

États financiers intermédiaires non audités

Pour la période de six mois close le 30 septembre 2018

Les présents États financiers intermédiaires non audités ne contiennent pas le Rapport intermédiaire de la direction sur le rendement du Fonds (« RDRF ») du FNB. Vous pouvez obtenir un exemplaire du RDRF intermédiaire gratuitement en téléphonant au numéro sans frais 1-800-387-0615, en écrivant à Corporation Financière Mackenzie, 180, rue Queen Ouest, Toronto, Ontario M5V 3K1, en visitant notre site Web à l'adresse www.placementsmackenzie.com ou celui de SEDAR à l'adresse www.sedar.com. Des exemplaires des états financiers annuels ou du RDRF annuel peuvent aussi être obtenus gratuitement des façons décrites ci-dessus.

Les porteurs de parts 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 FNB.

AVIS DE NON-AUDIT DES ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES

Corporation Financière Mackenzie, le gestionnaire du FNB, nomme des auditeurs indépendants pour auditer les états financiers annuels du FNB. Conformément aux lois sur les valeurs mobilières du Canada (Norme canadienne 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 FNB n'ont pas revu les présents États financiers intermédiaires conformément aux normes établies par l'Institut Canadien des Comptables Agréés.



FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FNB ACTIF REVENU FIXE

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

En milliers (sauf les montants par part)
Au

	30 sept. 2018	31 mars 2018 (Audité)
	\$	\$
ACTIF		
Actifs courants		
Placements à la juste valeur	136 674	119 702
Trésorerie et équivalents de trésorerie	20 286	8 593
Intérêts courus à recevoir	944	959
Dividendes à recevoir	9	4
Sommes à recevoir pour placements vendus	725	1 717
Sommes à recevoir pour parts émises	–	–
Couverture sur contrats à terme standardisés	178	438
Profits latents sur les contrats dérivés	2 108	453
Total de l'actif	160 924	131 866
PASSIF		
Passifs courants		
Sommes à payer pour placements achetés	2 346	4 969
Sommes à payer pour parts rachetées	–	–
Distributions à verser	324	–
Sommes à payer au gestionnaire	86	78
Obligation pour options vendues	3	–
Pertes latentes sur les contrats dérivés	565	1 501
Total du passif	3 324	6 548
Actif net attribuable aux porteurs de parts	157 600	125 318
Actif net attribuable aux porteurs de parts, par série (note 3)		
Série E	157 600	125 318
Actif net attribuable aux porteurs de parts, par part (note 3)		
Série E	19,34	19,74

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

Pour les périodes closes les 30 septembre (note 1)
En milliers (sauf les montants par part)

	2018 \$	2017 \$
Revenus		
Dividendes	69	11
Revenu d'intérêts	2 418	858
Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets		
Profit (perte) net(te) réalisé(e)	(2 375)	211
Profit (perte) net(te) latent(e)	(714)	(923)
Revenu tiré du prêt de titres	3	1
Revenu provenant des rabais sur les frais	9	–
Autres	65	47
Total des revenus (pertes)	(525)	205
Charges (note 6)		
Frais de gestion	473	168
Intérêts débiteurs	–	1
Commissions et autres coûts de transaction liés au portefeuille	23	11
Frais du Comité d'examen indépendant	–	–
Charges avant les montants absorbés par le gestionnaire	496	180
Charges absorbées par le gestionnaire	–	–
Charges nettes	496	180
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts liée aux activités d'exploitation, avant impôt	(1 021)	25
Impôt étranger retenu à la source	7	–
Impôt étranger sur le résultat payé (recouvré)	–	–
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts liée aux activités d'exploitation	(1 028)	25
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts liée aux activités d'exploitation, par série		
Série E	(1 028)	25
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts liée aux activités d'exploitation, par part		
Série E	(0,14)	0,01

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FNB ACTIF REVENU FIXE

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE LA SITUATION FINANCIÈRE

Pour les périodes closes les 30 septembre (note 1)
En milliers

	2018	2017
	Série E	
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS	\$	
À l'ouverture	125 318	36 117
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(1 028)	25
Distributions aux porteurs de parts :		
Revenu de placement	(1 763)	(579)
Gains en capital	–	–
Total des distributions aux porteurs de parts	(1 763)	(579)
Opérations sur les parts :		
Produit de l'émission de parts	44 790	38 214
Réinvestissement des distributions	–	–
Paiements au rachat de parts	(9 717)	(2 995)
Total des opérations sur les parts	35 073	35 219
Augmentation (diminution) totale de l'actif net	32 282	34 665
À la clôture	157 600	70 782
Augmentation (diminution) des parts (note 7) :	Parts	
Parts en circulation, à l'ouverture	6 350	1 800
Émis	2 300	1 900
Réinvestissement des distributions	–	–
Rachetés	(500)	(150)
Parts en circulation, à la clôture	8 150	3 550

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FNB ACTIF REVENU FIXE

TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

Pour les périodes closes les 30 septembre (note 1)
En milliers

	2018	2017
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts liée aux activités d'exploitation	(1 028)	25
Ajustements pour :		
Perte (profit) net(te) réalisé(e) sur les placements	1 504	(211)
Variation de la perte (du profit) net(te) latent(e) sur les placements	714	923
Achat de placements	(61 944)	(61 147)
Produit de la vente et de l'échéance de placements	38 693	34 527
Variation des intérêts courus à recevoir	15	(198)
Variation des dividendes à recevoir	(5)	–
Variation de la couverture sur contrats à terme standardisés	260	(267)
Variation des sommes à payer au gestionnaire	8	18
Trésorerie nette liée aux activités d'exploitation	(21 783)	(26 330)

Flux de trésorerie liés aux activités de financement

Produit de l'émission de parts	44 790	33 235
Paievements au rachat de parts	(9 717)	(2 995)
Distributions versées, déduction faite des réinvestissements	(1 439)	(523)
Trésorerie nette liée aux activités de financement	33 634	29 717

Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie

	11 851	3 387
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à l'ouverture	8 593	2 441
Incidence des fluctuations des taux de change sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie	(158)	(109)
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture	20 286	5 719

Trésorerie	20 286	5 719
Équivalents de trésorerie	–	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture	20 286	5 719

Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :

Dividendes reçus	64	11
Impôts étrangers payés	7	–
Intérêts reçus	2 433	660
Intérêts versés	–	1

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FNB ACTIF REVENU FIXE

TABLEAU DES PLACEMENTS

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
OBLIGATIONS					
407 International Inc. 3,72 % 11-05-2048, rachetables 2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	320 000	320	319
AbbVie Inc. 3,75 % 14-11-2023, rachetables 2023	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	60 000 USD	78	77
Adtalem Global Education Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 09-04-2025	États-Unis	Prêts à terme	89 775 USD	114	117
Aegis Sciences Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 09-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	30 000 USD	38	38
Al Ladder Luxembourg, prêt à terme B de premier rang, taux variable 04-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	110 000 USD	137	143
AIMCo Realty Investors LP 3,04 % 01-06-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	90 000	90	87
AL Midcoast Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 28-06-2025	États-Unis	Prêts à terme	80 000 USD	105	104
Alcami Carolinas Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 06-07-2025	États-Unis	Prêts à terme	70 000 USD	91	92
Alera Group Intermediate Holdings Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 27-07-2025	États-Unis	Prêts à terme	30 000 USD	39	39
Algonquin Power & Utilities Corp. 4,65 % 15-02-2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	550 000	580	571
Alibaba Group Holding Ltd. 3,40 % 06-12-2027, rachetables 2027	Chine	Sociétés – Non convertibles	700 000 USD	901	844
Allied Properties Real Estate Investment Trust 3,93 % 14-11-2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000	104	101
AltaGas Ltd. 3,98 % 04-10-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	80 000	80	79
AltaLink, L.P. 3,72 % 03-12-2046, rachetables, série MTN	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 000 000	1 029	999
Altice France SA, prêt à terme B13 de premier rang, taux variable 31-01-2026	France	Prêts à terme	110 000 USD	141	141
Amneal Pharmaceuticals LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 23-03-2025	États-Unis	Prêts à terme	109 975 USD	141	144
Anheuser-Busch InBev Finance Inc. 2,65 % 01-02-2021, rachetables 2021	Belgique	Sociétés – Non convertibles	1 725 000 USD	2 230	2 197
Anheuser-Busch InBev Finance Inc. 3,30 % 01-02-2023, rachetables 2022	Belgique	Sociétés – Non convertibles	245 000 USD	333	313
Anheuser-Busch InBev Finance Inc. 2,60 % 15-05-2024, rachetables 2024	Belgique	Sociétés – Non convertibles	160 000	159	153
Apple Inc. 3,00 % 20-06-2027, rachetables 2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	400 000 USD	504	492
APT Pipelines Ltd. 4,20 % 23-03-2025, rachetables 2024	Australie	Sociétés – Non convertibles	500 000 USD	674	640
Arch Merger Sub Inc. 8,50 % 15-09-2025, rachetables 2020	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	80 000 USD	102	98
Aroundtown SA 4,63 % 18-09-2025, rachetables 2025	Allemagne	Sociétés – Non convertibles	230 000	229	229
Banque asiatique de développement 6,00 % 24-02-2021	Supranationales	s.o.	12 000 000 INR	237	205
Banque asiatique de développement 6,45 % 08-08-2021	Supranationales	s.o.	4 210 000 INR	87	73
Banque asiatique de développement 5,90 % 20-12-2022	Supranationales	s.o.	65 020 000 INR	1 254	1 090
ASP AMC Merger Sub Inc. 8,00 % 15-05-2025, rachetables 2020	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	133	99
AT&T Inc. 3,825 % 25-11-2020	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	500 000	517	509
AT&T Inc. 4,00 % 25-11-2025, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	360 000	360	359
ATS Consolidated Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 23-02-2025	États-Unis	Prêts à terme	39 800 USD	50	52
Aviva PLC 4,50 % 10-05-2021	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	140 000	149	144
Avolon Holdings Funding Ltd. 5,13 % 01-10-2023, rachetables 2023 144A	Irlande	Sociétés – Non convertibles	30 000 USD	39	39
Ball Metalpack Finco LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 26-07-2025	États-Unis	Prêts à terme	59 850 USD	78	78
Bank of America Corp., taux variable 07-02-2022, rachetables 2021	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	510 000 EUR	778	771



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FNB ACTIF REVENU FIXE

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
OBLIGATIONS (suite)					
Bank of America Corp. 3,228 % 22-06-2022	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	40 000	41	40
Bank of America Corp. 3,30 % 24-04-2024, rachetables 2023	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	210 000	210	209
Banque de Montréal 2,27 % 11-07-2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	170 000	170	166
Banque de Montréal 2,89 % 20-06-2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	300 000	300	298
Banque de Montréal 2,70 % 11-09-2024, série DPNT	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000	30	29
Banque de Montréal 3,32 % 01-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	210 000	217	211
Banque de Montréal, taux variable 15-12-2032, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	150 000 USD	193	181
La Banque de Nouvelle-Écosse 2,36 % 08-11-2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	260 000	260	253
La Banque de Nouvelle-Écosse 2,98 % 17-04-2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	90 000	90	90
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 12-04-2066, rachetables 2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	170 000 USD	213	206
Bausch Health Cos. Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 28-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	48 750 USD	62	63
Bausch Health Cos. Inc. 5,625 % 01-12-2021, rachetables	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	300 000 USD	366	387
bclMC Realty Corp. 3,00 % 31-03-2027, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000	50	49
Bell Canada 3,60 % 29-09-2027, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	170 000	172	167
Bell Canada 3,80 % 21-08-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	220 000	220	218
Boardriders Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 21-03-2024	États-Unis	Prêts à terme	259 350 USD	335	339
BP Capital Markets PLC 3,47 % 15-05-2025	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	320 000	320	319
Brookfield Infrastructure Finance ULC 4,20 % 11-09-2028, rachetables 2018	Canada	Sociétés – Non convertibles	260 000	260	257
Brookfield Renewable Energy Partners ULC 3,63 % 15-01-2027, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	500 000	495	485
Brookfield Renewable Partners ULC 4,25 % 15-01-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	270 000	270	270
Bruce Power L.P. 2,84 % 23-06-2021	Canada	Sociétés – Non convertibles	360 000	373	357
Bruce Power L.P. 3,00 % 21-06-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	70 000	69	68
Bruce Power L.P. 3,97 % 23-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	190 000	195	192
Bulldog Purchaser Inc., prêt à terme à prélèvement différé de premier rang, taux variable 31-08-2025	États-Unis	Prêts à terme	24 667 USD	32	32
Bulldog Purchaser Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 31-08-2025	États-Unis	Prêts à terme	45 333 USD	58	59
BWAY Holding Co. 7,25 % 15-04-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	40 000 USD	53	50
Calpine Corp. 5,25 % 01-06-2026, rachetables 2021	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1100,000 USD	139	133
Camelot Finance LP, prêt à terme de premier rang, taux variable 03-10-2023	États-Unis	Prêts à terme	235 230 USD	315	304
Canam Construction Inc./Canada, prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-07-2024	Canada	Prêts à terme	118 999 USD	153	155
Canada Goose Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 22-12-2021	Canada	Prêts à terme	70 000 USD	88	90
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, taux variable 15-09-2023	Canada	Gouvernement fédéral	510 000	509	510
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1 2,35 % 15-06-2023	Canada	Gouvernement fédéral	910 000	909	900
Banque Canadienne Impériale de Commerce 2,47 % 05-12-2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000	100	98
Banque Canadienne Impériale de Commerce 2,97 % 11-07-2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	400 000	400	398
Banque Canadienne Impériale de Commerce 3,30 % 26-05-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000	30	30
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 04-04-2028, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	210 000	210	208



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FNB ACTIF REVENU FIXE

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
OBLIGATIONS (suite)					
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada 3,60 % 31-07-2048, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	190 000	187	185
Canadian Natural Resources Ltd. 3,55 % 03-06-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	330 000	332	330
Banque canadienne de l'Ouest 2,751 % 29-06-2020	Canada	Sociétés – Non convertibles	150 000	150	149
Banque canadienne de l'Ouest 2,74 % 16-06-2022, série DPNT	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000	50	49
Banque canadienne de l'Ouest 2,92 % 15-12-2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	160 000	160	157
Capital Power Corp. 4,28 % 18-09-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 230 000	1 241	1 230
CareCentrix Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 22-03-2025	États-Unis	Prêts à terme	138 250 USD	178	178
Careerbuilder LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 31-07-2023	États-Unis	Prêts à terme	51 676 USD	63	67
Casablanca US Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 31-03-2024	États-Unis	Prêts à terme	159 200 USD	205	203
CCL Industries Inc. 3,86 % 13-04-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	150 000	150	149
CCS-CMGC Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 25-09-2025	États-Unis	Prêts à terme	50 000 USD	64	65
Central 1 Credit Union 2,60 % 07-11-2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	110 000	110	107
CEVA Logistics Finance BV, prêt à terme B de premier rang, taux variable 25-07-2025	États-Unis	Prêts à terme	50 000 USD	65	65
Chartwell résidences pour retraités 3,79 % 11-12-2023, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	380 000	379	378
Chartwell résidences pour retraités 4,21 % 28-04-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	80 000	80	80
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 4,18 % 08-03-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	270 000	270	269
CI Financial Corp. 3,52 % 20-07-2023, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	150 000	150	148
Ville d'Oslo 4,60 % 22-06-2020	Norvège	Gouvernements étrangers	1 000 000 NOK	174	167
Ville d'Oslo 2,35 % 04-09-2024	Norvège	Gouvernements étrangers	6 000 000 NOK	960	952
Coca-Cola FEMSA SAB de CV 2,375 % 26-11-2018	Mexique	Sociétés – Non convertibles	150 000 USD	191	193
Coca-Cola FEMSA SAB de CV 3,88 % 26-11-2023	Mexique	Sociétés – Non convertibles	550 000 USD	761	712
Comfort Holding LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 05-02-2024	États-Unis	Prêts à terme	128 050 USD	173	160
Commonwealth of Bahamas 5,75 % 16-01-2024	Bahamas	Gouvernements étrangers	300 000 USD	394	395
Commonwealth of Bahamas 6,95 % 20-11-2029	Bahamas	Gouvernements étrangers	610 000 USD	878	843
Communications Sales & Leasing Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 24-10-2022	États-Unis	Prêts à terme	98 004 USD	128	121
Cooperatieve Rabobank U.A., taux variable 27-11-2019	Pays-Bas	Sociétés – Non convertibles	4 000 000 SEK	607	582
Corel Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 11-05-2024	Canada	Prêts à terme	70 000 USD	90	92
Coronado Australian Holdings Pty. Ltd., prêt à terme B de premier rang, taux variable 21-03-2025	États-Unis	Prêts à terme	55 287 USD	69	72
Coronado Australian Holdings Pty. Ltd., prêt à terme C de premier rang, taux variable 21-03-2025	États-Unis	Prêts à terme	15 116 USD	19	20
Corp Nacional del Cobre de Chile 4,50 % 16-09-2025	Chili	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	267	263
Daseke Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 27-02-2024	États-Unis	Prêts à terme	297 314 USD	380	387
Digicert Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 20-09-2024	États-Unis	Prêts à terme	49 875 USD	61	65
DISH DBS Corp. 5,875 % 15-11-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	120 000 USD	153	139
DNB Boligkreditt AS 2,00 % 28-05-2020	Norvège	Sociétés – Non convertibles	750 000 USD	961	952



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FNB ACTIF REVENU FIXE

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
OBLIGATIONS (suite)					
Fiducie cartes de crédit Eagle 2,63 % 17-10-2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000	50	49
Fiducie cartes de crédit Eagle 3,04 % 17-07-2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000	100	99
EagleTree-Carbide Acquisition Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 28-08-2024	États-Unis	Prêts à terme	247 750 USD	322	321
Eastern Power LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 02-10-2023	États-Unis	Prêts à terme	40 000 USD	52	52
Electrical Components International Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 22-06-2025	États-Unis	Prêts à terme	89 775 USD	118	117
EmployBridge LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 10-04-2025	États-Unis	Prêts à terme	59 250 USD	74	77
Enbridge Inc. 4,77 % 02-09-2019, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	500 000	532	510
Enbridge Inc. 3,20 % 08-06-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	60 000	60	57
Enbridge Inc. 3,70 % 15-07-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	585 000 USD	756	731
Enbridge Inc. 4,57 % 11-03-2044	Canada	Sociétés – Non convertibles	90 000	94	90
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 280 000	1 243	1 220
Enbridge Inc., taux variable 12-04-2078, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	280 000	280	289
ENC Holding Corp., prêt à terme à prélèvement différé de premier rang, taux variable 30-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	1 714 USD	2	2
ENC Holding Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 30-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	28 286 USD	37	37
Enercare Solutions Inc. 3,38 % 21-02-2022, rachetables 2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	60 000	60	60
Enercare Solutions Inc. 3,99 % 21-02-2024, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	230 000	233	231
Ensono LP, prêt à terme de premier rang, taux variable 30-04-2025	États-Unis	Prêts à terme	59 850 USD	76	78
Enterprise Merger Sub Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 28-09-2025	États-Unis	Prêts à terme	250 000 USD	322	322
EPCOR Utilities Inc. 3,55 % 27-11-2047, rachetables 2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000	120	115
EPR Properties 4,95 % 15-04-2028, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	140 000 USD	176	178
Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,25 % 06-12-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	290 000	290	284
République fédérale d'Allemagne 1,25 % 15-08-2048	Allemagne	Gouvernements étrangers	1 000 000 EUR	1 602	1 565
Fédération des caisses Desjardins du Québec 2,39 % 25-08-2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000	200	195
Fédération des caisses Desjardins du Québec 3,06 % 11-09-2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	400 000	400	398
Financial & Risk US Holdings Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-10-2025	États-Unis	Prêts à terme	290 000 USD	376	374
Financial & Risk US Holdings Inc. 6,25 % 15-05-2026, rachetables 2021 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	40 000 USD	52	52
Financial & Risk US Holdings Inc. 8,25 % 15-11-2026, rachetables 2021 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	130	129
Fortified Trust 2,16 % 23-10-2020	Canada	Sociétés – Non convertibles	310 000	310	306
Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC 6,50 % 01-10-2025, rachetables 2021 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	60 000 USD	77	77
Foundation Building Materials LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 11-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	40 000 USD	51	52
Frontera Generation Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 25-04-2025	États-Unis	Prêts à terme	59 850 USD	77	78
Fusion Connect Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 03-05-2023	États-Unis	Prêts à terme	59 250 USD	73	73
General Electric Capital Corp., taux variable 30-07-2019	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	4 000 000 SEK	633	585
General Electric Co., taux variable 08-12-2021	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 000 000 SEK	293	289



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FNB ACTIF REVENU FIXE

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
OBLIGATIONS (suite)					
General Electric Co. 8,35 % 03-09-2022	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 000 000 MXN	74	69
Gentiva Health Services Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 21-06-2025	États-Unis	Prêts à terme	68 416 USD	90	90
Gibson Energy Inc. 5,25 % 15-07-2024, rachetables 2020, REGS	Canada	Sociétés – Non convertibles	110 000	110	110
Glacier Credit Card Trust 3,14 % 20-09-2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	190 000	190	189
The Goldman Sachs Group Inc. 5,20 % 17-12-2019	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	300 000 NZD	299	264
The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 28-10-2027, rachetables 2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	980 000 USD	1 302	1 314
Gouvernement de l'Aruba 6,50 % 31-01-2029	Aruba	Gouvernements étrangers	1 100 000 USD	1 438	1 428
Gouvernement de l'Australie 2,25 % 21-05-2028	Australie	Gouvernements étrangers	2 500 000 AUD	2 318	2 251
Gouvernement des Bermudes 5,60 % 20-07-2020	Bermudes	Gouvernements étrangers	240 000 USD	327	323
Gouvernement des Bermudes 4,138 % 03-01-2023	Bermudes	Gouvernements étrangers	700 000 USD	935	921
Gouvernement des Bermudes 4,854 % 06-02-2024	Bermudes	Gouvernements étrangers	580 000 USD	794	784
Gouvernement des Bermudes 3,72 % 25-01-2027, rachetables 2026	Bermudes	Gouvernements étrangers	1 150 000 USD	1 447	1 420
Gouvernement du Canada 1,50 % 01-06-2023	Canada	Gouvernement fédéral	550 000	535	530
Gouvernement des Îles Caïmans 5,95 % 24-11-2019	Îles Caïmans	Gouvernements étrangers	400 000 USD	526	535
Gouvernement de l'Allemagne 0,50 % 15-02-2028	République dominicaine	Gouvernements étrangers	350 000 USD	486	484
Gouvernement de l'Irlande 1,00 % 15-05-2026	Irlande	Gouvernements étrangers	325 000 EUR	495	499
Gouvernement de la Jamaïque 8,00 % 24-06-2019	Jamaïque	Gouvernements étrangers	204 000 USD	274	272
Gouvernement du Japon 0,10 % 15-02-2019	Japon	Gouvernements étrangers	195 000 000 JPY	2 377	2 219
Gouvernement du Japon 0,10 % 15-08-2019	Japon	Gouvernements étrangers	140 000 000 JPY	1 640	1 595
Gouvernement du Qatar 6,55 % 09-04-2019	Qatar	Gouvernements étrangers	1 100 000 USD	1 463	1 449
Gouvernement de la Russie 7,05 % 19-01-2028	Russie	Gouvernements étrangers	81 500 000 RUB	1 760	1 472
Green Plains Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 29-08-2023	États-Unis	Prêts à terme	49 500 USD	62	65
Greenhill & Co. Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 12-10-2022	États-Unis	Prêts à terme	28 875 USD	36	38
Fonds de placement immobilier H&R 3,42 % 23-01-2023, rachetables 2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	90 000	90	89
Fonds de placement immobilier H&R 3,37 % 30-01-2024, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	90 000	89	88
Halo Buyer Inc., prêt à terme à prélèvement différé de premier rang, taux variable 28-06-2025	États-Unis	Prêts à terme	11 852 USD	15	15
Halo Buyer Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 28-06-2025	États-Unis	Prêts à terme	28 148 USD	37	36
HCA Holdings Inc. 5,25 % 15-06-2026, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	30 000 USD	39	40
Hearthside Group Holdings LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 17-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	59 850 USD	76	77
Heartland Dental LLC, prêt à terme à prélèvement différé de premier rang, taux variable 17-04-2025	États-Unis	Prêts à terme	19 565 USD	25	25
Heartland Dental LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 17-04-2025	États-Unis	Prêts à terme	130 109 USD	164	168
Heathrow Funding Ltd. 3,40 % 08-03-2028	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	1 240 000	1 234	1 215
Heathrow Funding Ltd. 3,79 % 04-09-2030, rachetables 2030	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	240 000	240	237
Hillman Group Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 21-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	50 000 USD	64	64
Hornblower Sub LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 28-04-2025	États-Unis	Prêts à terme	89 550 USD	115	116



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FNB ACTIF REVENU FIXE

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
OBLIGATIONS (suite)					
Banque HSBC Canada 3,25 % 15-09-2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	240 000	240	240
HSBC Bank New Zealand, taux variable 10-12-2018	Hong Kong	Sociétés – Non convertibles	700 000 NZD	635	600
HSBC Holdings PLC 0,45 % 24-09-2021	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	100 000 000 JPY	1 236	1 142
HUB International Ltée, prêt à terme B de premier rang, taux variable 25-04-2025	États-Unis	Prêts à terme	39 900 USD	50	52
HUB International Ltée 7,00 % 01-05-2026, rachetables 2021	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	80 000 USD	101	104
Hudson River Trading LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 20-03-2025	États-Unis	Prêts à terme	79 800 USD	103	104
Hydro One Inc. 2,97 % 26-06-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000	100	98
Hyster-Yale Group Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 30-05-2023	États-Unis	Prêts à terme	187 500 USD	253	243
I-Logic Technologies Bidco Ltd., prêt à terme B de premier rang, taux variable 20-12-2024	États-Unis	Prêts à terme	49 280 USD	63	64
Imagine! Print Solutions Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 21-06-2022	États-Unis	Prêts à terme	248 111 USD	302	302
Impala Private Holdings II LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 10-11-2024	États-Unis	Prêts à terme	404 637 USD	511	525
Interior Logic Group Holdings IV LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 21-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	120 000 USD	154	155
Intermedia Holdings Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 13-07-2025	États-Unis	Prêts à terme	70 000 USD	91	91
Banque internationale pour la reconstruction et le développement 4,625 % 26-02-2019	Supranationales	s.o.	700 000 NZD	646	606
Société Financière Internationale 7,00 % 20-07-2027	Supranationales	s.o.	51 930 000 MXN	3 180	3 284
Société Financière Internationale 8,38 % 31-05-2029	Supranationales	s.o.	22 000 000 MXN	1 593	1 506
International Textile Group Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 19-04-2024	États-Unis	Prêts à terme	109 313 USD	139	142
iQor US Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-04-2021	États-Unis	Prêts à terme	127 142 USD	163	154
Isagenix International LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 26-04-2025	États-Unis	Prêts à terme	98 750 USD	126	128
Ivanhoe Cambridge II Inc. 2,91 % 27-06-2023, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000	120	119
JBS USA Lux SA, prêt à terme B de premier rang, taux variable 30-10-2022	Brésil	Prêts à terme	39 798 USD	51	52
Keane Group Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 18-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	60 000 USD	77	77
KEMET Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 26-04-2024	États-Unis	Prêts à terme	264 844 USD	351	349
Kestrel Acquisition LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 02-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	49 875 USD	64	65
The KeyW Holding Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 04-05-2024	États-Unis	Prêts à terme	57 209 USD	73	74
KFW 3,75 % 29-05-2020	Allemagne	Gouvernements étrangers	800 000 NZD	738	702
Kindred Healthcare Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 21-06-2025	États-Unis	Prêts à terme	60 000 USD	79	78
Kommunalbanken AS, taux variable 26-05-2021	Norvège	Gouvernements étrangers	250 000 NZD	240	216
Kommunalbanken AS 2,13 % 11-02-2025	Norvège	Gouvernements étrangers	600 000 USD	752	727
Kommuninvest I Sverige AB 2,50 % 01-12-2020	Suède	Gouvernements étrangers	4 050 000 SEK	679	620
The Korea Development Bank 5,13 % 13-11-2020	Corée du Sud	Gouvernements étrangers	650 000 NZD	593	576



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FNB ACTIF REVENU FIXE

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
OBLIGATIONS (suite)					
Kraft Heinz Foods Co. 3,00 % 01-06-2026, rachetables 2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	225 000 USD	270	266
Produits Kruger s.e.c. 6,00 % 24-04-2025, rachetables 2021	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000	40	40
L&W Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 17-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	109 725 USD	141	143
Landshypotek Bank AB, taux variable 25-10-2021	Suède	Sociétés – Non convertibles	2 000 000 SEK	312	296
Banque Laurentienne du Canada, taux variable 22-10-2019	Canada	Sociétés – Non convertibles	180 000	180	180
Banque Laurentienne du Canada 3,00 % 12-09-2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000	200	196
Banque Laurentienne du Canada 3,45 % 27-06-2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000	120	119
LBM Borrower LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 20-08-2022	États-Unis	Prêts à terme	256 811 USD	340	334
LifeMiles Ltd., prêt à terme B de premier rang, taux variable 18-08-2022	Colombie	Prêts à terme	54 462 USD	69	72
LifeScan Global Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 19-06-2024	États-Unis	Prêts à terme	220 000 USD	284	282
Banque Manuvie du Canada 2,84 % 12-01-2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	240 000	238	237
Société Financière Manuvie, taux variable 09-05-2028, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000	120	119
Société Financière Manuvie, taux variable 20-08-2029, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	690 000	680	670
Mastronardi Produce Ltd., prêt à terme B de premier rang, taux variable 18-04-2025	Canada	Prêts à terme	39 900 USD	50	52
Mattamy Group Corp. 6,50 % 01-10-2025, rachetables 2020	Canada	Sociétés – Non convertibles	25 000	25	25
Matterhorn Merger Sub LLC 8,50 % 01-06-2026, rachetables 2021	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	140 000 USD	179	177
McAfee LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 30-09-2024	États-Unis	Prêts à terme	277 481 USD	360	362
McDermott Technology Americas Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 05-04-2025	États-Unis	Prêts à terme	109 450 USD	137	143
McDonald's Corp. 3,13 % 04-03-2025, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	260 000	259	255
Meredith Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 18-01-2025	États-Unis	Prêts à terme	115 231 USD	143	150
Metro inc. 3,39 % 06-12-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	130 000	130	125
Mexico City Airport Trust 3,88 % 30-04-2028, rachetables 2028	Mexique	Sociétés – Non convertibles	300 000 USD	371	349
Molson Coors International LP 2,84 % 15-07-2023, rachetables 2023	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	640 000	637	617
Mondelez International Inc. 3,25 % 07-03-2025, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	220 000	219	214
Mondelez International Inc. 4,13 % 07-05-2028, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	70 000 USD	89	90
Morgan Stanley 3,13 % 05-08-2021	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	500 000	508	500
Morgan Stanley 3,00 % 07-02-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	90 000	90	88
Neenah Foundry Co., prêt à terme B de premier rang, taux variable 08-12-2022	États-Unis	Prêts à terme	48 125 USD	61	62
Newell Brands Inc. 4,20 % 01-04-2026, rachetables 2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	80 000 USD	102	98
Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc. 4,11 % 31-03-2042	Canada	Sociétés – Non convertibles	170 000	170	170
Nykredit Realkredit AS, taux variable 01-07-2019	Danemark	Sociétés – Non convertibles	4 000 000 SEK	634	585
OCI Beaumont LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 16-02-2025	États-Unis	Prêts à terme	59 700 USD	75	78
Office Depot Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 08-11-2022	États-Unis	Prêts à terme	64 750 USD	80	86
OMERS Realty Corp. 3,24 % 04-10-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	240 000	240	237
OMERS Realty Corp. 3,63 % 05-06-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	300 000	300	301
Ontario Power Generation Inc. 3,32 % 04-10-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000	120	118



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FNB ACTIF REVENU FIXE

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
OBLIGATIONS (suite)					
OpenLink International Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 21-03-2025	États-Unis	Prêts à terme	39 400 USD	51	51
Osteon Merger Sub Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 06-02-2025	États-Unis	Prêts à terme	39 800 USD	50	52
Owens & Minor Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	140 000 USD	176	171
OZ Management LP, prêt à terme de premier rang, taux variable 04-04-2023	États-Unis	Prêts à terme	80 000 USD	101	104
Parkland Fuel Corp. 5,75 % 16-09-2024, rachetables 2019	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000	50	51
Parkland Fuel Corp. 6,00 % 01-04-2026, rachetables 2021	Canada	Sociétés – Non convertibles	60 000 USD	79	78
The Pasha Group, prêt à terme B de premier rang, taux variable 13-12-2022	États-Unis	Prêts à terme	72 500 USD	91	95
Pembina Pipeline Corp. 3,54 % 03-02-2025, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	150 000	150	149
PepsiCo Inc. 3,00 % 15-10-2027, rachetables 2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 155 000 USD	1 465	1 426
Petróleo de Venezuela SA 6,00 % 16-05-2024	Venezuela	Sociétés – Non convertibles	145 000 USD	46	42
PetSmart Inc., prêt à terme B2 de premier rang, taux variable 10-03-2022	États-Unis	Prêts à terme	10 000 USD	12	11
Pisces Midco Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 29-03-2025	États-Unis	Prêts à terme	100 000 USD	128	130
PLH Group Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 06-08-2023	États-Unis	Prêts à terme	90 000 USD	113	115
PNI Canada Acquireco Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 23-08-2022	Canada	Prêts à terme	49 625 USD	59	64
Polar US Borrower LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 21-08-2025	États-Unis	Prêts à terme	90 000 USD	113	117
Prospect Medical Holdings Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 15-02-2024	États-Unis	Prêts à terme	139 650 USD	172	183
Province de l'Alberta 3,10 % 01-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	370 000	369	366
Province de Terre-Neuve 3,00 % 02-06-2026	Canada	Gouvernements provinciaux	70 000	70	70
Province de Terre-Neuve 3,70 % 17-10-2048	Canada	Gouvernements provinciaux	30 000	33	32
Province de l'Ontario 2,60 % 08-09-2023	Canada	Gouvernements provinciaux	720 000	720	715
PS HoldCo LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 02-03-2025	États-Unis	Prêts à terme	30 000 USD	38	39
PSC Industrial Outsourcing LP, prêt à terme B de premier rang, taux variable 05-10-2024	États-Unis	Prêts à terme	59 550 USD	74	78
Queensland Treasury Corp. 2,75 % 20-08-2027	Australie	Gouvernements étrangers	2 725 000 AUD	2 613	2 478
R1 RCM Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 02-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	50 000 USD	62	65
Rackspace Hosting Inc. 8,63 % 15-11-2024, rachetables 2019	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	60 000 USD	80	76
Realkredit Danmark AS 1,00 % 01-04-2022	Danemark	Sociétés – Non convertibles	8 050 000 DKK	1 620	1 674
Red Ventures LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 08-11-2024	États-Unis	Prêts à terme	65 400 USD	81	86
Reliance Intermediate Holdings LP 6,50 % 01-04-2023, rachetables 2018	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000 USD	54	54
Reliance LP 3,84 % 15-03-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	140 000	140	138
République de l'Argentine 5,88 % 11-01-2028	Argentine	Gouvernements étrangers	650 000 USD	766	667
République de l'Argentine 6,88 % 11-01-2048	Argentine	Gouvernements étrangers	120 000 USD	149	120
République de Pologne, taux variable 25-01-2026	Pologne	Gouvernements étrangers	7 625 000 PLN	2 664	2 614



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FNB ACTIF REVENU FIXE

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
OBLIGATIONS (suite)					
République de Serbie 5,88 % 03-12-2018	Serbie	Gouvernements étrangers	400 000 USD	523	519
Research Now Group Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 20-12-2024	États-Unis	Prêts à terme	119 100 USD	146	155
Rite Aid Corp. 7,70 % 15-02-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	455 000 USD	511	458
Banque Royale du Canada 2,50 % 19-01-2021	Canada	Sociétés – Non convertibles	75 000 USD	98	95
Banque Royale du Canada 3,30 % 26-09-2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	680 000	680	681
Santander Consumer Bank AS, taux variable 30-03-2020	Norvège	Sociétés – Non convertibles	2 000 000 SEK	309	292
Saputo inc. 3,61 % 14-08-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	190 000	190	189
Savage Enterprises LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 02-07-2025	États-Unis	Prêts à terme	88 750 USD	114	116
Sigma Bidco BV, prêt à terme B de premier rang, taux variable 07-03-2025	Pays-Bas	Prêts à terme	80 000 EUR	127	120
Sigma US Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 06-03-2025	Pays-Bas	Prêts à terme	80 000 USD	103	104
SIRVA Worldwide Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 31-07-2025	États-Unis	Prêts à terme	85 000 USD	109	110
SIWF Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 25-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	49 875 USD	64	65
Skandiabanken Aktiebolag, taux variable 02-03-2022	Suède	Sociétés – Non convertibles	5 000 000 SEK	783	742
Groupe SNC-Lavalin inc. 3,24 % 02-03-2023, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000	100	99
Solenis International LP, prêt à terme de premier rang, taux variable 18-12-2023	États-Unis	Prêts à terme	69 825 USD	91	91
Source Energy Services Canada LP 10,50 % 15-12-2021, rachetables 2018	Canada	Sociétés – Non convertibles	88 000	90	94
The Southern Co. 2,15 % 01-09-2019, rachetables 2019	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	800 000 USD	1 007	1 025
Spirit AeroSystems Inc. 3,95 % 15-06-2023, rachetables 2023	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	110 000 USD	141	142
SRS Distribution Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 17-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	110 000 USD	141	141
SRS Distribution Inc. 8,25 % 01-07-2026, rachetables 2021	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	120 000 USD	154	152
St. Joseph Energy Center LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 06-04-2025	États-Unis	Prêts à terme	49 249 USD	63	64
Staples Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 15-08-2024	États-Unis	Prêts à terme	69 475 USD	88	90
Starfruit US Holdco LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 09-2025	États-Unis	Prêts à terme	100 000 USD	128	130
Stepstone Group LP, prêt à terme B de premier rang, taux variable 19-03-2025	États-Unis	Prêts à terme	39 900 USD	51	52
Financière Sun Life inc., taux variable 23-11-2027, rachetables 2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000	120	118
Supérieur Plus S.E.C. 5,25 % 27-02-2024, rachetables 2020	Canada	Sociétés – Non convertibles	60 000	61	59
Supérieur Plus S.E.C. 7,00 % 15-07-2026, rachetables 2021 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	70 000 USD	93	92
Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd. 3,625 % 28-04-2026, rachetables 2026	Australie	Sociétés – Non convertibles	215 000 USD	281	266
Sysco Canada Inc. 3,65 % 25-04-2025, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	270 000	270	271
Talen Energy Supply LLC 9,50 % 15-07-2022, rachetables 2020	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	130 000 USD	152	169
Talen Energy Supply LLC 10,50 % 15-01-2026, rachetables 2022	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	30 000 USD	37	35
Telefónica Emisiones SAU 5,597 % 12-03-2020	Espagne	Sociétés – Non convertibles	100 000 GBP	205	178
TELUS Corp. 3,63 % 01-03-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	130 000	129	128
Tenet Healthcare Corp. 6,75 % 15-06-2023	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	45 000 USD	55	58



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FNB ACTIF REVENU FIXE

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
OBLIGATIONS (suite)					
TerraForm Power Operating LLC 5,00 % 31-01-2028, rachetables 2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	50 000 USD	64	60
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 3,15 % 01-10-2026, rachetables	Israël	Sociétés – Non convertibles	5 000 USD	5	5
Teva Pharmaceutical Industries Ltd. 2,80 % 21-07-2023	Israël	Sociétés – Non convertibles	40 000 USD	47	46
Thomson Reuters Corp. 4,35 % 30-09-2020	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	500 000	527	519
Titan Acquisition Ltd., prêt à terme de premier rang, taux variable 16-03-2025	Royaume-Uni	Prêts à terme	99 500 USD	130	125
T-Mobile USA Inc. 6,50 % 15-01-2024, rachetables 2019	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	65 000 USD	89	87
Groupe TMX Ltée 2,30 % 11-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	60 000	60	59
Groupe TMX Ltée 3,78 % 05-06-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000	100	100
La Banque Toronto-Dominion 3,01 % 30-05-2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000	200	200
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 14-09-2028, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	340 000	340	339
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 25-07-2029, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000	40	39
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 15-09-2031, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	131	122
Tortoise Borrower LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 20-11-2024	États-Unis	Prêts à terme	199 000 USD	254	260
Tortoise Borrower LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 31-01-2025	États-Unis	Prêts à terme	50 000 USD	65	65
TransCanada PipeLines Ltd. 3,30 % 17-07-2025, rachetables 2025, série MTN	Canada	Sociétés – Non convertibles	600 000	623	596
TransCanada PipeLines Ltd. 3,39 % 15-03-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	270 000	270	265
TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000	120	114
Traverse Midstream Partners LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 21-09-2024	États-Unis	Prêts à terme	20 000 USD	25	26
Treasury Corp. of Victoria 3,00 % 20-10-2028	Australie	Gouvernements étrangers	3 800 000 AUD	3 758	3 536
Trico Products Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 02-02-2024	États-Unis	Prêts à terme	69 125 USD	83	90
TricorBraun Inc. (KRAIND), prêt à terme de premier rang, taux variable 30-11-2023	États-Unis	Prêts à terme	335 795 USD	444	436
TricorBraun Inc. (KRAIND), prêt à terme à prélèvement différé de premier rang, taux variable 28-11-2023	États-Unis	Prêts à terme	33 835 USD	45	44
Uber Technologies Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 21-03-2025	États-Unis	Prêts à terme	129 675 USD	167	169
Uber Technologies Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 13-07-2023	États-Unis	Prêts à terme	29 252 USD	37	38
Ultra Clean Holdings Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 27-08-2025	États-Unis	Prêts à terme	150 000 USD	193	190
Unimin Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 21-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	89 775 USD	116	110
Union Gas Ltd. 3,59 % 22-11-2047, rachetables 2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	80 000	80	77
Obligations du Trésor du Royaume-Uni 4,25 % 07-12-2027	Royaume-Uni	Gouvernements étrangers	1 225 000 GBP	2 732	2 560
Obligations des États-Unis 0,63 % 15-04-2023	États-Unis	Gouvernement fédéral	2 000 000 USD	2 586	2 588



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FNB ACTIF REVENU FIXE

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
OBLIGATIONS (suite)					
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2023	États-Unis	Gouvernements étrangers	2 000 000 USD	2 465	2 730
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,50 % 15-01-2028	États-Unis	Gouvernements étrangers	2 200 000 USD	2 768	2 781
Obligations du Trésor des États-Unis 1,88 % 28-02-2022	États-Unis	Gouvernements étrangers	1 100 000 USD	1 462	1 374
Obligations du Trésor des États-Unis 2,75 % 31-05-2023	États-Unis	Gouvernements étrangers	945 000 USD	1 256	1 211
Obligations du Trésor des États-Unis 2,13 % 29-02-2024	États-Unis	Gouvernements étrangers	1 100 000 USD	1 473	1 361
Obligations du Trésor des États-Unis 1,625 % 15-02-2026	États-Unis	Gouvernements étrangers	910 000 USD	1 164	1 067
Obligations du Trésor des États-Unis 2,25 % 15-02-2027	États-Unis	Gouvernements étrangers	300 000 USD	373	365
Obligations du Trésor des États-Unis 2,75 % 15-02-2028	États-Unis	Gouvernements étrangers	60 000 USD	76	76
Ventas Canada Finance Ltd. 2,55 % 15-03-2023, rachetables 2023	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	610 000	598	589
VeriFone Systems Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 09-08-2025	États-Unis	Prêts à terme	60 000 USD	78	78
Vertex Aerospace Services Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 14-06-2025	États-Unis	Prêts à terme	49 875 USD	65	65
Vistage Worldwide Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 01-02-2025	États-Unis	Prêts à terme	59 700 USD	75	78
Vodafone Group PLC 3,75 % 16-01-2024	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	90 000 USD	115	115
VVC Holding Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 03-07-2025	États-Unis	Prêts à terme	100 000 USD	129	128
Vyair Medical Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 06-04-2025	États-Unis	Prêts à terme	70 000 USD	84	89
Wells Fargo & Co. 2,09 % 25-04-2022	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	500 000	486	482
Wells Fargo & Co. 2,98 % 19-05-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	985 000	948	933
Welltower Inc. 4,25 % 15-04-2028, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	128	127
Werner FinCo LP, prêt à terme de premier rang, taux variable 23-06-2024	États-Unis	Prêts à terme	298 496 USD	381	386
Yak Access LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 26-06-2025	États-Unis	Prêts à terme	140 000 USD	179	175
YRC Worldwide Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 21-07-2022	États-Unis	Prêts à terme	48 477 USD	60	64
Zotec Partners LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 09-02-2024	États-Unis	Prêts à terme	79 000 USD	98	102
Total des obligations				129 216	126 247
ACTIONS					
AltaGas Ltd., priv., série K	Canada	Énergie	6 641	166	162
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 46	Canada	Immobilier	4 150	106	108
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 48	Canada	Immobilier	5 314	133	136
Brookfield Renewable Partners L.P., priv., série 11	Canada	Services publics	9 995	251	249
Source Energy Services Ltd.	Canada	Énergie	540	–	2
TransAlta Corp., priv., série A	Canada	Services publics	7 788	109	122
TransCanada Corp., priv., série 15	Canada	Énergie	13 503	345	352
Total des actions				1 110	1 131



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FNB ACTIF REVENU FIXE

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
OPTIONS					
Options achetées (se reporter au tableau des options achetées)				302	320
Total des options				302	320
FONDS/BILLETS NÉGOCIÉS EN BOURSE					
iShares 0-5 Year High Yield Corporate Bond ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	2 083	130	127
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	3 077	352	344
iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	9 432	1 438	1 400
FNB de revenu à taux variable Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	24 184	520	520
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	58 566	5 785	5 719
PowerShares Senior Loan Portfolio	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	21 289	650	637
VanEck Vectors Fallen Angel High Yield Bond ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	6 088	235	229
Total des fonds/billets négociés en bourse				9 110	8 976
Coûts de transaction				(7)	–
Total des placements				139 731	136 674
Instruments dérivés (se reporter au tableau des instruments dérivés)					1 543
Obligation pour options vendues (se reporter au tableau des options vendues)					(3)
Trésorerie et équivalents de trésorerie					20 286
Autres éléments d'actif moins le passif					(900)
Total de l'actif net					157 600



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FNB ACTIF REVENU FIXE

APERÇU DU PORTEFEUILLE

30 septembre 2018		31 mars 2018	
Répartition effective du portefeuille	% de la VL	Répartition du portefeuille	% de la VL
Obligations	85,4	Obligations	89,9
<i>Obligations</i>	85,4	<i>Obligations</i>	90,0
<i>Positions vendeur sur contrats à terme</i>	0,0	<i>Positions vendeur sur contrats à terme</i>	(0,1)
Trésorerie et placements à court terme	12,9	Trésorerie et placements à court terme	6,9
Autres éléments d'actif (de passif)	0,8	Fonds/billets négociés en bourse	4,6
Actions	0,7	Actions	0,9
Options sur devises achetées	0,2	Autres éléments d'actif (de passif)	(2,3)
Options sur devises vendues	(0,0)		
Répartition régionale effective	% de la VL	Répartition régionale	% de la VL
États-Unis	31,6	États-Unis	26,4
Canada	16,8	Canada	21,4
Trésorerie et placements à court terme	12,9	Autres	16,2
Autres	11,8	Trésorerie et placements à court terme	6,9
Australie	5,9	Royaume-Uni	4,8
Royaume-Uni	3,3	Australie	4,7
Japon	2,5	Bermudes	3,7
Bermudes	2,3	Pologne	3,0
Allemagne	2,2	Norvège	2,7
Norvège	2,1	Japon	2,4
Belgique	1,8	Belgique	2,1
Pologne	1,7	Argentine	2,0
Danemark	1,4	Danemark	1,9
Suède	1,1	Suède	1,4
Aruba	0,9	Turquie	1,4
Mexique	0,9	Brésil	1,3
Autres éléments d'actif (de passif)	0,8	Autres éléments d'actif (de passif)	(2,3)
Répartition sectorielle effective	% de la VL	Répartition sectorielle	% de la VL
Obligations de sociétés	42,4	Obligations de sociétés	42,7
Obligations d'État étrangères	30,1	Obligations d'État étrangères	38,0
Trésorerie et placements à court terme	12,9	Trésorerie et placements à court terme	6,9
Prêts à terme	11,0	Prêts à terme	6,0
Obligations fédérales	1,2	Fonds/billets négociés en bourse	4,6
Autres éléments d'actif (de passif)	0,8	Obligations fédérales	2,4
Obligations provinciales	0,7	Obligations provinciales	0,9
Énergie	0,3	Énergie	0,4
Autres	0,2	Services publics	0,3
Services financiers	0,2	Services financiers	0,2
Services publics	0,2	Autres	(0,1)

La répartition effective présente l'exposition du FNB par portefeuille, région ou secteur calculée en combinant les placements directs et indirects du FNB.



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FNB ACTIF REVENU FIXE

TABLEAU DES OPTIONS ACHETÉES

Au 30 septembre 2018

Élément sous-jacent	Nombre de contrats	Type d'option	Date d'échéance	Prix d'exercice \$	Prime payée \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
Option d'achat sur devises USD/INR	7 450 300	Achat	2 octobre 2018	71 INR	65	203
Option d'achat sur devises AUD/USD	12 290 000	Achat	3 octobre 2018	1 USD	12	–
Option d'achat sur devises AUD/USD	16 387 000	Achat	3 octobre 2018	1 USD	22	1
Option d'achat sur devises USD/CAD	1 450 000	Achat	5 octobre 2018	1 CAD	4	–
Option d'achat sur devises USD/CAD	4 360 000	Achat	5 octobre 2018	1 CAD	12	–
Option d'achat sur devises EUR/NOK	7 430 000	Achat	14 décembre 2018	9 NOK	103	47
Option d'achat sur devises EUR/USD	5 470 000	Achat	21 décembre 2018	1 USD	37	55
Option d'achat sur devises EUR/USD	5 310 000	Achat	1 ^{er} janvier 2019	1 USD	47	14
Total des options					302	320

TABLEAU DES OPTIONS VENDUES

Au 30 septembre 2018

Élément sous-jacent	Nombre de contrats	Type d'option	Date d'échéance	Prix d'exercice \$	Prime reçue \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
Option d'achat vendue sur devises EUR/NOK	(7 430 000)	Option d'achat vendue	14 décembre 2018	9 NOK	(15)	(3)
Total des options					(15)	(3)



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FNB ACTIF REVENU FIXE

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS

Au 30 septembre 2018

Tableau des contrats à terme standardisés

Nombre de contrats	Type de contrat	Date d'échéance	Prix moyen des contrats (\$)	Montant notionnel* \$ (en milliers)	Profits (pertes) latent(e)s \$ (en milliers)
(11)	Contrats à terme sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans, décembre 2018	13 décembre 2018	150,09 JPY	(18 769)	19
Profits latents				(18 769)	19
(10)	Contrats à terme sur euro-obligations à long terme du gouvernement italien (BTP), décembre 2018	6 décembre 2018	123,84 EUR	(1 857)	(18)
(Pertes) latentes				(1 857)	(18)
Total des contrats à terme standardisés				(20 626)	1

* Le montant notionnel représente l'exposition aux instruments sous-jacents au 30 septembre 2018.

Tableau des contrats de change à terme

Note de crédit de la contrepartie	Achetés \$ (en milliers)	Vendus \$ (en milliers)	Date de règlement	Coût du contrat \$ (en milliers)	Juste valeur actuelle \$ (en milliers)	Profits latents \$ (en milliers)	
AA	643	Dollar canadien (488)	Dollar américain	4 octobre 2018	(643)	(630)	13
AA	504	Euro (583)	Dollar américain	4 octobre 2018	753	756	3
AA	392	Livre sterling (503)	Dollar américain	4 octobre 2018	650	660	10
AA	1 748	Dollar canadien (8 390)	Couronne danoise	5 octobre 2018	1 688	1 748	60
AA	9 967	Dollar canadien (7 500)	Dollar américain	5 octobre 2018	(9 967)	(9 687)	280
AA	610	Dollar canadien (470)	Dollar américain	5 octobre 2018	(610)	(607)	3
AA	1 778	Dollar canadien (25 700)	Peso mexicain	5 octobre 2018	(1 778)	(1 773)	5
AA	186 000	Peso chilien (275)	Dollar américain	5 octobre 2018	355	365	10
AA	266 000	Peso chilien (394)	Dollar américain	5 octobre 2018	509	522	13
AA	1 069 000	Peso colombien (354)	Dollar américain	5 octobre 2018	457	466	9
AA	154 100	Forint hongrois (551)	Dollar américain	5 octobre 2018	712	715	3
AA	5 320 000	Rupiah indonésienne (354)	Dollar américain	5 octobre 2018	457	461	4
AA	10 020 000	Rupiah indonésienne (669)	Dollar américain	5 octobre 2018	864	868	4
AA	670	Peso mexicain (35)	Dollar américain	5 octobre 2018	45	46	1
AA	3 330	Peso mexicain (171)	Dollar américain	5 octobre 2018	220	230	10
AA	1 510	Nouveau sol péruvien (455)	Dollar américain	5 octobre 2018	588	590	2
AA	1 040	Zloty polonais (279)	Dollar américain	5 octobre 2018	361	364	3
AA	9 700	Rouble russe (141)	Dollar américain	5 octobre 2018	183	191	8
AA	21 100	Rouble russe (321)	Dollar américain	5 octobre 2018	414	416	2
AA	835	Dollar de Singapour (610)	Dollar américain	5 octobre 2018	788	789	1
AA	24 500	Baht thaïlandais (756)	Dollar américain	5 octobre 2018	976	979	3
AA	190	Livre turque (30)	Dollar américain	5 octobre 2018	39	41	2
AA	980	Livre turque (158)	Dollar américain	5 octobre 2018	204	209	5
AA	330	Dollar taiwanais (11)	Dollar américain	5 octobre 2018	14	14	–
AA	42 300	Dollar taiwanais (1 379)	Dollar américain	5 octobre 2018	1 781	1 790	9
AA	57	Dollar américain (210)	Zloty polonais	5 octobre 2018	(74)	(74)	–
AA	332	Dollar américain (7 360)	Couronne tchèque	5 octobre 2018	(429)	(428)	1
AA	200	Dollar américain (55 500)	Forint hongrois	5 octobre 2018	(258)	(257)	1



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FNB ACTIF REVENU FIXE

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

Au 30 septembre 2018

Tableau des contrats de change à terme (suite)

Note de crédit de la contrepartie	Achetés \$ (en milliers)	Vendus \$ (en milliers)	Date de règlement	Coût du contrat \$ (en milliers)	Juste valeur actuelle \$ (en milliers)	Profits (pertes) latent(e)s \$ (en milliers)	
AA	345	Dollar américain (5 130 000)	Rupiah indonésienne	5 octobre 2018	(445)	(444)	1
AA	358	Dollar américain (98 600)	Forint hongrois	5 octobre 2018	(463)	(457)	6
AA	2 330	Rand sud-africain (158)	Dollar américain	5 octobre 2018	205	213	8
AA	3 180	Rand sud-africain (220)	Dollar américain	5 octobre 2018	284	290	6
AA	2 059	Dollar canadien (13 755)	Couronne suédoise	17 octobre 2018	2 001	2 059	58
AA	2 680	Dollar canadien (7 490)	Zloty polonais	17 octobre 2018	2 624	2 680	56
AA	717	Dollar canadien (540)	Dollar américain	19 octobre 2018	(717)	(697)	20
AA	4 116	Dollar canadien (3 100)	Dollar américain	19 octobre 2018	(4 116)	(4 003)	113
AA	10 880	Dollar canadien (8 230)	Dollar américain	26 octobre 2018	(10 880)	(10 624)	256
AA	2 576	Dollar canadien (1 970)	Dollar américain	2 novembre 2018	(2 576)	(2 543)	33
AA	122	Dollar canadien (79)	Euro	2 novembre 2018	119	122	3
AA	124	Dollar canadien (80)	Euro	2 novembre 2018	120	124	4
AA	3 220	Dollar canadien (171 700)	Roupie indienne	2 novembre 2018	3 044	3 220	176
AA	3 506	Dollar canadien (3 690)	Dollar australien	7 novembre 2018	3 443	3 506	63
AA	5 346	Dollar canadien (4 070)	Dollar américain	9 novembre 2018	(5 346)	(5 253)	93
AA	660	Dollar canadien (500)	Dollar américain	9 novembre 2018	(660)	(645)	15
AA	1 424	Dollar canadien (925)	Euro	9 novembre 2018	1 390	1 424	34
AA	1 043	Dollar canadien (800)	Dollar américain	9 novembre 2018	(1 043)	(1 032)	11
AA	1 069 000	Peso colombien (356)	Dollar américain	9 novembre 2018	459	466	7
AA	10 210 000	Rupiah indonésienne (679)	Dollar américain	9 novembre 2018	877	880	3
AA	3 980	Peso mexicain (208)	Dollar américain	9 novembre 2018	268	273	5
AA	201	Dollar américain (730)	Zloty polonais	9 novembre 2018	(259)	(256)	3
AA	13 684	Dollar canadien (10 430)	Dollar américain	30 novembre 2018	(13 684)	(13 455)	229
AA	1 472	Dollar canadien (1 130)	Dollar américain	30 novembre 2018	(1 472)	(1 458)	14
AA	1 650	Dollar canadien (141 000)	Yen japonais	30 novembre 2018	1 608	1 650	42
AA	1 555	Dollar canadien (1 200)	Dollar américain	30 novembre 2018	(1 555)	(1 548)	7
AA	1 906	Dollar canadien (1 450)	Dollar américain	30 novembre 2018	(1 906)	(1 871)	35
AA	1 442	Dollar canadien (1 657)	Dollar néo-zélandais	5 décembre 2018	1 417	1 442	25
AA	3 521	Dollar canadien (296 400)	Yen japonais	5 décembre 2018	3 382	3 521	139
AA	4 944	Dollar canadien (5 290)	Dollar australien	5 décembre 2018	(4 944)	(4 935)	9
AA	705	Dollar canadien (540)	Dollar américain	7 décembre 2018	(705)	(697)	8
AA	610	Dollar canadien (470)	Dollar américain	7 décembre 2018	(610)	(606)	4
AA	2 833	Dollar canadien (1 650)	Livre sterling	12 décembre 2018	(2 833)	(2 783)	50
AA	2 973	Dollar canadien (2 280)	Dollar américain	14 décembre 2018	(2 973)	(2 940)	33
AA	1 918	Dollar canadien (1 460)	Dollar américain	14 décembre 2018	(1 918)	(1 883)	35
AA	1 720	Dollar canadien (8 390)	Couronne danoise	11 janvier 2019	(1 720)	(1 700)	20
Profits latents							2 089
AA	92	Franc suisse (94)	Dollar américain	4 octobre 2018	122	121	(1)
AA	66 000	Yen japonais (593)	Dollar américain	4 octobre 2018	766	750	(16)
AA	225	Dollar américain (313)	Dollar australien	4 octobre 2018	(290)	(292)	(2)
AA	1 199	Dollar américain (10 080)	Couronne norvégienne	4 octobre 2018	(1 548)	(1 599)	(51)
AA	598	Dollar américain (913)	Dollar néo-zélandais	4 octobre 2018	(772)	(782)	(10)
AA	741	Dollar américain (6 750)	Couronne suédoise	4 octobre 2018	(957)	(981)	(24)



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FNB ACTIF REVENU FIXE

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

Au 30 septembre 2018

Tableau des contrats de change à terme (suite)

Note de crédit de la contrepartie	Achetés \$ (en milliers)	Vendus \$ (en milliers)	Date de règlement	Coût du contrat \$ (en milliers)	Juste valeur actuelle \$ (en milliers)	Profits (pertes) latent(e)s \$ (en milliers)
AA	1 443	Dollar canadien (22 500)	Peso mexicain	5 octobre 2018	1 552	1 444 (108)
AA	7 360	Couronne tchèque (333)	Dollar américain	5 octobre 2018	430	428 (2)
AA	8 390	Couronne danoise (1 709)	Dollar canadien	5 octobre 2018	1 709	1 688 (21)
AA	48 200	Peso mexicain (3 334)	Dollar canadien	5 octobre 2018	3 334	3 325 (9)
AA	730	Zloty polonais (200)	Dollar américain	5 octobre 2018	259	256 (3)
AA	83	Dollar américain (5 600)	Rouble russe	5 octobre 2018	(107)	(110) (3)
AA	39	Dollar américain (260)	Livre turque	5 octobre 2018	(50)	(56) (6)
AA	124	Dollar américain (3 800)	Dollar taiwanais	5 octobre 2018	(160)	(161) (1)
AA	454	Dollar américain (1 510)	Nouveau sol péruvien	5 octobre 2018	(587)	(590) (3)
AA	506	Dollar américain (2 110)	Real brésilien	5 octobre 2018	(653)	(675) (22)
AA	135	Dollar américain (910)	Livre turque	5 octobre 2018	(175)	(194) (19)
AA	1 263	Dollar américain (38 830)	Dollar taiwanais	5 octobre 2018	(1 631)	(1 643) (12)
AA	151	Dollar américain (2 330)	Rand sud-africain	5 octobre 2018	(194)	(213) (19)
AA	607	Dollar américain (835)	Dollar de Singapour	5 octobre 2018	(784)	(789) (5)
AA	368	Dollar américain (25 200)	Rouble russe	5 octobre 2018	(475)	(497) (22)
AA	662	Dollar américain (452 000)	Peso chilien	5 octobre 2018	(855)	(888) (33)
AA	1	Dollar américain (20)	Peso mexicain	5 octobre 2018	(1)	(1) –
AA	423	Dollar américain (1 560)	Zloty polonais	5 octobre 2018	(546)	(547) (1)
AA	751	Dollar américain (24 500)	Baht thaïlandais	5 octobre 2018	(970)	(979) (9)
AA	215	Dollar américain (3 180)	Rand sud-africain	5 octobre 2018	(278)	(290) (12)
AA	356	Dollar américain (1 069 000)	Peso colombien	5 octobre 2018	(460)	(466) (6)
AA	683	Dollar américain (10 210 000)	Rupiah indonésienne	5 octobre 2018	(883)	(885) (2)
AA	209	Dollar américain (3 980)	Peso mexicain	5 octobre 2018	(270)	(275) (5)
AA	159	Euro (243)	Dollar canadien	2 novembre 2018	243	239 (4)
AA	94 500	Roupie indienne (1 713)	Dollar canadien	2 novembre 2018	1 713	1 677 (36)
AA	1 617	Dollar canadien (1 080)	Euro	9 novembre 2018	1 623	1 617 (6)
AA	98 600	Forint hongrois (359)	Dollar américain	9 novembre 2018	464	458 (6)
AA	394	Dollar américain (266 000)	Peso chilien	9 novembre 2018	(509)	(522) (13)
AA	757	Dollar américain (24 500)	Baht thaïlandais	9 novembre 2018	(976)	(979) (3)
AA	154	Dollar américain (980)	Livre turque	9 novembre 2018	(199)	(204) (5)
AA	1 381	Dollar américain (42 300)	Dollar taiwanais	9 novembre 2018	(1 783)	(1 793) (10)
AA	219	Dollar américain (3 180)	Rand sud-africain	9 novembre 2018	(283)	(289) (6)
AA	319	Dollar américain (21 100)	Rouble russe	9 novembre 2018	(412)	(414) (2)
AA	1 123	Dollar canadien (7 080)	Couronne norvégienne	16 novembre 2018	1 125	1 123 (2)
AA	2 242	Dollar canadien (33 000)	Peso mexicain	7 décembre 2018	(2 242)	(2 251) (9)
AA	2 905	Dollar canadien (42 843)	Peso mexicain	14 décembre 2018	2 918	2 905 (13)
AA	25 700	Peso mexicain (1 756)	Dollar canadien	14 décembre 2018	1 756	1 751 (5)
(Pertes) latentes						(547)
Total des contrats de change à terme						1 542
Total des instruments dérivés à la juste valeur						1 543



MACKENZIE
Placements

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 2018 et 2017 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 2018, selon le cas. Pour l'exercice au cours duquel un fonds négocié en bourse (« FNB ») est établi, l'information fournie se rapporte à la période allant de la date de constitution à la date marquant la fin de l'exercice en question. Se reporter à la note 10 pour la date de constitution du FNB.

Le FNB 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 FNB est situé au 180 Queen Street West, Toronto (Ontario) Canada. Le FNB est autorisé à émettre un nombre illimité de parts offertes à la vente aux termes d'un prospectus. Les parts du FNB sont inscrites à la Bourse de Toronto/NEO Bourse Aequitas (« la Bourse »).

Corporation Financière Mackenzie (« Mackenzie ») est le gestionnaire du FNB et appartient à cent pour cent à Société financière IGM Inc., une filiale de la Corporation Financière Power, elle-même filiale de Power Corporation du Canada. Les placements du FNB 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 préparés 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 préparés selon les mêmes méthodes comptables, les mêmes jugements comptables critiques et les mêmes estimations que ceux qui ont été utilisés pour la préparation des états financiers annuels audités les plus récents du FNB, soit ceux de l'exercice clos le 31 mars 2018. La note 3 présente un résumé des principales méthodes comptables du FNB 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 FNB, et sont arrondis au millier de dollars près. Les états financiers ont été préparés sur la base de la continuité d'exploitation au moyen de la méthode du coût historique, sauf dans le cas des actifs et des passifs financiers qui ont été évalués à la juste valeur.

Les présents états financiers ont été approuvés pour publication par le conseil d'administration de Corporation Financière Mackenzie le 13 novembre 2018.

Les normes comptables publiées mais non encore en vigueur pour l'exercice comptable considéré, selon le cas, sont décrites à la note 3.

3. Principales méthodes comptables

a) Instruments financiers

Les instruments financiers comprennent des actifs 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 FNB classe et évalue ses instruments financiers conformément à 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. Tous les instruments financiers sont comptabilisés dans l'état de la situation financière lorsque le FNB 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 FNB 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 exécutée, est annulée ou prend fin. Par conséquent, les opérations d'achat et de vente de placements sont comptabilisées à la date de la transaction.

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 au poste Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets – Profit (perte) net(te) latent(e) de l'état du résultat global.

Les parts rachetables du FNB sont détenues par différents types de porteurs de parts qui ont des droits de rachat différents. Les porteurs de parts peuvent faire racheter leurs parts d'un FNB à un prix de rachat par part équivalant à 95 % du cours de clôture des parts à la Bourse à la date de prise d'effet du rachat, sous réserve d'un prix de rachat maximal correspondant à la valeur liquidative par part applicable. Ces différentes caractéristiques de rachat créent des parts du FNB qui présentent le même rang de subordination, mais qui ne sont pas identiques, faisant en sorte qu'elles respectent le critère de classification à titre de passifs, conformément à IAS 32, *Instruments financiers : Présentation*. L'obligation du FNB à l'égard de l'actif net attribuable aux porteurs de parts est présentée au prix de rachat. Se reporter à la note 7 pour les détails relatifs aux souscriptions et aux rachats de parts du FNB.



NOTES ANNEXES

3. Principales méthodes comptables (suite)

a) Instruments financiers (suite)

IAS 7, *Tableau des flux de trésorerie*, exige la présentation d'information relative aux changements dans les passifs et les actifs, comme les parts du FNB, découlant d'activités de financement. Les changements relatifs aux parts du FNB, 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 parts non réglé en espèces à la fin de la période est présenté à titre de Sommes à recevoir pour parts émises ou de Sommes à payer pour parts rachetées à l'état de la situation financière. Ces sommes à recevoir et à payer sont normalement réglées peu après la fin de l'exercice.

Les profits et les pertes réalisés et latents sur les placements sont calculés en fonction du coût moyen pondéré des placements, mais excluent les commissions et autres coûts de transaction liés au portefeuille, qui sont présentés de manière distincte dans l'état du résultat global au poste Commissions et autres coûts de transaction liés au portefeuille.

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

Le FNB comptabilise ses placements dans des fonds de placement à capital variable non cotés et des fonds négociés en bourse, le cas échéant, à la juste valeur par le biais du résultat net. Mackenzie a conclu qu'aucun des fonds de placement à capital variable non cotés et fonds négociés en bourse dans lesquels le FNB investit ne respecte la définition d'une entité structurée ni la définition d'une entreprise associée.

b) Évaluation de la juste valeur

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

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

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

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 FNB 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 leurs échéances à court terme. Les découverts bancaires sont présentés dans les passifs courants à titre de dette bancaire dans les états de la situation financière.

Le FNB 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 synthétiques) 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 FNB 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 FNB, pourvu que cela soit compatible avec les objectifs de placement du FNB. Les instruments dérivés doivent être utilisés conformément à la législation canadienne sur les organismes de placement collectif, sous réserve des dispenses accordées au FNB 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 représente le profit ou la perte qui serait réalisé(e) si, à la date d'évaluation, les positions détenues étaient liquidées. 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).



NOTES ANNEXES

3. Principales méthodes comptables (suite)

b) Évaluation de la juste valeur (suite)

La valeur des contrats à terme standardisés ou des swaps fluctue quotidiennement; les règlements au comptant effectués tous les jours par le FNB, le cas échéant, représentent les profits ou les pertes latent(e)s, lié(e)s à la valeur de marché. Ces profits ou pertes latent(e)s sont inscrit(e)s et comptabilisé(e)s de cette manière jusqu'à ce que le FNB liquide 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 Couverture sur contrats à terme standardisés. Toute modification de l'exigence en matière de marge est rajustée quotidiennement.

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 obtenue.

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 2018.

c) Comptabilisation des produits

Le revenu d'intérêts provenant des placements productifs d'intérêts est comptabilisé au moyen de la méthode du taux d'intérêt effectif. Les dividendes sont cumulés à compter de la date ex-dividende. 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, ou dans le profit (la perte) réalisé(e) à la vente de placements, selon le cas.

d) Commissions et autres coûts de transaction liés au portefeuille

Les commissions et autres coûts de transaction liés au portefeuille sont des charges engagées en vue d'acquérir, d'émettre ou de céder des actifs ou des passifs financiers. Ils comprennent les honoraires et les commissions versés aux agents, aux conseillers et aux courtiers. 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 des services fournis par des tiers qui ont été payés par les courtiers 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. Mackenzie peut rembourser au FNB certaines commissions et certains autres coûts de transaction liés au portefeuille. Mackenzie peut effectuer ces remboursements à son gré et y mettre fin en tout temps sans préavis. Ces remboursements sont inclus dans les charges absorbées par le gestionnaire à l'état du résultat global.

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

Le FNB 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 du FNB. 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. Les opérations de prêts de titres sont gérées par la Banque Canadienne Impériale de Commerce (l'« agent de prêt de titres »). La valeur des espèces ou des titres détenus en garantie doit équivaloir à au moins 102 % de la juste valeur des titres prêtés, vendus ou achetés. 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 les espèces ou les titres détenus en garantie. Le revenu tiré de ces opérations est présenté à l'état du résultat global au poste Produit tiré du prêt de titres et constaté lorsqu'il est gagné.

La note 10 résume les détails relatifs aux titres prêtés et aux biens reçus en garantie, et présente un rapprochement des revenus de prêt de titres, le cas échéant.

f) Compensation

Les actifs et les passifs financiers sont compensés et le solde net est comptabilisé dans l'état de la situation financière seulement si le FNB a un droit exécutoire de compenser les montants comptabilisés et qu'il a l'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 FNB 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 déduire 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.

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 FNB l'exige ou le permette.



NOTES ANNEXES

3. Principales méthodes comptables (suite)

g) Devises

Le dollar canadien est la monnaie fonctionnelle et la monnaie de présentation du FNB. Les acquisitions et les ventes de placements en devises ainsi que les dividendes, le revenu d'intérêts et les intérêts débiteurs en devises ont été 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 a été convertie en dollars canadiens au taux de change en vigueur chaque jour ouvrable.

h) Actif net attribuable aux porteurs de parts, par part

L'actif net attribuable aux porteurs de parts par part est calculé au moyen de la division de l'actif net attribuable aux porteurs de parts un jour ouvrable donné, par le nombre total de parts en circulation ce jour-là.

i) Valeur liquidative par part

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 parts (tel qu'il est présenté dans les états financiers), le cas échéant, tient principalement aux différences liées à la juste valeur des placements et d'autres actifs et passifs financiers. Se reporter à la note 10 pour la valeur liquidative par part du FNB.

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

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

4. Estimations et jugements comptables critiques

La préparation 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.

Utilisation d'estimations

Juste valeur des titres non cotés sur un marché actif

Le FNB peut détenir des instruments financiers qui ne sont pas cotés sur un marché actif et qui sont évalués au moyen de méthodes 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 prix de 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 de ces instruments financiers détenus par le FNB.

Utilisation de jugements

Classement et évaluation des placements et application de l'option de la juste valeur

Lors du classement et de l'évaluation des instruments financiers détenus par le FNB, Mackenzie doit exercer des jugements importants afin de déterminer le classement le plus approprié selon IFRS 9. Mackenzie a évalué le modèle d'affaires du FNB, 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 IFRS 9 constitue la méthode d'évaluation et de présentation la plus appropriée pour les instruments financiers du FNB.

Monnaie fonctionnelle

Le dollar canadien est la monnaie fonctionnelle et la monnaie de présentation du FNB, étant considéré comme la monnaie qui représente le plus fidèlement les effets économiques des transactions, événements et conditions sous-jacents du FNB, compte tenu de la manière dont les parts sont émises et rachetées et dont le rendement et la performance du FNB sont évalués.



NOTES ANNEXES

4. Estimations et jugements comptables critiques (suite)

Utilisation de jugements (suite)

Entités structurées et entreprises associées

Afin de déterminer si un fonds de placement à capital variable non coté ou un fonds négocié en bourse dans lequel le FNB investit, mais qu'il ne consolide pas, respecte la définition d'une entité structurée ou la définition d'une entreprise associée, Mackenzie doit exercer des jugements importants visant à établir si ces fonds sous-jacents possèdent les caractéristiques typiques d'une entité structurée ou d'une entreprise associée. Mackenzie a évalué les caractéristiques de ces fonds sous-jacents, et elle a conclu que ceux-ci ne respectent pas la définition d'une entité structurée, ni la définition d'une entreprise associée, puisque le FNB n'a conclu ni contrat, ni entente de financement avec eux, et qu'il n'a pas la capacité d'influer sur leurs activités, ni sur le rendement qu'il tire de ses placements dans ces fonds sous-jacents.

5. Impôts sur les bénéficiaires

Le FNB est admissible à titre de fiducie de fonds commun de placement en vertu des dispositions de la Loi de l'impôt sur le revenu (Canada). Par conséquent, il est assujéti à l'impôt pour ce qui est de ses bénéficiaires, y compris le montant net des gains en capital réalisés pour l'année d'imposition, qui ne sont ni payés ni à payer à ses porteurs de parts à la fin de l'année d'imposition. Le FNB entend distribuer la totalité de son bénéfice net et une partie suffisante du montant net des gains en capital réalisés de sorte à n'être assujéti à aucun impôt sur les bénéficiaires autre que les impôts étrangers retenus à la source, le cas échéant.

Les pertes du FNB ne peuvent être attribuées aux investisseurs et sont conservées par le FNB pour des exercices futurs. Les pertes autres qu'en capital peuvent être reportées 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 du FNB.

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. Les frais de gestion sont calculés en tant que pourcentage annuel fixe de la valeur liquidative quotidienne des parts du FNB.

Outre les frais de gestion applicables, les frais d'exploitation payables par le FNB comprennent les intérêts et les coûts d'emprunt, les frais de courtage et les frais d'opérations connexes, les frais et charges liés aux activités du comité d'examen indépendant (le « CEI ») du FNB, les frais liés aux instruments dérivés utilisés par le FNB, les charges engagées pour respecter les exigences réglementaires en matière de production de documents sommaires, des Aperçus du FNB ou de tout autre document de divulgation semblable, les charges associées au respect des exigences gouvernementales ou réglementaires entrées en vigueur après la date du prospectus simplifié le plus récent, y compris, sans s'y limiter, tous nouveaux frais ou toute augmentation de frais, les frais liés aux services externes qui n'étaient pas en général imputés par le secteur canadien des fonds négociés en bourse après la date du prospectus simplifié le plus récent, 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 FNB, les honoraires versés aux conseillers juridiques et autres en lien avec les opérations stratégiques ou d'autres opérations ayant une incidence sur les placements du portefeuille du FNB, et toute taxe applicable, y compris l'impôt sur le revenu, les retenues d'impôt et les autres taxes applicables, dont la TPS et la TVH.

Mackenzie peut renoncer aux frais de gestion et aux frais d'exploitation ou les absorber à son gré et supprimer la renonciation ou l'absorption de ces frais en tout temps, sans préavis. Mackenzie peut exiger des frais de gestion réduits à l'égard de placements dans le FNB par de grands investisseurs, y compris d'autres fonds gérés par Mackenzie ou des sociétés affiliées à Mackenzie. Un montant correspondant à la différence entre les frais habituellement exigés et les frais réduits sera distribué en espèces aux porteurs de parts par le FNB sous forme de distribution des frais de gestion. Se reporter à la note 10 pour les taux des frais de gestion imputés aux parts du FNB.

7. Parts et opérations sur parts

Mackenzie a conclu, pour le compte du FNB, une convention liant le courtier désigné avec un ou plusieurs courtiers désignés aux termes de laquelle le courtier désigné a accepté d'accomplir certaines fonctions à l'égard du FNB, notamment les suivantes : i) souscrire un nombre suffisant de parts pour remplir les exigences d'inscription initiale de la Bourse; ii) souscrire des parts sur une base continue dans le cadre de tout rééquilibrage, le cas échéant, et lorsque des parts sont rachetées au comptant; et iii) afficher un marché bidirectionnel liquide pour la négociation des parts à la Bourse. Aux termes de la convention liant le courtier désigné, Mackenzie peut à l'occasion exiger que le courtier désigné souscrive des parts du FNB au comptant.



NOTES ANNEXES

7. Parts et opérations sur parts (suite)

Le nombre prescrit de parts émises aux fins des ordres de souscription (le « nombre prescrit de parts ») est déterminé par Mackenzie. Un courtier désigné peut, tout jour de bourse, passer un ordre de souscription ou de rachat visant un multiple intégral du nombre prescrit de parts du FNB selon la valeur liquidative par part établie le jour de bourse en question. Jour de bourse désigne toute journée où la Bourse est ouverte pour négociation.

En règle générale, tous les ordres visant à acheter des parts directement auprès d'un FNB doivent être passés par un courtier désigné ou un courtier inscrit. Le FNB se réserve le droit absolu de rejeter tout ordre de souscription passé par un courtier désigné ou un courtier inscrit. Le FNB ne versera aucune rémunération à un courtier désigné ou à un courtier inscrit dans le cadre de l'émission de parts. À l'émission de parts, un montant peut être facturé à un courtier désigné ou à un courtier inscrit pour compenser les frais engagés dans le cadre de l'émission de parts.

Pour chaque nombre prescrit de parts émises, le courtier doit remettre un paiement composé : i) d'un panier de titres et de la somme au comptant égale à la valeur liquidative par part globale du nombre prescrit de parts calculée après la réception de l'ordre de souscription; ii) d'une somme au comptant égale à la valeur liquidative par part globale du nombre prescrit de parts calculée après la réception de l'ordre de souscription ou; iii) d'une combinaison de titres et d'une somme au comptant, fixée par Mackenzie, d'un montant suffisant pour que la valeur des titres et de la somme au comptant reçue soit égale à la valeur liquidative par part globale du nombre prescrit de parts calculée après la réception de l'ordre de souscription.

8. Capital du FNB

Le capital du FNB est composé de l'actif net attribuable aux porteurs de parts. Les parts en circulation du FNB aux 30 septembre 2018 et 2017 ainsi que les parts qui ont été émises, réinvesties et rachetées au cours de ces périodes sont présentées dans l'état de l'évolution de la situation financière. Mackenzie gère le capital du FNB conformément aux objectifs de placement décrits à la note 10.

9. Risques découlant des instruments financiers

i. Exposition au risque et gestion du risque

Les activités de placement du FNB l'exposent à divers risques financiers, tels qu'ils sont définis dans IFRS 7, *Instruments financiers : Informations à fournir* (« IFRS 7 »). L'exposition du FNB aux risques financiers est concentrée dans ses placements, lesquels sont présentés dans le tableau des placements au 30 septembre 2018, regroupés par type d'actif, région géographique et secteur.

Mackenzie cherche à atténuer les éventuelles répercussions néfastes de ces risques sur le rendement du FNB par l'embauche de conseillers en portefeuille professionnels et expérimentés, par la surveillance quotidienne des positions du FNB et des événements du marché ainsi que par la diversification du portefeuille de placements en respectant les contraintes des objectifs de placement du FNB; 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 FNB et à s'assurer de la conformité du FNB avec la stratégie de placement établie du FNB, les directives internes et la réglementation des valeurs mobilières.

ii. Risque de liquidité

Le risque de liquidité est le risque que le FNB éprouve des difficultés à respecter ses obligations financières au fur et à mesure que celles-ci deviennent exigibles. Le FNB est exposé au risque de liquidité en raison des rachats potentiels quotidiens en espèces de parts rachetables. Conformément à la réglementation sur les valeurs mobilières, le FNB doit conserver au moins 90 % de son actif dans des placements liquides (c.-à-d. des placements pouvant être facilement vendus). Le FNB peut également emprunter jusqu'à concurrence de 5 % de la valeur de son actif net pour financer ses rachats et un montant additionnel correspondant à 5 % de la valeur de son actif net pour financer les distributions versées aux investisseurs.

iii. Risque de change

Le risque de change est le risque que la juste valeur des instruments financiers libellés en monnaie autre que le dollar canadien, qui est la monnaie de présentation du FNB, fluctue en raison de variations des taux de change. La note 10 résume l'exposition du FNB au risque de change, si une telle exposition s'applique et est considérable.

iv. Risque de taux d'intérêt

Le risque de taux d'intérêt est le risque que la juste valeur des instruments financiers portant intérêt fluctue en fonction des variations des taux d'intérêt du marché en vigueur. La trésorerie et les équivalents de trésorerie n'exposent pas le FNB à des niveaux élevés de risque de taux d'intérêt. La note 10 résume l'exposition du FNB au risque de taux d'intérêt, si une telle exposition s'applique et est considérable.



NOTES ANNEXES

9. Risques découlant des instruments financiers (suite)

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, des swaps ou des contrats à terme standardisés équivaut à leurs notionnels. Dans le cas d'options d'achat (de vente) et de positions vendeur sur contrats à terme standardisés, la perte pour le FNB continue d'augmenter, sans limites, 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 FNB. Pour atténuer ce risque, le FNB 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. La note 10 résume l'exposition du FNB à l'autre risque de prix, si une telle exposition s'applique et est considérable.

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 FNB. La note 10 résume l'exposition du FNB au risque de crédit, si une telle exposition s'applique et est considérable.

Toutes les opérations sur titres cotés sont effectuées par des courtiers approuvés. 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 FNB 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. FNB sous-jacents

Le FNB peut investir dans des FNB 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 FNB sous-jacents. La note 10 résume l'exposition du FNB à ces risques provenant des FNB sous-jacents, si une telle exposition s'applique et est considérable.



FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FNB ACTIF REVENU FIXE

NOTES ANNEXES

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

a) Constitution du FNB et renseignements sur les séries

Date de constitution 1^{er} avril 2016

Le FNB peut émettre un nombre illimité de parts. Le nombre de parts qui ont été émises et qui sont en circulation est présenté dans les états de l'évolution de la situation financière.

Les parts de série E ont été inscrites à la TSX sous le symbole MGB le 19 avril 2016. Le cours de clôture, ou la valeur médiane du cours acheteur et du cours vendeur en l'absence d'un cours de clôture, au 30 septembre 2018 était de 19,32 \$ (19,75 \$ au 31 mars 2018).

Les frais de gestion pour les parts de série E sont de 0,60 %.

Au 30 septembre 2018, la valeur liquidative par part du FNB était de 19,32 \$ (19,75 \$ au 31 mars 2018), et son actif net par part calculé conformément aux normes IFRS était de 19,34 \$ (19,74 \$ au 31 mars 2018).

b) Placements détenus par Mackenzie et des sociétés affiliées

Au 30 septembre 2018, d'autres fonds gérés par Mackenzie détenaient un placement de 2 \$ (néant au 31 mars 2018) dans le FNB.

c) Reports prospectifs de pertes

À la fin de la dernière année d'imposition, aucune perte en capital ni autre qu'en capital n'était disponible pour un report prospectif aux fins de l'impôt.

d) Prêt de titres

Au 30 septembre 2018 et au 31 mars 2018, la valeur des titres prêtés et des biens reçus en garantie s'établissait comme suit :

	30 septembre 2018	31 mars 2018
	(\$)	(\$)
Valeur des titres prêtés	880	1 433
Valeur des biens reçus en garantie	925	1 509

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.

Le rapprochement du montant brut provenant des opérations de prêts de titres avec les revenus de prêts de titres du FNB pour les périodes closes les 30 septembre 2018 et 2017 est présenté ci-après :

	2018		2017	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
Revenus de prêts de titres bruts	5	100,0	1	100,0
Impôt retenu à la source	(1)	(20,0)	—	—
	4	80,0	1	100,0
Paiements à l'agent de prêt de titres	(1)	(20,0)	—	—
Revenu tiré du prêt de titres	3	60,0	1	100,0



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FNB ACTIF REVENU FIXE

NOTES ANNEXES

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

e) Compensation d'actifs et de passifs financiers

Le tableau ci-après présente 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 2018			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	402	(123)	–	279
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(123)	123	178	178
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	279	–	178	457

	31 mars 2018			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	45	(45)	–	–
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(395)	45	438	88
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	(350)	–	438	88

f) Risques découlant des instruments financiers

i. Exposition au risque et gestion du risque

Le FNB cherche à offrir un flux de revenu régulier, tout en misant sur la préservation du capital, et ce, en investissant principalement dans des titres à revenu fixe de première qualité libellés en monnaies canadienne et étrangères qui sont émis par des sociétés ou des gouvernements.



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FNB ACTIF REVENU FIXE

NOTES ANNEXES

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

f) Risques découlant des instruments financiers (suite)

ii. Risque de change

Le tableau ci-après indique les devises dans lesquelles le FNB avait une exposition importante à la clôture de la période, en dollars canadiens, y compris le montant en capital sous-jacent de tout instrument dérivé. Les autres actifs et passifs financiers (y compris les intérêts courus et les dividendes à recevoir, ainsi que les sommes à recevoir ou à payer pour les placements vendus ou achetés) libellés en devises n'exposent pas le FNB à un risque de change important.

Devise	30 septembre 2018			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)
Dollar australien	8 266	–	25 066	33 332
Dollar américain	59 163	2 252	(40 187)	21 228
Yen japonais	4 956	20	5 190	10 166
Peso mexicain	4 859	–	5 125	9 984
Couronne suédoise	3 991	–	1 078	5 069
Zloty polonais	2 614	–	1 803	4 417
Dollar néo-zélandais	2 964	–	660	3 624
Couronne danoise	1 674	–	1 736	3 410
Couronne norvégienne	1 119	–	(476)	643
Rouble russe	1 472	–	(1 021)	451
Peso argentin	–	60	–	60
Livre sterling	2 738	–	(2 783)	(45)
Couronne tchèque	–	–	(428)	(428)
Peso colombien	–	–	(466)	(466)
Nouveau sol péruvien	–	–	(590)	(590)
Real brésilien	–	–	(675)	(675)
Forint hongrois	–	–	(714)	(714)
Dollar de Singapour	–	–	(789)	(789)
Rand sud-africain	–	–	(792)	(792)
Rupiah indonésienne	–	–	(1 329)	(1 329)
Peso chilien	–	–	(1 410)	(1 410)
Baht thaïlandais	–	–	(1 958)	(1 958)
Roupie indienne	1 368	–	(4 731)	(3 363)
Euro	3 016	58	(11 530)	(8 456)
Total	98 200	2 390	(29 221)	71 369
% de l'actif net	62,3	1,5	(18,5)	45,3



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FNB ACTIF REVENU FIXE

NOTES ANNEXES

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

f) Risques découlant des instruments financiers (suite)

ii. Risque de change (suite)

Devise	31 mars 2018			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)
Roupie indienne	4 109	–	–	4 109
Zloty polonais	3 742	–	–	3 742
Livre turque	1 760	–	–	1 760
Rouble russe	1 360	–	–	1 360
Dollar néo-zélandais	1 917	–	(569)	1 348
Peso argentin	1 148	123	–	1 271
Real brésilien	807	–	–	807
Dollar américain	47 361	150	(47 124)	387
Peso mexicain	5 664	–	(5 562)	102
Dollar australien	4 989	–	(4 983)	6
Livre sterling	2 990	–	(2 986)	4
Couronne norvégienne	1 163	–	(1 164)	(1)
Yen japonais	3 587	–	(3 602)	(15)
Couronne danoise	1 774	–	(1 792)	(18)
Franc suisse	–	–	(1 092)	(1 092)
Couronne suédoise	4 248	152	(6 463)	(2 063)
Euro	1 474	49	(6 463)	(4 940)
Total	88 093	474	(81 800)	6 767
% de l'actif net	70,3	0,4	(65,3)	5,4

* Comprend les instruments financiers monétaires et non monétaires.

Au 30 septembre 2018, si le dollar canadien avait connu une hausse de 5 % relativement à toutes les devises, toute autre variable demeurant constante, l'actif net aurait diminué d'environ 3 193 \$ ou 2,0 % du total de l'actif net (338 \$ ou 0,3 % au 31 mars 2018). De même, si le dollar canadien avait connu une baisse de 5 % relativement à toutes les devises, toute autre variable demeurant constante, l'actif net aurait augmenté d'environ 3 355 \$ ou 2,1 % du total de l'actif net (338 \$ ou 0,3 % au 31 mars 2018). En pratique, les résultats réels de négociation peuvent différer et l'écart pourrait être important.



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FNB ACTIF REVENU FIXE

NOTES ANNEXES

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

f) Risques découlant des instruments financiers (suite)

iii. Risque de taux d'intérêt

Le tableau ci-après résume l'exposition du FNB au risque de taux d'intérêt découlant de ses placements dans des obligations selon la durée jusqu'à l'échéance.

Durée jusqu'à l'échéance	30 septembre 2018 (\$)		31 mars 2018 (\$)	
	Obligations	Instruments dérivés	Obligations	Instruments dérivés
Moins de 1 an	10 158	(20 626)	3 827	(11 667)
1 an à 5 ans	39 116	—	36 973	—
5 ans à 10 ans	63 585	—	60 402	—
Plus de 10 ans	13 388	—	11 603	—
Total	126 247	(20 626)	112 805	(11 667)

Au 30 septembre 2018, si les taux d'intérêt en vigueur avaient connu une hausse ou une baisse de 1 %, la courbe des taux évoluant en parallèle et toute autre variable demeurant constante, l'actif net aurait diminué ou augmenté d'environ 4 572 \$ ou 2,9 % du total de l'actif net (4 572 \$ ou 3,6 % au 31 mars 2018). En pratique, les résultats réels de négociation peuvent différer et l'écart pourrait être important.

iv. Autre risque de prix

Au 30 septembre 2018 et au 31 mars 2018, le FNB n'avait aucune exposition importante au risque de prix.

v. Risque de crédit

Pour ce FNB, 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 2018 était de 8,6 % de l'actif net du FNB (3,2 % au 31 mars 2018).

Au 30 septembre 2018 et au 31 mars 2018, les titres de créance par note de crédit étaient les suivants :

Note des obligations*	30 septembre 2018	31 mars 2018
	% de l'actif net	% de l'actif net
AAA	25,5	29,1
AA	8,4	13,3
A	17,6	21,5
BBB	13,7	12,8
Inférieure à BBB	13,7	12,2
Sans note	1,2	1,1
Total	80,1	90,0

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

FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FNB ACTIF REVENU FIXE

NOTES ANNEXES

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

g) Classement de la juste valeur

Le tableau ci-après résume la juste valeur des instruments financiers du FNB selon la hiérarchie de la juste valeur suivante :

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;

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.

	30 septembre 2018				31 mars 2018			
	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	–	126 247	–	126 247	–	112 805	–	112 805
Actions	1 131	–	–	1 131	1 140	–	–	1 140
Options	–	320	–	320	–	–	–	–
Fonds/billets négociés en bourse	8 976	–	–	8 976	5 757	–	–	5 757
Actifs dérivés	19	2 089	–	2 108	–	453	–	453
Passifs dérivés	(18)	(550)	–	(568)	(223)	(1 278)	–	(1 501)
Total	10 108	128 106	–	138 214	6 674	111 980	–	118 654

La méthode du FNB 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 important n'a eu lieu entre le niveau 1 et le niveau 2.

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.

h) Chiffres correspondants

Certains chiffres correspondants de la période précédente ont été reclassés pour que leur présentation soit conforme à la présentation adoptée pour la période considérée.