
Services financiers	0,7
Fonds communs de placement	0,6
Billets à escompte de sociétés à court terme	0,6
Obligations supranationales	0,5
Obligations municipales	0,1
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,1

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations d'État étrangères	39,0
Obligations de sociétés	36,9
Trésorerie et placements à court terme	8,8
Obligations fédérales	4,7
Autres éléments d'actif (de passif)	3,8
Obligations provinciales	2,6
Prêts à terme	2,2
Fonds privés	1,4
Obligations supranationales	0,8
Services financiers	0,7
Obligations municipales	0,1
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,1
Autre	(1,1)

Au 31 mars 2023, la répartition effective présente l'exposition du Fonds par portefeuille, région ou secteur calculée en combinant les placements directs et indirects du Fonds.

# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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	7 930 000	Vente	20 décembre 2023	100,00 USD	26	6
<b>Total des options</b>					<b>26</b>	<b>6</b>

# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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	(51)	7 décembre 2023	127,40 EUR	(9 018)	307	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans, décembre 2023	(26)	13 décembre 2023	146,28 JPY	(34 239)	312	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor américain à 10 ans, décembre 2023	129	19 décembre 2023	109,98 USD	18 924	–	(396)
Contrats à terme standardisés à très long terme sur obligations du Trésor américain, décembre 2023	(46)	19 décembre 2023	127,42 USD	(7 411)	546	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du Royaume-Uni, décembre 2023	(36)	27 décembre 2023	94,77 GBP	(5 615)	38	–
<b>Total des contrats à terme standardisés</b>				<b>(37 359)</b>	<b>1 203</b>	<b>(396)</b>

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

### Tableau des contrats de change à terme de gré à gré

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	109 USD	(228) AUD	3 octobre 2023	(148)	(146)	2	–
A	228 AUD	(108) USD	3 octobre 2023	147	146	–	(1)
A	259 CAD	(141) USD	3 octobre 2023	(191)	(192)	–	(1)
A	141 USD	(259) CAD	3 octobre 2023	191	192	1	–
A	290 USD	(347) CHF	3 octobre 2023	(394)	(374)	20	–
A	347 CHF	(279) USD	3 octobre 2023	379	379	–	–
A	122 USD	(153) EUR	3 octobre 2023	(166)	(160)	6	–
A	153 EUR	(119) USD	3 octobre 2023	162	162	–	–
A	1 165 GBP	(1 087) USD	3 octobre 2023	1 476	1 402	–	(74)
A	1 048 USD	(1 165) GBP	3 octobre 2023	(1 422)	(1 422)	–	–
A	1 469 USD	(289 000) JPY	3 octobre 2023	(1 994)	(1 915)	79	–
A	289 000 JPY	(1 427) USD	3 octobre 2023	1 937	1 935	–	(2)
A	620 USD	(8 940) NOK	3 octobre 2023	(841)	(834)	7	–
A	8 940 NOK	(619) USD	3 octobre 2023	840	835	–	(5)
A	1 073 NZD	(471) USD	3 octobre 2023	639	645	6	–
A	475 USD	(1 073) NZD	3 octobre 2023	(645)	(643)	2	–
A	1 610 SEK	(108) USD	3 octobre 2023	147	147	–	–
A	109 USD	(1 610) SEK	3 octobre 2023	(148)	(147)	1	–
AA	1 263 CAD	(16 490) MXN	6 octobre 2023	(1 263)	(1 283)	–	(20)
AA	6 271 CAD	(82 181) MXN	6 octobre 2023	(6 271)	(6 395)	–	(124)
A	590 CAD	(7 718) MXN	6 octobre 2023	(590)	(601)	–	(11)
AA	41 700 MXN	(3 218) CAD	6 octobre 2023	3 218	3 244	26	–
A	815 MXN	(63) CAD	6 octobre 2023	63	63	–	–
AA	25 000 MXN	(1 968) CAD	6 octobre 2023	1 968	1 945	–	(23)
A	5 210 MXN	(408) CAD	6 octobre 2023	408	405	–	(3)
A	1 730 CAD	(1 310) USD	6 octobre 2023	(1 730)	(1 778)	–	(48)
A	42 CAD	(47) AUD	18 octobre 2023	(42)	(42)	–	–
A	70 AUD	(61) CAD	18 octobre 2023	61	61	–	–
A	26 CAD	(30) AUD	18 octobre 2023	(26)	(26)	–	–
A	40 AUD	(35) CAD	18 octobre 2023	35	35	–	–
A	10 042 CAD	(27 689) ILS	18 octobre 2023	(10 042)	(9 866)	176	–
A	112 CAD	(315) ILS	18 octobre 2023	(112)	(112)	–	–
A	172 USD	(1 140) BRL	19 octobre 2023	(234)	(224)	10	–
A	85 USD	(99 000) CLP	19 octobre 2023	(116)	(110)	6	–
A	147 USD	(72 000) HUF	19 octobre 2023	(199)	(193)	6	–



# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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 D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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 D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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 D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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 D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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 D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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 D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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 D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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 : 8 avril 2014

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](http://www.placementsmackenzie.com))

Les titres de série A sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$ selon le mode de souscription avec frais de rachat ou le mode de souscription avec frais modérés.

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

Les titres de série CL sont offerts exclusivement aux fonds communs de placement et aux fonds distincts gérés par La Compagnie d'Assurance du Canada sur la Vie et ses filiales.

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 titres des séries F et F5 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 F5); ils sont également proposés aux employés de Mackenzie et de ses filiales, et aux administrateurs de Mackenzie. Les investisseurs de série F5 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année.

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

Les titres des séries GA, GAR, GD, GDF, GDPW, GDPWX, GF, GF5, GPW, GPWR, GPWT5, GPWX, GSC et GW 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 IG sont offerts exclusivement aux fonds communs de placement gérés par Société de gestion d'investissement, I.G. Ltée.

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

Les titres des séries PW et PWT5 sont offerts à certains investisseurs à valeur nette élevée de nos Solutions Patrimoine privé qui investissent un minimum de 100 000 \$. Les investisseurs de série PWT5 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % 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 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 de série PWX sont offerts à certains investisseurs à valeur nette élevée de nos Solutions Patrimoine privé qui investissent un minimum de 100 000 \$. Les investisseurs doivent négocier leurs honoraires de service du conseiller, lesquels ne peuvent dépasser 1,50 %, avec leur conseiller financier.

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

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

Les titres des séries SC et S5 sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$ (5 000 \$ pour la série S5) selon le mode de souscription avec frais d'acquisition. Les investisseurs de série S5 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année.

Les titres de série B ont été créés exclusivement afin de mettre en œuvre les fusions touchant le Fonds et ne sont pas offerts à la vente.

Les titres des séries PWT8, PWX8 et U ne sont plus offerts à la vente.

Les titres des séries GA, GAR, GD, GDF, GDPW, GDPWX, GF, GF5, GPW, GPWR, GPWT5, GPWX, GSC et GW ont été créés exclusivement afin de mettre en œuvre les fusions touchant le Fonds et ne sont pas offerts à la vente.

# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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)

**Séries distribuées par BLC Services Financiers inc.** (1360, boul. René-Lévesque Ouest, 13<sup>e</sup> étage, Montréal (Québec) H3G 0A9; 1-800-252-1846; [www.banquelaurentienne.ca/mackenzie](http://www.banquelaurentienne.ca/mackenzie))

Les titres de série GLF ont été créés exclusivement afin de mettre en œuvre les fusions touchant le Fonds et ne sont pas offerts à la vente.

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

Les titres des séries LF et LF5 sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$ (5 000 \$ pour la série LF5), qui participent à un programme de services rémunérés à l'acte parrainé par Gestion privée Banque Laurentienne. Les investisseurs de série LF5 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année.

Les titres des séries LW et LW5 sont offerts à certains investisseurs à valeur nette élevée du programme de tarification préférentielle qui investissent un minimum de 100 000 \$. Les investisseurs de série LW5 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année.

Depuis le 1<sup>er</sup> juin 2022, les investisseurs peuvent acheter des titres du Fonds en vertu d'un mode de souscription avec frais d'acquisition et d'un mode de souscription sans frais d'acquisition. Les séries du Fonds ne sont pas toutes offertes selon tous les modes de souscription. 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<sup>er</sup> 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 D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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	23 avril 2014	1,40 %	0,20 %
Série AR	13 novembre 2014	1,40 %	0,23 %
Série B	25 novembre 2016	1,40 %	0,20 %
Série CL	11 janvier 2021	s.o.	s.o.
Série D	23 avril 2014	0,60 % <sup>3)</sup>	0,15 %
Série F	23 avril 2014	0,55 %	0,15 %
Série F5	29 janvier 2015	0,55 %	0,15 %
Série FB	26 octobre 2015	0,60 %	0,20 %
Série GA	20 mai 2022	1,35 %	0,20 %
Série GAR	20 mai 2022	1,35 %	0,23 %
Série GD	20 mai 2022	0,80 %	0,15 %
Série GDF	20 mai 2022	0,50 %	0,15 %
Série GDPW	20 mai 2022	1,00 %	0,15 %
Série GDPWX	20 mai 2022	— <sup>2)</sup>	— <sup>2)</sup>
Série GF	20 mai 2022	0,45 %	0,15 %
Série GF5	20 mai 2022	0,50 %	0,15 %
Série GPW	20 mai 2022	0,95 %	0,15 %
Série GPWR	20 mai 2022	0,95 %	0,15 %
Série GPWT5	20 mai 2022	1,00 %	0,15 %
Série GPWX	20 mai 2022	— <sup>2)</sup>	— <sup>2)</sup>
Série GSC	20 mai 2022	1,05 %	0,20 %
Série GW	20 mai 2022	1,00 %	0,15 %
Série IG	31 janvier 2019	s.o.	s.o.
Série O	23 mai 2014	— <sup>1)</sup>	s.o.
Série PW	30 avril 2014	1,05 %	0,15 %
Série PWFB	3 avril 2017	0,55 %	0,15 %
Série PWR	1 <sup>er</sup> avril 2019	1,05 %	0,15 %
Série PWT5	3 avril 2017	1,05 %	0,15 %
Série PWT8	21 août 2015	1,05 %	0,15 %
Série PWX	23 juillet 2014	— <sup>2)</sup>	— <sup>2)</sup>
Série PWX8	28 juillet 2014	— <sup>2)</sup>	— <sup>2)</sup>
Série R	23 avril 2014	s.o.	s.o.
Série S	2 octobre 2017	— <sup>1)</sup>	0,02 %
Série SC	23 avril 2014	1,10 %	0,20 %
Série S5	24 juin 2014	1,10 %	0,20 %
Série U	25 novembre 2016	1,15 %	0,20 %
Série GLF	20 mai 2022	0,50 %	0,15 %
Série LB	1 <sup>er</sup> décembre 2017	1,10 %	0,20 %
Série LF	7 décembre 2018	0,55 %	0,15 %
Série LF5	7 décembre 2018	0,55 %	0,15 %
Série LW	1 <sup>er</sup> décembre 2017	1,05 %	0,15 %
Série LW5	1 <sup>er</sup> décembre 2017	1,05 %	0,15 %
Série LX	1 <sup>er</sup> décembre 2017	1,10 %	0,20 %

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 0,85 %.



# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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 \$	
25 865	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	

#### c) Prêt de titres

	30 septembre 2023	31 mars 2023
	(\$)	(\$)
Valeur des titres prêtés	12 413	6 730
Valeur des biens reçus en garantie	13 035	7 074

	30 septembre 2023		30 septembre 2022	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
Revenus de prêts de titres bruts	10	100,0	20	100,0
Impôt retenu à la source	-	-	(3)	(15,0)
	10	100,0	17	85,0
Paiements à l'agent de prêt de titres	(2)	(20,0)	(3)	(15,0)
Revenu tiré du prêt de titres	8	80,0	14	70,0

#### d) Commissions

	(\$)
30 septembre 2023	-
30 septembre 2022	-

#### e) Risques découlant des instruments financiers

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

Le Fonds vise un revenu et une croissance du capital à long terme en investissant principalement dans des titres à revenu fixe émis par des sociétés ou des gouvernements de toute envergure, partout dans le monde. Le Fonds répartit ses actifs en fonction de la qualité du crédit, des structures, des secteurs, des devises et des pays.

# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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 %	
					(\$)	%	(\$)	%
BRL	7 301	496	(224)	7 573				
MXN	7 645	311	(2 622)	5 334				
ZAR	4 191	236	(232)	4 195				
JPY	5 334	(181)	(1 016)	4 137				
GBP	–	59	1 776	1 835				
NZD	12 280	127	(11 067)	1 340				
IDR	1 327	–	–	1 327				
NOK	127	57	803	987				
AUD	2 825	47	(2 151)	721				
PEN	–	–	600	600				
THB	–	–	299	299				
ILS	10 150	–	(9 978)	172				
EUR	4 992	(218)	(4 698)	76				
CLP	–	–	(110)	(110)				
HUF	–	–	(193)	(193)				
PLN	–	6	(268)	(262)				
SEK	–	–	(1 233)	(1 233)				
CHF	–	–	(2 731)	(2 731)				
USD	90 577	21 763	(116 737)	(4 397)				
<b>Total</b>	<b>146 749</b>	<b>22 703</b>	<b>(149 782)</b>	<b>19 670</b>				
% de l'actif net	57,9	9,0	(59,1)	7,8				
<b>Total de la sensibilité aux variations des taux de change</b>					<b>(984)</b>	<b>(0,4)</b>	<b>984</b>	<b>0,4</b>

# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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 %	
					(\$)	%	(\$)	%
GBP	–	(1)	9 838	9 837				
BRL	4 458	–	(121)	4 337				
NZD	3 893	–	(2 801)	1 092				
EGP	–	–	1 009	1 009				
AUD	3 442	11	(2 693)	760				
INR	–	–	616	616				
NOK	2 066	19	(1 730)	355				
JPY	1 433	1 357	(2 521)	269				
MXN	11 935	50	(11 738)	247				
ZAR	–	–	214	214				
ILS	10 458	–	(10 408)	50				
EUR	10 028	1 544	(11 556)	16				
HUF	–	–	(137)	(137)				
COP	–	–	(141)	(141)				
KOR	–	–	(241)	(241)				
PEN	–	–	(255)	(255)				
IDR	–	–	(441)	(441)				
SGD	–	–	(718)	(718)				
NTD	–	–	(853)	(853)				
SEK	–	–	(1 320)	(1 320)				
CHF	–	–	(2 842)	(2 842)				
USD	116 294	5 979	(128 243)	(5 970)				
Total	164 007	8 959	(167 082)	5 884				
% de l'actif net	55,4	3,0	(56,5)	1,9				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					(533)	(0,2)	533	0,2

\* Comprend les instruments financiers monétaires et non monétaires.

# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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	19 973	(37 360)				
1 an à 5 ans	42 306	–				
5 ans à 10 ans	90 098	–				
Plus de 10 ans	53 569	–				
Total	205 946	(37 360)				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt			(11 869)	(4,7)	11 869	4,7

	Obligations (\$)	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
			Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
31 mars 2023			(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	15 293	(132 152)				
1 an à 5 ans	50 361	–				
5 ans à 10 ans	92 392	–				
Plus de 10 ans	82 837	–				
Total	240 883	(132 152)				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt			(11 669)	(3,9)	11 717	4,0

##### iv. Autre risque de prix

Au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023, le Fonds n'avait aucune exposition importante à l'autre risque de prix.

##### 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 15,1 % de l'actif net du Fonds (19,6 % 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	11,3	12,8
AA	20,8	27,4
A	9,1	6,8
BBB	18,5	18,5
Inférieure à BBB	13,2	9,6
Sans note	8,4	6,3
Total	81,3	81,4

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

# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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	–	205 946	–	205 946	–	240 883	–	240 883
Actions	1 666	–	125	1 791	1 868	–	119	1 987
Options	–	6	–	6	–	140	–	140
Fonds/billets négociés en bourse	9 030	–	–	9 030	13 879	–	–	13 879
Fonds communs de placement	1 460	–	–	1 460	1 517	–	–	1 517
Fonds privés	–	–	4 296	4 296	–	–	4 256	4 256
Actifs dérivés	1 203	874	–	2 077	–	1 928	–	1 928
Passifs dérivés	(396)	(1 601)	–	(1 997)	(3 299)	(1 898)	–	(5 197)
Placements à court terme	–	21 651	–	21 651	–	20 392	–	20 392
<b>Total</b>	<b>12 962</b>	<b>226 877</b>	<b>4 421</b>	<b>244 260</b>	<b>13 965</b>	<b>261 445</b>	<b>4 375</b>	<b>279 785</b>

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

Au cours de la période, aucun transfert n'a eu lieu entre le niveau 1 et le niveau 2.

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

	30 septembre 2023				31 mars 2023			
	Actions (\$)	Obligations (\$)	Fonds privés (\$)	Total (\$)	Actions (\$)	Obligations (\$)	Fonds privés (\$)	Total (\$)
Solde, à l'ouverture	119	–	4 256	4 375	144	131	1 566	1 841
Achats	–	–	–	–	–	92	2 621	2 713
Ventes	–	–	(9)	(9)	–	(2 721)	–	(2 721)
Transferts entrants	–	–	–	–	4	–	–	4
Transferts sortants	–	–	–	–	–	–	–	–
Profits (pertes) au cours de la période :								
Réalisé(e)s	–	–	–	–	–	(4 985)	–	(4 985)
Latent(e)s	6	–	49	55	(29)	7 483	69	7 523
Solde, à la clôture	125	–	4 296	4 421	119	–	4 256	4 375
Variation des profits (pertes) latent(e)s au cours de la période attribuables aux titres détenus à la clôture de la période	6	–	50	56	(29)	–	68	39

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	29	30
Autres fonds gérés par le gestionnaire	174 468	205 910
Fonds gérés par des sociétés affiliées au gestionnaire	15 450	16 205

# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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	1 847	(600)	–	1 247
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(1 453)	600	552	(301)
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	394	–	552	946

	31 mars 2023			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	1 008	(313)	–	695
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(4 636)	313	8 424	4 101
Obligation pour options vendues	(69)	–	–	(69)
Total	(3 697)	–	8 424	4 727

#### i) Intérêts dans des entités structurées non consolidées

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

30 septembre 2023	% de l'actif net du Fonds sous-jacent	Juste valeur des placements du Fonds (\$)
FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	0,9	4 267
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	1,2	2 093
Fonds de revenu fixe sans contraintes Mackenzie, série R	0,1	1 460
FINB TIPS américains Mackenzie (couvert en \$ CA)	0,7	2 670
Northleaf Private Credit II LP	0,3	2 972
Sagard Credit Partners II LP	0,2	1 324

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	1,0	4 524
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	1,2	2 190
FINB Obligations américaines totales Mackenzie (couvert en \$ CA)	5,0	1 414
Fonds de revenu fixe sans contraintes Mackenzie, série R	0,1	1 517
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	0,6	2 870
FINB TIPS américains Mackenzie (couvert en \$ CA)	0,7	2 881
Northleaf Private Credit II LP	0,4	3 009
Sagard Credit Partners II LP	0,4	1 247

# FONDS D'OBLIGATIONS TACTIQUE 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 <sup>1)</sup>	2 185	2 704	2 152	2 704
Sagard Credit Partners II LP <sup>2)</sup>	920	2 704	920	2 704

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

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

#### k) Fusions de fonds

Après avoir été approuvée par le comité d'examen indépendant des Fonds Mackenzie, la fusion du Mandat privé de revenu fixe mondial Mackenzie (le « premier Fonds dissous ») et du Fonds d'obligations de catégorie investissement tactique mondial Mackenzie (le « second Fonds dissous ») avec le Fonds a eu lieu le 20 mai 2022. Les fusions ont été réalisées en échangeant l'actif net du premier Fonds dissous de 5 175 \$ et l'actif net du second Fonds dissous de 54 997 \$, soit la juste valeur au 20 mai 2022, pour des titres du Fonds à la juste valeur de marché, comme suit :

Séries du premier Fonds dissous	Séries du Fonds	Titres émis
Série PWT8	Série GPWT5	10
Série LF	Série GLF	41
Série LW	Série GW	29
Série PW	Série GDPW	189
Série PWT5	Série GPWT5	6
Série PWX	Série GDPWX	17
Série PWF	Série GDF	211
Série PWF5	Série GF5	5

Séries du second Fonds dissous	Séries du Fonds	Titres émis
Série A	Série GA	7
Série D	Série GD	2
Série F	Série GF	1 923
Série R	Série R	3 911
Série SC	Série GSC	117
Série PWX	Série GPWX	0,3
Série PW	Série GPW	188
Série AR	Série GAR	6
Série PWR	Série GPWR	4

Par suite de la fusion, le premier Fonds dissous et le second Fonds dissous ont été fermés. Les charges engagées dans le cadre de la fusion ont été acquittées par Mackenzie.