

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 fonds de placement. Vous pouvez obtenir un exemplaire du RDRF intermédiaire gratuitement en communiquant avec nous d'une des façons indiquées à la rubrique Constitution du Fonds et renseignements sur les séries ou en visitant le site Web de SEDAR à l'adresse www.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 titres peuvent également communiquer avec nous de ces façons pour demander un exemplaire des politiques et procédures de vote par procuration, du dossier de divulgation des votes par procuration ou de la présentation d'informations trimestrielles sur le portefeuille du fonds de placement.

AVIS DE NON-AUDIT DES ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES

Corporation Financière Mackenzie, le gestionnaire du Fonds, nomme des auditeurs indépendants pour auditer les états financiers annuels du Fonds. 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 Fonds n'ont pas revu les présents États financiers intermédiaires conformément aux normes établies par l'Institut Canadien des Comptables Agréés.



PORTEFEUILLE ÉQUILIBRÉ SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

PORTEFEUILLE DE GESTION DE L'ACTIF

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

En milliers (sauf les montants par titre)
Au

	30 sept. 2018	31 mars 2018 (Audité)
	\$	\$
ACTIF		
Actifs courants		
Placements à la juste valeur	2 062 872	2 014 726
Trésorerie et équivalents de trésorerie	239 721	256 711
Intérêts courus à recevoir	6	4
Dividendes à recevoir	63	8
Sommes à recevoir pour placements vendus	–	–
Sommes à recevoir pour titres émis	622	1 435
Sommes à recevoir du gestionnaire	1	38
Couverture sur contrats à terme standardisés	7 870	16 564
Profits latents sur les contrats dérivés	16 400	24 341
Total de l'actif	2 327 555	2 313 827

PASSIF

Passifs courants		
Sommes à payer pour placements achetés	25	2
Sommes à payer pour titres rachetés	1 600	2 227
Sommes à payer au gestionnaire	–	216
Pertes latentes sur les contrats dérivés	10 876	26 838
Total du passif	12 501	29 283
Actif net attribuable aux porteurs de titres	2 315 054	2 284 544

Actif net attribuable aux porteurs de titres, par série (note 3)

Série A	519 085	614 137
Série AR	92 522	82 709
Série B	9 669	12 436
Série C	14 084	15 981
Série D	407	242
Série F	55 634	26 146
Série F6	2 902	545
Série FB	681	1 159
Série FB5	12	14
Série G	2 571	2 444
Série I	134	136
Série J	1 321	1 668
Série O	13 304	12 903
Série O6	80	78
Série PW	390 739	281 619
Série PWF	–	26 567
Série PWF6	–	1 654
Série PWFB	5 758	1 861
Série PWFB5	1	1
Série PWT6	2 985	2 200
Série PWT8	935	817
Série PWX	22 176	24 966
Série R	491 427	478 739

	30 sept. 2018	31 mars 2018 (Audité)
	\$	\$
Série S	1 178	1 004
Série T6	2 408	3 647
Série T8	784	898
Série LB	321 048	320 802
Série LM	82 107	92 054
Série LW	202 957	195 464
Série LW6	66 732	69 904
Série LX	11 413	11 749

Actif net attribuable aux porteurs de titres, par titre (note 3)

Série A	15,42	15,21
Série AR	12,65	12,48
Série B	11,32	11,17
Série C	11,44	11,29
Série D	10,67	10,48
Série F	15,86	15,54
Série F6	12,85	12,99
Série FB	10,68	10,48
Série FB5	13,85	13,94
Série G	13,77	13,54
Série I	15,02	14,78
Série J	15,16	14,93
Série O	20,53	20,02
Série O6	14,41	14,48
Série PW	11,51	11,35
Série PWF	–	11,54
Série PWF6	–	14,24
Série PWFB	10,24	10,03
Série PWFB5	14,38	14,43
Série PWT6	13,88	14,10
Série PWT8	13,57	13,94
Série PWX	11,90	11,60
Série R	10,76	10,71
Série S	12,09	12,04
Série T6	12,72	12,94
Série T8	10,92	11,23
Série LB	12,06	11,91
Série LM	8,58	8,73
Série LW	9,88	9,74
Série LW6	14,08	14,32
Série LX	12,45	12,67

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.



MACKENZIE
Placements

PORTEFEUILLE ÉQUILIBRÉ SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

PORTEFEUILLE DE GESTION DE L'ACTIF

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

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

	2018	2017
	\$	\$
Revenus		
Dividendes	8 787	5 072
Revenu d'intérêts	26 243	21 558
Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets		
Profit (perte) net(te) réalisé(e)	6 064	15 906
Profit (perte) net(te) latent(e)	16 596	(18 438)
Revenu tiré du prêt de titres	49	2
Revenu provenant des rabais sur les frais	51	—
Total des revenus (pertes)	57 790	24 100
Charges (note 6)		
Frais de gestion	17 777	16 619
Rabais sur les frais de gestion	(70)	(24)
Frais d'administration	1 817	1 771
Intérêts débiteurs	15	7
Commissions et autres coûts de transaction liés au portefeuille	168	157
Frais du Comité d'examen indépendant	4	4
Autres	1	1
Charges avant les montants absorbés par le gestionnaire	19 712	18 535
Charges absorbées par le gestionnaire	—	—
Charges nettes	19 712	18 535
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, avant impôt	38 078	5 565
Impôt étranger retenu à la source	61	85
Impôt étranger sur le résultat payé (recouvré)	—	—
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation	38 017	5 480
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, par série		
Série A	8 652	213
Série AR	1 174	(32)
Série B	165	6
Série C	224	14
Série D	5	1
Série F	707	107
Série F6	24	3
Série FB	28	(2)
Série FB5	—	—
Série G	41	6
Série I	2	1
Série J	24	3
Série O	334	107
Série O6	3	—
Série PW	3 995	15
Série PWF	394	94

	2018	2017
	\$	\$
Série PWF6	27	—
Série PWFB	68	5
Série PWFB5	—	—
Série PWT6	28	(7)
Série PWT8	11	(4)
Série PWX	528	266
Série R	12 107	5 116
Série S	26	6
Série T6	50	2
Série T8	14	—
Série LB	4 266	(558)
Série LM	1 203	128
Série LW	2 784	—
Série LW6	979	—
Série LX	154	(10)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, par titre		
Série A	0,24	0,01
Série AR	0,17	(0,01)
Série B	0,17	—
Série C	0,17	0,01
Série D	0,17	0,05
Série F	0,25	0,08
Série F6	0,16	0,14
Série FB	0,33	(0,03)
Série FB5	0,26	0,08
Série G	0,22	0,04
Série I	0,24	0,04
Série J	0,26	0,03
Série O	0,51	0,24
Série O6	0,36	—
Série PW	0,13	—
Série PWF	0,17	0,06
Série PWF6	0,21	0,06
Série PWFB	0,16	0,12
Série PWFB5	0,31	0,08
Série PWT6	0,16	(0,08)
Série PWT8	0,18	(0,09)
Série PWX	0,28	0,13
Série R	0,27	0,12
Série S	0,30	0,20
Série T6	0,22	0,01
Série T8	0,17	0,01
Série LB	0,16	(0,02)
Série LM	0,12	0,01
Série LW	0,14	—
Série LW6	0,20	—
Série LX	0,17	(0,01)

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.



MACKENZIE
Placements

PORTEFEUILLE ÉQUILIBRÉ SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

PORTEFEUILLE DE GESTION DE L'ACTIF

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE LA SITUATION FINANCIÈRE

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

	2018	2017	2018	2017	2018	2017	2018	2017	2018	2017
	Série A		Série AR		Série B		Série C		Série D	
	\$		\$		\$		\$		\$	
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	614 137	735 399	82 709	61 682	12 436	17 051	15 981	21 974	242	141
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	8 652	213	1 174	(32)	165	6	224	14	5	1
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Gains en capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Rabais sur les frais de gestion	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de titres	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	70 188	75 562	11 187	9 989	127	468	191	428	181	1
Réinvestissement des distributions	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Paiements au rachat de titres	(173 892)	(203 979)	(2 548)	(1 264)	(3 059)	(4 200)	(2 312)	(4 991)	(21)	-
Total des opérations sur les titres	(103 704)	(128 417)	8 639	8 725	(2 932)	(3 732)	(2 121)	(4 563)	160	1
Augmentation (diminution) totale de l'actif net	(95 052)	(128 204)	9 813	8 693	(2 767)	(3 726)	(1 897)	(4 549)	165	2
À la clôture	519 085	607 195	92 522	70 375	9 669	13 325	14 084	17 425	407	143

Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) :	Titres		Titres		Titres		Titres		Titres	
Titres en circulation, à l'ouverture	40 377	48 283	6 627	4 936	1 113	1 523	1 416	1 944	23	14
Émis	4 567	4 937	886	796	11	41	17	38	17	-
Réinvestissement des distributions	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Rachetés	(11 277)	(13 359)	(201)	(101)	(270)	(373)	(202)	(441)	(2)	-
Titres en circulation, à la clôture	33 667	39 861	7 312	5 631	854	1 191	1 231	1 541	38	14

	Série F		Série F6		Série FB		Série FB5		Série G	
	\$		\$		\$		\$		\$	
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	26 146	21 929	545	582	1 159	207	14	13	2 444	2 002
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	707	107	24	3	28	(2)	-	-	41	6
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	-	-	(24)	(2)	-	-	-	-	-	-
Gains en capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	(41)	(9)	-	-	-	-	-	-
Rabais sur les frais de gestion	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de titres	-	-	(65)	(11)	-	-	-	-	-	-
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	36 459	7 334	2 701	305	1 222	366	1	-	108	265
Réinvestissement des distributions	-	-	19	-	-	-	-	-	-	-
Paiements au rachat de titres	(7 678)	(7 552)	(322)	(373)	(1 728)	(263)	(3)	-	(22)	(59)
Total des opérations sur les titres	28 781	(218)	2 398	(68)	(506)	103	(2)	-	86	206
Augmentation (diminution) totale de l'actif net	29 488	(111)	2 357	(76)	(478)	101	(2)	-	127	212
À la clôture	55 634	21 818	2 902	506	681	308	12	13	2 571	2 214

Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) :	Titres		Titres		Titres		Titres		Titres	
Titres en circulation, à l'ouverture	1 682	1 416	42	43	111	20	1	1	180	148
Émis	2 312	470	208	22	115	34	-	-	9	19
Réinvestissement des distributions	-	-	1	-	-	-	-	-	-	-
Rachetés	(486)	(485)	(25)	(27)	(162)	(25)	-	-	(2)	(4)
Titres en circulation, à la clôture	3 508	1 401	226	38	64	29	1	1	187	163

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

PORTEFEUILLE ÉQUILIBRÉ SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

PORTEFEUILLE DE GESTION DE L'ACTIF

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

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

	2018	2017	2018	2017	2018	2017	2018	2017	2018	2017
	Série I		Série J		Série O		Série O6		Série PW	
	\$		\$		\$		\$		\$	
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	136	139	1 668	2 112	12 903	9 206	78	–	281 619	114 065
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	2	1	24	3	334	107	3	–	3 995	15
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	–	–	–	–	–	–	(2)	–	–	–
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	–	–	–	–	(1)	–	–	–
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	–	–	(34)	(22)
Total des distributions aux porteurs de titres	–	–	–	–	–	–	(3)	–	(34)	(22)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	–	–	–	–	1 006	681	–	–	137 574	160 576
Réinvestissement des distributions	–	–	–	–	–	–	2	–	15	22
Paiements au rachat de titres	(4)	(4)	(371)	(114)	(939)	(995)	–	–	(32 430)	(19 417)
Total des opérations sur les titres	(4)	(4)	(371)	(114)	67	(314)	2	–	105 159	141 181
Augmentation (diminution) totale de l'actif net	(2)	(3)	(347)	(111)	401	(207)	2	–	109 120	141 174
À la clôture	134	136	1 321	2 001	13 304	8 999	80	–	390 739	255 239

Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) :	Titres		Titres		Titres		Titres		Titres	
Titres en circulation, à l'ouverture	9	9	112	142	644	464	5	–	24 819	10 044
Émis	–	–	–	–	50	34	–	–	11 941	14 109
Réinvestissement des distributions	–	–	–	–	–	–	1	–	1	2
Rachetés	–	–	(25)	(8)	(46)	(50)	–	–	(2 824)	(1 699)
Titres en circulation, à la clôture	9	9	87	134	648	448	6	–	33 937	22 456

	Série PWF		Série PWF6		Série PWF6		Série PWF6		Série PWF6	
	\$		\$		\$		\$		\$	
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	26 567	13 059	1 654	–	1 861	–	1	–	2 200	–
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	394	94	27	–	68	5	–	–	28	(7)
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	–	–	(4)	(1)	–	–	–	–	(12)	(2)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	(14)	(4)	–	–	–	–	(67)	(37)
Rabais sur les frais de gestion	(3)	(2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	(3)	(2)	(18)	(5)	–	–	–	–	(79)	(39)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	2 825	9 432	187	188	3 974	919	–	1	2 159	1 631
Réinvestissement des distributions	–	2	6	–	–	–	–	–	52	22
Paiements au rachat de titres	(29 783)	(2 024)	(1 856)	–	(145)	(2)	–	–	(1 375)	(153)
Total des opérations sur les titres	(26 958)	7 410	(1 663)	188	3 829	917	–	1	836	1 500
Augmentation (diminution) totale de l'actif net	(26 567)	7 502	(1 654)	183	3 897	922	–	1	785	1 454
À la clôture	–	20 561	–	183	5 758	922	1	1	2 985	1 454

Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) :	Titres		Titres		Titres		Titres		Titres	
Titres en circulation, à l'ouverture	2 303	1 137	116	–	185	–	–	–	156	–
Émis	244	817	14	13	391	92	–	–	153	109
Réinvestissement des distributions	–	–	–	–	–	–	–	–	4	1
Rachetés	(2 547)	(175)	(130)	–	(14)	–	–	–	(98)	(10)
Titres en circulation, à la clôture	–	1 779	–	13	562	92	–	–	215	100

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.



MACKENZIE
Placements

PORTEFEUILLE ÉQUILIBRÉ SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

PORTEFEUILLE DE GESTION DE L'ACTIF

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

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

	2018	2017	2018	2017	2018	2017	2018	2017
	Série PWT8		Série PWX		Série R		Série S	
	\$		\$		\$		\$	
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES								
À l'ouverture	817	–	24 966	23 191	478 739	441 320	1 004	32
Augmentation (diminution) de l'actif net								
liée aux activités d'exploitation	11	(4)	528	266	12 107	5 116	26	6
Distributions aux porteurs de titres :								
Revenu de placement	(4)	(1)	–	–	(9 979)	(4 362)	(22)	(5)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(33)	(22)	–	–	–	–	–	–
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	(37)	(23)	–	–	(9 979)	(4 362)	(22)	(5)
Opérations sur les titres :								
Produit de l'émission de titres	133	640	1 575	1 920	20 559	31 596	205	730
Réinvestissement des distributions	15	15	–	–	–	–	22	5
Paiements au rachat de titres	(4)	–	(4 893)	(1 586)	(9 999)	(10 464)	(57)	(15)
Total des opérations sur les titres	144	655	(3 318)	334	10 560	21 132	170	720
Augmentation (diminution) totale de l'actif net	118	628	(2 790)	600	12 688	21 886	174	721
À la clôture	935	628	22 176	23 791	491 427	463 206	1 178	753

Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) :	Titres		Titres		Titres		Titres	
Titres en circulation, à l'ouverture	59	–	2 152	2 017	44 683	41 420	83	3
Émis	9	43	132	166	1 909	2 943	17	61
Réinvestissement des distributions	1	1	–	–	–	–	2	–
Rachetés	–	–	(420)	(137)	(928)	(973)	(5)	(1)
Titres en circulation, à la clôture	69	44	1 864	2 046	45 664	43 390	97	63

	Série T6		Série T8		Série LB		Série LM	
	\$		\$		\$		\$	
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES								
À l'ouverture	3 647	4 237	898	1 430	320 802	367 315	92 054	210 504
Augmentation (diminution) de l'actif net								
liée aux activités d'exploitation	50	2	14	–	4 266	(558)	1 203	128
Distributions aux porteurs de titres :								
Revenu de placement	(11)	(4)	(3)	(1)	–	–	(292)	(183)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(77)	(95)	(31)	(41)	–	–	(2 373)	(5 683)
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	(88)	(99)	(34)	(42)	–	–	(2 665)	(5 866)
Opérations sur les titres :								
Produit de l'émission de titres	1 547	446	108	383	37 974	100 033	223	427
Réinvestissement des distributions	47	53	26	25	–	–	2 663	5 864
Paiements au rachat de titres	(2 795)	(1 424)	(228)	(839)	(41 994)	(25 070)	(11 371)	(28 164)
Total des opérations sur les titres	(1 201)	(925)	(94)	(431)	(4 020)	74 963	(8 485)	(21 873)
Augmentation (diminution) totale de l'actif net	(1 239)	(1 022)	(114)	(473)	246	74 405	(9 947)	(27 611)
À la clôture	2 408	3 215	784	957	321 048	441 720	82 107	182 893

Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) :	Titres		Titres		Titres		Titres	
Titres en circulation, à l'ouverture	282	308	80	116	26 945	30 802	10 548	22 684
Émis	119	33	10	32	3 158	8 338	25	46
Réinvestissement des distributions	4	4	2	2	–	–	306	641
Rachetés	(216)	(104)	(20)	(69)	(3 491)	(2 091)	(1 305)	(3 057)
Titres en circulation, à la clôture	189	241	72	81	26 612	37 049	9 574	20 314

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

PORTEFEUILLE ÉQUILBRÉ SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

PORTEFEUILLE DE GESTION DE L'ACTIF

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

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

	2018	2017	2018	2017	2018	2017	2018	2017
	Série LW		Série LW6		Série LX		Total	
	\$		\$		\$		\$	
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES								
À l'ouverture	195 464	–	69 904	–	11 749	17 174	2 284 544	2 064 764
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	2 784	–	979	–	154	(10)	38 017	5 480
Distributions aux porteurs de titres :								
Revenu de placement	–	–	(283)	–	(39)	(18)	(10 675)	(4 579)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	(1 846)	–	(316)	(517)	(4 799)	(6 408)
Rabais sur les frais de gestion	(24)	–	(9)	–	–	–	(70)	(24)
Total des distributions aux porteurs de titres	(24)	–	(2 138)	–	(355)	(535)	(15 544)	(11 011)
Opérations sur les titres :								
Produit de l'émission de titres	23 651	–	2 759	–	1 200	3 532	360 024	407 853
Réinvestissement des distributions	13	–	2 121	–	353	522	5 354	6 530
Paiements au rachat de titres	(18 931)	–	(6 893)	–	(1 688)	(2 455)	(357 341)	(315 407)
Total des opérations sur les titres	4 733	–	(2 013)	–	(135)	1 599	8 037	98 976
Augmentation (diminution) totale de l'actif net	7 493	–	(3 172)	–	(336)	1 054	30 510	93 445
À la clôture	202 957	–	66 732	–	11 413	18 228	2 315 054	2 158 209
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) :								
Titres en circulation, à l'ouverture	20 061	–	4 882	–	927	1 275		
Émis	2 403	–	193	–	96	263		
Réinvestissement des distributions	1	–	149	–	28	39		
Rachetés	(1 919)	–	(483)	–	(134)	(183)		
Titres en circulation, à la clôture	20 546	–	4 741	–	917	1 394		

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.



MACKENZIE
Placements

PORTEFEUILLE ÉQUILIBRÉ SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

PORTEFEUILLE DE GESTION DE L'ACTIF

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 titres liée aux activités d'exploitation	38 017	5 480
Ajustements pour :		
Perte (profit) net(te) réalisé(e) sur les placements	(15 482)	(15 906)
Variation de la perte (du profit) net(te) latent(e) sur les placements	(17 257)	18 438
Achat de placements	(260 386)	(568 081)
Produit de la vente et de l'échéance de placements	237 228	477 541
Variation des intérêts courus à recevoir	(2)	1
Variation des dividendes à recevoir	(55)	(8)
Variation des sommes à recevoir du gestionnaire	37	17
Variation des sommes à payer au gestionnaire	(216)	–
Variation de la couverture sur contrats à terme standardisés	8 694	(3 890)
Trésorerie nette liée aux activités d'exploitation	(9 422)	(86 408)

Flux de trésorerie liés aux activités de financement

Produit de l'émission de titres	210 282	238 874
Paievements au rachat de titres	(207 413)	(146 351)
Distributions versées, déduction faite des réinvestissements	(10 190)	(4 481)
Trésorerie nette liée aux activités de financement	(7 321)	88 042

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

	(16 743)	1 634
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à l'ouverture	256 711	159 262
Incidence des fluctuations des taux de change sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie	(247)	85
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture	239 721	160 981

Trésorerie	716	1 559
Équivalents de trésorerie	239 005	159 422
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture	239 721	160 981

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

Dividendes reçus	8 732	5 064
Impôts étrangers payés	61	85
Intérêts reçus	26 241	21 559
Intérêts versés	15	7

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.



MACKENZIE
Placements

PORTEFEUILLE ÉQUILIBRÉ SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

PORTEFEUILLE DE GESTION DE L'ACTIF

TABLEAU DES PLACEMENTS

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
FONDS/BILLETS NÉGOCIÉS EN BOURSE					
iShares MSCI EAFE Small Cap Index Fund ETF	Fonds indiciels multipays	Fonds/billets négociés en bourse	94 000	7 912	7 566
FINB Diversification maximale Canada Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	663 800	14 197	14 710
ProShares Short VIX Short-Term Futures ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	45 975	2 909	3 511
SPDR Barclays Capital High Yield Bond ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	50	2	2
Total des fonds/billets négociés en bourse				25 020	25 789
FONDS COMMUNS DE PLACEMENT					
Fonds d'obligations de sociétés Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	7 281 099	63 438	64 185
Fonds de grandes capitalisations des marchés émergents Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	889 520	8 864	8 175
Fonds de petites capitalisations des marchés émergents Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	713 979	7 124	6 321
Fonds mondial lié à l'inflation Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	2 340 633	23 424	22 910
Fonds multistratégie à rendement absolu Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	6 984 661	69 380	69 622
Fonds d'obligations souveraines Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	3 646 629	37 346	35 650
Fonds d'obligations canadiennes Symétrie, série R	Canada	Fonds communs de placement	66 044 914	662 365	657 536
Fonds d'actions canadiennes Symétrie, série R	Canada	Fonds communs de placement	34 393 225	443 120	467 665
Fonds élargi d'actions Symétrie, série R	Canada	Fonds communs de placement	27 416 863	286 325	327 629
Fonds d'actions EAFE Symétrie, série R	Canada	Fonds communs de placement	3 571 046	38 646	39 875
Fonds d'obligations mondiales Symétrie, série R	Canada	Fonds communs de placement	18 115 387	177 800	172 294
Fonds à faible volatilité Symétrie, série R	Canada	Fonds communs de placement	704 106	9 167	10 293
Fonds d'actions américaines Symétrie, série R	Canada	Fonds communs de placement	10 764 118	125 451	154 928
Total des fonds communs de placement				1 952 450	2 037 083
Coûts de transaction				(161)	–
Total des placements				1 977 309	2 062 872
Instruments dérivés (se reporter au tableau des instruments dérivés)					5 524
Trésorerie et équivalents de trésorerie*					239 721
Autres éléments d'actif moins le passif					6 937
Total de l'actif net					2 315 054

* Comprend 105 455 \$ détenus dans le Fonds du marché monétaire canadien Mackenzie, série R, un fonds géré par Mackenzie.



MACKENZIE
Placements

PORTEFEUILLE ÉQUILIBRÉ SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

PORTEFEUILLE DE GESTION DE L'ACTIF

APERÇU DU PORTEFEUILLE

30 septembre 2018	
Répartition effective du portefeuille	% de la VL
Actions	47,9
<i>Actions</i>	43,7
<i>Positions acheteur sur contrats à terme</i>	4,2
<i>Positions vendeur sur contrats à terme</i>	(0,0)
Obligations	46,2
<i>Obligations</i>	39,5
<i>Positions acheteur sur contrats à terme</i>	6,7
<i>Positions vendeur sur contrats à terme</i>	0,0
Trésorerie et placements à court terme*	2,8
Fonds/billets négociés en bourse	2,4
Autres éléments d'actif (de passif)	0,7
Répartition régionale effective	% de la VL
Canada	53,3
États-Unis	27,3
Autres	4,1
Royaume-Uni	3,6
Trésorerie et placements à court terme*	2,8
Allemagne	2,4
Japon	1,6
Chine	1,1
France	0,8
Autres éléments d'actif (de passif)	0,7
Australie	0,7
Pays-Bas	0,5
Suisse	0,5
Corée du Sud	0,3
Mexique	0,3
Répartition sectorielle effective	% de la VL
Obligations de sociétés	23,9
Services financiers	10,5
Obligations fédérales	10,3
Autres	8,8
Produits industriels	5,9
Obligations d'État étrangères	5,6
Technologie de l'information	5,5
Énergie	5,3
Consommation discrétionnaire	4,1
Matières	3,6
Obligations provinciales	3,2
Soins de santé	2,9
Trésorerie et placements à court terme*	2,8
Prêts à terme	2,4
Fonds/billets négociés en bourse	2,4
Consommation courante	2,1
Autres éléments d'actif (de passif)	0,7
Exposition nette effective aux devises	% de la VL
Dollar canadien	76,5
Dollar américain	28,2
Autres	1,7
Yen japonais	1,5
Dollar de Hong Kong	1,1
Livre sterling	(0,9)
Euro	(8,1)

31 mars 2018	
Répartition effective du portefeuille	% de la VL
Actions	55,3
<i>Actions</i>	45,7
<i>Positions acheteur sur contrats à terme</i>	9,6
<i>Positions vendeur sur contrats à terme</i>	0,0
Obligations	40,6
<i>Obligations</i>	40,6
<i>Positions acheteur sur contrats à terme</i>	0,0
<i>Positions vendeur sur contrats à terme</i>	(0,0)
Trésorerie et placements à court terme*	2,5
Autres éléments d'actif (de passif)	0,8
Fonds/billets négociés en bourse	0,8
Répartition régionale effective	% de la VL
Canada	53,3
États-Unis	25,4
Autres	4,1
Japon	3,4
Royaume-Uni	3,3
Trésorerie et placements à court terme*	2,5
Allemagne	2,0
Chine	1,3
France	0,9
Autres éléments d'actif (de passif)	0,8
Suisse	0,7
Pays-Bas	0,7
Corée du Sud	0,6
Australie	0,6
Hong Kong	0,4
Répartition sectorielle effective	% de la VL
Obligations de sociétés	22,8
Services financiers	11,7
Autres	11,3
Obligations fédérales	7,5
Produits industriels	5,8
Technologie de l'information	5,5
Consommation discrétionnaire	4,8
Énergie	4,7
Obligations d'État étrangères	4,4
Matières	4,2
Obligations provinciales	2,9
Consommation courante	2,9
Trésorerie et placements à court terme*	2,5
Soins de santé	2,5
Prêts à terme	2,2
Services publics	1,4
Immobilier	1,1
Services de télécommunications	1,0
Autres éléments d'actif (de passif)	0,8
Exposition nette effective aux devises	% de la VL
Dollar canadien	68,2
Euro	10,9
Dollar américain	6,6
Livre sterling	5,9
Yen japonais	4,4
Autres	4,0

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

* Une portion de la répartition effective de la trésorerie du Fonds est investie dans des titres de série R d'un fonds du marché monétaire géré par Mackenzie.



MACKENZIE
Placements

PORTEFEUILLE ÉQUILIBRÉ SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

PORTEFEUILLE DE GESTION DE L'ACTIF

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)
150	Contrats à terme libellés en yens sur l'indice Nikkei 225, décembre 2018	13 décembre 2018	22 817,47 JPY	20 605	1 546
(187)	Contrats à terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans, décembre 2018	19 décembre 2018	119,46 USD	(28 705)	303
352	Contrats à terme sur l'indice S&P/TSX 60, décembre 2018	20 décembre 2018	956,15 CAD	66 901	34
(2)	Contrats à terme sur l'indice Euro STOXX 50, décembre 2018	21 décembre 2018	3 402,00 EUR	(102)	–
18	Contrats à terme sur l'indice MSCI Marchés émergents, décembre 2018	21 décembre 2018	1 029,00 USD	1 221	24
Profits latents				59 920	1 907
102	Contrats à terme sur euro-obligations, décembre 2018	6 décembre 2018	159,99 EUR	24 299	(55)
51	Contrats à terme sur obligations du Trésor australien à 10 ans, décembre 2018	17 décembre 2018	129,47 AUD	6 138	(19)
783	Contrats à terme sur obligations canadiennes à 10 ans, décembre 2018	18 décembre 2018	133,81 CAD	103 841	(896)
(49)	Contrats à terme sur l'indice CME E-Mini Standard & Poor's 500, décembre 2018	21 décembre 2018	2 896,10 USD	(9 242)	(73)
48	Contrats à terme sur l'indice E-Mini Russell 2000, décembre 2018	21 décembre 2018	1 709,40 USD	5 275	(27)
–	Contrats à terme sur l'indice FTSE 100, décembre 2018	21 décembre 2018	7 272,63 GBP	–	(1)
112	Contrats à terme sur obligations du Royaume-Uni, décembre 2018	27 décembre 2018	122,18 GBP	22 810	(216)
(Pertes) latentes				153 121	(1 287)
Total des contrats à terme standardisés				213 041	620

* 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	11 407	Dollar canadien (8 590)	Dollar américain	5 octobre 2018	(11 407)	(11 097)	310
AA	23 979	Dollar canadien (18 171)	Dollar américain	5 octobre 2018	(23 979)	(23 476)	503
AA	6 248	Dollar canadien (4 003)	Euro	5 octobre 2018	(6 248)	(6 008)	240
AA	23 491	Dollar canadien (15 145)	Euro	5 octobre 2018	(23 491)	(22 728)	763
AA	21 930	Dollar canadien (16 490)	Dollar américain	5 octobre 2018	(21 930)	(21 304)	626
AA	40 173	Euro (45 969)	Dollar américain	19 octobre 2018	59 406	60 375	969
AA	18 099	Dollar américain (15 372)	Euro	19 octobre 2018	(23 390)	(23 103)	287
AA	135	Livre sterling (175)	Dollar américain	19 octobre 2018	226	228	2
AA	247	Livre sterling (320)	Dollar américain	19 octobre 2018	413	416	3
AA	49	Livre sterling (62)	Dollar américain	19 octobre 2018	80	82	2
AA	490	Dollar américain (375)	Livre sterling	19 octobre 2018	(633)	(632)	1
AA	1 527	Dollar américain (1 160)	Livre sterling	19 octobre 2018	(1 973)	(1 956)	17
AA	431	Dollar américain (327)	Livre sterling	19 octobre 2018	(557)	(552)	5
AA	533	Dollar américain (404)	Livre sterling	19 octobre 2018	(689)	(681)	8
AA	2	Dollar américain (2)	Livre sterling	19 octobre 2018	(3)	(3)	–
AA	771	Dollar américain (585)	Livre sterling	19 octobre 2018	(997)	(986)	11
AA	571	Dollar canadien (435)	Dollar américain	19 octobre 2018	(572)	(562)	10
AA	392	Dollar canadien (298)	Dollar américain	19 octobre 2018	(392)	(385)	7



MACKENZIE
Placements

PORTEFEUILLE ÉQUILIBRÉ SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

PORTEFEUILLE DE GESTION DE L'ACTIF

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 latents \$ (en milliers)
AA	2 714	Dollar canadien	(2 083)	Dollar américain	19 octobre 2018	(2 716)	(2 692)	24
AA	668	Dollar canadien	(505)	Dollar américain	19 octobre 2018	(669)	(652)	17
AA	315	Dollar américain	(407)	Dollar canadien	19 octobre 2018	406	407	1
AA	1 491	Euro	(1 703)	Dollar américain	19 octobre 2018	2 201	2 241	40
AA	2 698	Dollar américain	(2 303)	Euro	19 octobre 2018	(3 486)	(3 461)	25
AA	848	Dollar américain	(721)	Euro	19 octobre 2018	(1 096)	(1 084)	12
AA	1 349	Dollar américain	(1 146)	Euro	19 octobre 2018	(1 743)	(1 722)	21
AA	593	Dollar américain	(505)	Euro	19 octobre 2018	(766)	(758)	8
AA	1 631	Dollar américain	(1 399)	Euro	19 octobre 2018	(2 108)	(2 103)	5
AA	884	Dollar américain	(758)	Euro	19 octobre 2018	(1 142)	(1 139)	3
AA	65	Dollar américain	(7 223)	Yen japonais	19 octobre 2018	(84)	(82)	2
AA	409	Dollar américain	(45 269)	Yen japonais	19 octobre 2018	(529)	(516)	13
AA	113	Dollar américain	(12 590)	Yen japonais	19 octobre 2018	(146)	(143)	3
AA	954	Dollar américain	(105 509)	Yen japonais	19 octobre 2018	(1 233)	(1 202)	31
AA	50	Dollar américain	(5 575)	Yen japonais	19 octobre 2018	(64)	(63)	1
AA	5	Dollar américain	(614)	Yen japonais	19 octobre 2018	(7)	(7)	–
AA	244	Dollar américain	(26 916)	Yen japonais	19 octobre 2018	(315)	(307)	8
AA	128 693	Dollar canadien	(99 144)	Dollar américain	26 octobre 2018	(128 693)	(127 973)	720
A	50 212	Dollar américain	(42 425)	Euro	26 octobre 2018	(64 889)	(63 799)	1 090
AA	3 829	Livre sterling	(4 957)	Dollar américain	26 octobre 2018	6 406	6 459	53
AA	10 779	Dollar américain	(8 185)	Livre sterling	26 octobre 2018	(13 930)	(13 805)	125
AA	5 783	Dollar américain	(636 935)	Yen japonais	26 octobre 2018	(7 474)	(7 259)	215
AA	21 832	Dollar canadien	(1 840 688)	Yen japonais	31 octobre 2018	(21 832)	(20 960)	872
AA	28 899	Dollar canadien	(22 251)	Dollar américain	2 novembre 2018	(28 899)	(28 716)	183
AA	44 296	Dollar canadien	(28 781)	Euro	2 novembre 2018	(44 296)	(43 245)	1 051
AA	65 380	Dollar canadien	(50 093)	Dollar américain	2 novembre 2018	(65 380)	(64 648)	732
AA	10 575	Dollar canadien	(8 045)	Dollar américain	2 novembre 2018	(10 575)	(10 382)	193
AA	38 646	Livre sterling	(64 612)	Dollar canadien	7 novembre 2018	64 612	65 118	506
AA	14 112	Dollar canadien	(8 235)	Livre sterling	9 novembre 2018	(14 112)	(13 877)	235
AA	18 801	Dollar canadien	(1 612 285)	Yen japonais	9 novembre 2018	(18 801)	(18 368)	433
AA	16 977	Dollar américain	(12 858)	Livre sterling	9 novembre 2018	(21 939)	(21 700)	239
A	35 936	Dollar américain	(27 259)	Livre sterling	9 novembre 2018	(46 440)	(46 004)	436
AA	45 989	Dollar canadien	(3 948 089)	Yen japonais	9 novembre 2018	(45 989)	(44 979)	1 010
AA	32 728	Dollar américain	(27 875)	Euro	16 novembre 2018	(42 294)	(41 991)	303
AA	54 537	Dollar américain	(46 452)	Euro	16 novembre 2018	(70 478)	(69 974)	504
AA	8 759	Dollar américain	(7 500)	Euro	16 novembre 2018	(11 319)	(11 298)	21
AA	13 590	Dollar américain	(1 515 933)	Yen japonais	16 novembre 2018	(17 562)	(17 304)	258
AA	12 342	Dollar canadien	(9 272)	Franc suisse	28 novembre 2018	(12 342)	(12 255)	87
AA	266	Dollar canadien	(22 240)	Yen japonais	28 novembre 2018	(266)	(254)	12
AA	11 888	Dollar canadien	(9 061)	Dollar américain	30 novembre 2018	(11 888)	(11 687)	201
A	8 702	Dollar canadien	(6 677)	Dollar américain	7 décembre 2018	(8 702)	(8 610)	92
A	51 235	Dollar canadien	(39 644)	Dollar américain	7 décembre 2018	(51 235)	(51 127)	108
AA	22 421	Dollar canadien	(14 747)	Euro	7 décembre 2018	(22 421)	(22 210)	211
AA	2 537	Dollar canadien	(1 961)	Dollar américain	14 décembre 2018	(2 537)	(2 528)	9



MACKENZIE
Placements

PORTEFEUILLE ÉQUILIBRÉ SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

PORTEFEUILLE DE GESTION DE L'ACTIF

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) latentes \$ (en milliers)
AA	29 282	Dollar canadien	(19 148)	Euro	11 janvier 2019	(29 282)	(28 914)	368
AA	36 874	Dollar américain	(28 050)	Livre sterling	18 janvier 2019	(47 653)	(47 521)	132
AA	7 805	Dollar américain	(6 580)	Euro	18 janvier 2019	(10 087)	(9 971)	116
Profits latents								14 493
AA	1 483	Dollar américain	(1 940)	Dollar canadien	5 octobre 2018	1 940	1 916	(24)
AA	1 556	Dollar américain	(2 017)	Dollar canadien	5 octobre 2018	2 017	2 010	(7)
AA	7 322	Dollar américain	(9 534)	Dollar canadien	5 octobre 2018	9 534	9 460	(74)
AA	19 148	Euro	(29 095)	Dollar canadien	5 octobre 2018	29 095	28 735	(360)
AA	70	Dollar américain	(92)	Dollar canadien	5 octobre 2018	92	91	(1)
AA	10 917	Dollar américain	(14 336)	Dollar canadien	5 octobre 2018	14 336	14 104	(232)
AA	11 832	Dollar américain	(15 315)	Dollar canadien	5 octobre 2018	15 315	15 286	(29)
AA	70 812	Dollar américain	(93 721)	Dollar canadien	19 octobre 2018	93 721	91 429	(2 292)
AA	43 925	Dollar américain	(38 303)	Euro	19 octobre 2018	(56 765)	(57 566)	(801)
AA	43 815	Dollar américain	(38 183)	Euro	19 octobre 2018	(56 622)	(57 385)	(763)
AA	463	Livre sterling	(604)	Dollar américain	19 octobre 2018	781	780	(1)
AA	1 444	Livre sterling	(1 891)	Dollar américain	19 octobre 2018	2 444	2 434	(10)
AA	1 123	Dollar américain	(873)	Livre sterling	19 octobre 2018	(1 451)	(1 472)	(21)
AA	56	Dollar américain	(74)	Dollar canadien	19 octobre 2018	73	73	–
AA	703	Dollar américain	(909)	Dollar canadien	19 octobre 2018	909	909	–
AA	256	Dollar américain	(332)	Dollar canadien	19 octobre 2018	332	331	(1)
AA	357	Dollar américain	(463)	Dollar canadien	19 octobre 2018	463	461	(2)
AA	72	Dollar américain	(94)	Dollar canadien	19 octobre 2018	94	93	(1)
AA	132	Dollar américain	(174)	Dollar canadien	19 octobre 2018	174	171	(3)
AA	376	Dollar américain	(496)	Dollar canadien	19 octobre 2018	496	486	(10)
AA	127	Euro	(149)	Dollar américain	19 octobre 2018	193	191	(2)
AA	812	Euro	(946)	Dollar américain	19 octobre 2018	1 223	1 220	(3)
AA	281	Euro	(331)	Dollar américain	19 octobre 2018	428	422	(6)
AA	770	Euro	(901)	Dollar américain	19 octobre 2018	1 164	1 157	(7)
AA	3 351	Dollar américain	(2 892)	Euro	19 octobre 2018	(4 331)	(4 347)	(16)
AA	110 650	Yen japonais	(988)	Dollar américain	19 octobre 2018	1 277	1 261	(16)
AA	23 227	Yen japonais	(210)	Dollar américain	19 octobre 2018	271	265	(6)
AA	26 146	Yen japonais	(238)	Dollar américain	19 octobre 2018	307	298	(9)
AA	1 775	Yen japonais	(16)	Dollar américain	19 octobre 2018	21	20	(1)
AA	21 764	Yen japonais	(193)	Dollar américain	19 octobre 2018	249	247	(2)
AA	25 241	Dollar américain	(32 825)	Dollar canadien	26 octobre 2018	32 825	32 581	(244)
A	22 343	Euro	(26 029)	Dollar américain	26 octobre 2018	33 637	33 599	(38)
AA	14 035	Dollar américain	(10 953)	Livre sterling	26 octobre 2018	(18 138)	(18 472)	(334)
AA	699 912	Yen japonais	(6 362)	Dollar américain	26 octobre 2018	8 222	7 978	(244)
AA	698 663	Yen japonais	(6 296)	Dollar américain	26 octobre 2018	8 136	7 963	(173)
AA	33 970	Livre sterling	(58 732)	Dollar canadien	31 octobre 2018	58 732	57 229	(1 503)
AA	2 723 126	Yen japonais	(24 330)	Dollar américain	31 octobre 2018	31 442	31 048	(394)
A	9 304	Dollar américain	(7 128)	Livre sterling	9 novembre 2018	(12 024)	(12 031)	(7)
A	13 819	Dollar américain	(10 784)	Livre sterling	9 novembre 2018	(17 858)	(18 199)	(341)
AA	7 369	Euro	(8 692)	Dollar américain	16 novembre 2018	11 233	11 101	(132)



MACKENZIE
Placements

PORTEFEUILLE ÉQUILIBRÉ SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

PORTEFEUILLE DE GESTION DE L'ACTIF

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	12 253	Euro	(14 377)	Dollar américain	16 novembre 2018	18 579	18 458	(121)
AA	5 717	Dollar américain	(7 500)	Dollar canadien	30 novembre 2018	7 500	7 373	(127)
AA	41 115	Euro	(62 504)	Dollar canadien	7 décembre 2018	62 504	61 924	(580)
A	6 568 736	Yen japonais	(58 874)	Dollar américain	18 janvier 2019	76 083	75 432	(651)
(Pertes) latentes								(9 589)
Total des contrats de change à terme								4 904
Total des instruments dérivés à la juste valeur								5 524



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 ou une série est établi(e) ou rétabli(e), l'information fournie se rapporte à la période commençant à la date d'établissement ou de rétablissement. Se reporter à la note 9 pour la date de constitution du Fonds et la date d'établissement de chacune des séries.

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

Corporation Financière Mackenzie (« Mackenzie ») est le gestionnaire du Fonds 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. La Great-West, compagnie d'assurance-vie, la London Life, Compagnie d'Assurance-Vie et La Compagnie d'Assurance du Canada sur la Vie (collectivement, les « sociétés d'assurance liées ») appartiennent à cent pour cent à Great-West Lifeco Inc., elle aussi filiale de Corporation Financière Power. Les placements du Fonds dans des sociétés du groupe de sociétés Power sont identifiés dans le tableau des placements.

2. Base d'établissement et mode de présentation

Les présents états financiers intermédiaires non audités (les « états financiers ») ont été 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 Fonds, soit ceux de l'exercice clos le 31 mars 2018. La note 3 présente un résumé des principales méthodes comptables du Fonds en vertu des IFRS.

Sauf indication contraire, tous les montants présentés dans ces états financiers sont en dollars canadiens, soit la monnaie fonctionnelle et la monnaie de présentation du Fonds, et sont arrondis au millier 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 Fonds 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 Fonds devient partie aux exigences contractuelles de l'instrument. Les actifs financiers sont décomptabilisés lorsque le droit de percevoir les flux de trésorerie liés aux instruments est échu ou que le Fonds a transféré la quasi-totalité des risques et avantages inhérents à la propriété de ceux-ci. Les passifs financiers sont décomptabilisés lorsque l'obligation est 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 titres rachetables du Fonds comportent de multiples obligations contractuelles différentes et, par conséquent, satisfont aux critères de classement à titre de passifs financiers conformément à IAS 32, *Instruments financiers : Présentation*. L'obligation du Fonds à l'égard de l'actif net attribuable aux porteurs de titres est présentée au prix de rachat.

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 titres du Fonds, découlant d'activités de financement. Les changements relatifs aux titres du Fonds, y compris les changements découlant des flux de trésorerie et les changements sans effet de trésorerie, sont inclus à l'état de l'évolution de la situation financière. Tout changement relatif aux titres non réglé en espèces à la fin de la période est présenté à titre de Sommes à recevoir pour titres émis ou de Sommes à payer pour titres rachetés à l'état de la situation financière. Ces sommes à recevoir et à payer sont normalement réglées peu après la fin de 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 Fonds 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 Fonds 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 Fonds dans la gestion de ses engagements à court terme. La trésorerie et les équivalents de trésorerie sont présentés à leur juste valeur, qui se rapproche de leur coût amorti en raison de leur nature très liquide et de 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 Fonds peut avoir recours à des instruments dérivés (comme les options souscrites, les contrats à terme standardisés ou de gré à gré, les swaps ou les instruments dérivés 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 Fonds peut également avoir recours à des instruments dérivés à des fins autres que de couverture afin d'effectuer indirectement des placements dans des titres ou des marchés financiers, de s'exposer à d'autres devises, de chercher à générer des revenus supplémentaires ou à toute autre fin considérée comme appropriée par le ou les portefeuillistes du Fonds, pourvu que cela soit compatible avec les objectifs de placement du Fonds. Les instruments dérivés doivent être utilisés conformément à la législation canadienne sur les organismes de placement collectif, sous réserve des dispenses accordées au Fonds par les organismes de réglementation, le cas échéant. Pour de plus amples renseignements à cet égard, notamment sur les modalités de telles dispenses, le cas échéant, se reporter à la rubrique « Dispenses de l'application des dispositions du Règlement 81-102 » de la notice annuelle du Fonds.

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.



NOTES ANNEXES

3. Principales méthodes comptables (suite)

b) Évaluation de la juste valeur (suite)

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).

La valeur des contrats à terme standardisés ou des swaps fluctue quotidiennement; les règlements au comptant effectués tous les jours par le Fonds, le cas échéant, représentent 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 Fonds 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, dans le profit (la perte) réalisé(e) à la vente de placements ou dans le revenu provenant des rabais sur les frais, selon le cas.

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

d) Commissions et autres coûts 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 9. La valeur de certains services exclusifs fournis par des courtiers ne peut être estimée raisonnablement.

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

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

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 9 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 Fonds 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 Fonds conclut diverses conventions-cadres de compensation ou ententes similaires qui ne satisfont pas aux critères de compensation dans l'état de la situation financière, mais qui permettent tout de même de déduire les montants dans certaines circonstances, comme une faillite ou une résiliation de contrat. La note 9 résume les détails de la compensation, le cas échéant.

NOTES ANNEXES

3. Principales méthodes comptables (suite)

f) Compensation (suite)

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

g) Devises

Le dollar canadien est la monnaie fonctionnelle et la monnaie de présentation du Fonds. 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 titres, par titre

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

i) Valeur liquidative par titre

La valeur liquidative quotidienne d'un fonds de placement peut être calculée sans tenir compte des IFRS conformément aux règlements des Autorités canadiennes en valeurs mobilières (les « ACVM »). La différence entre la valeur liquidative et l'actif net attribuable aux porteurs de titres (tel qu'il est présenté dans les états financiers), le cas échéant, tient principalement aux différences liées à la juste valeur des placements et d'autres actifs et passifs financiers. Se reporter à la note 9 pour la valeur liquidative par titre du Fonds.

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

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

k) Fusions

Le Fonds comptabilise les fusions de fonds selon la méthode de l'acquisition. Selon cette méthode, l'un des fonds visés par une fusion est désigné comme le fonds acquéreur et est appelé le « Fonds issu de la fusion », tandis que l'autre fonds visé par la fusion est appelé le « Fonds supprimé ». Cette désignation est fondée sur la comparaison de la valeur liquidative relative des fonds et tient compte de facteurs comme le maintien des conseillers en placement, les objectifs et méthodes de placement, le type de titres en portefeuille ainsi que les frais et charges liés à la gestion du Fonds issu de la fusion.

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 Fonds 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 Fonds.

NOTES ANNEXES

4. Estimations et jugements comptables critiques (suite)

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 Fonds, 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 Fonds, sa façon de gérer l'ensemble des instruments financiers ainsi que sa performance globale sur la base de la juste valeur, et elle a conclu que la comptabilisation à la juste valeur par le biais du résultat net conformément à IFRS 9 constitue la méthode d'évaluation et de présentation la plus appropriée pour les instruments financiers du Fonds.

Monnaie fonctionnelle

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

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 Fonds 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 Fonds 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 bénéfices

Le Fonds est admissible à titre de fiducie de fonds commun de placement en vertu des dispositions de la Loi de l'impôt sur le revenu (Canada). Par conséquent, il est assujéti à l'impôt pour ce qui est de ses bénéfices, y compris le montant net des gains en capital réalisés pour l'année d'imposition, qui ne sont ni payés ni à payer à ses porteurs de titres à la fin de l'année d'imposition. Le Fonds 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 bénéfices autre que les impôts étrangers retenus à la source, le cas échéant.

Les pertes du Fonds ne peuvent être attribuées aux investisseurs et sont conservées par le Fonds pour des exercices futurs. Les pertes autres qu'en capital peuvent être reportées 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 9 pour les reports prospectifs de pertes du Fonds.

6. Frais de gestion et frais d'exploitation

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

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

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



NOTES ANNEXES

6. Frais de gestion et frais d'exploitation (suite)

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

Mackenzie peut renoncer aux frais de gestion et d'administration ou les absorber à son gré et supprimer la renonciation ou l'absorption de ces frais en tout temps, sans préavis. Se reporter à la note 9 pour les taux des frais de gestion et d'administration imputés à chaque série de titres.

7. Capital du Fonds

Le capital du Fonds, qui comprend l'actif net attribuable aux porteurs de titres, est réparti entre les différentes séries, lesquelles comportent chacune un nombre illimité de titres. Les titres en circulation du Fonds aux 30 septembre 2018 et 2017 ainsi que les titres qui ont été émis, réinvestis et rachetés au cours de ces périodes sont présentés dans l'état de l'évolution de la situation financière. Mackenzie gère le capital du Fonds conformément aux objectifs de placement décrits à la note 9.

8. Risques découlant des instruments financiers

i. Exposition au risque et gestion du risque

Les activités de placement du Fonds l'exposent à divers risques financiers, tels qu'ils sont définis dans IFRS 7, *Instruments financiers : Informations à fournir* (« IFRS 7 »). L'exposition du Fonds aux risques financiers est concentrée dans ses placements, lesquels sont présentés dans le tableau des placements au 30 septembre 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 Fonds par l'embauche de conseillers en portefeuille professionnels et expérimentés, par la surveillance quotidienne des positions du Fonds et des événements du marché ainsi que par la diversification du portefeuille de placements en respectant les contraintes des objectifs de placement du Fonds; elle peut aussi, le cas échéant, avoir recours à des instruments dérivés à titre de couverture de certains risques. Pour faciliter la gestion des risques, Mackenzie maintient également une structure de gouvernance, dont le rôle consiste à superviser les activités de placement du Fonds et à s'assurer de la conformité avec la stratégie de placement établie du Fonds, les directives internes et la réglementation des valeurs mobilières.

ii. Risque de liquidité

Le risque de liquidité est le risque que le Fonds éprouve des difficultés à respecter ses obligations financières au fur et à mesure que celles-ci deviennent exigibles. Le Fonds est exposé au risque de liquidité en raison des rachats potentiels quotidiens en espèces de titres rachetables. Conformément à la réglementation sur les valeurs mobilières, le Fonds doit conserver au moins 90 % de son actif dans des placements liquides (c.-à-d. des placements pouvant être facilement vendus). En outre, le Fonds maintient des positions de trésorerie et de placements à court terme suffisantes pour assurer une liquidité adéquate. Le Fonds peut également emprunter jusqu'à concurrence de 5 % de la valeur de son actif net pour financer ses rachats.

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 Fonds, fluctue en raison de variations des taux de change. La note 9 résume l'exposition du Fonds 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 Fonds à des niveaux élevés de risque de taux d'intérêt. La note 9 résume l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt, si une telle exposition s'applique et est considérable.



NOTES ANNEXES

8. 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 Fonds 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 Fonds. Pour atténuer ce risque, le Fonds s'assure de détenir à la fois l'élément sous-jacent, la couverture en espèces ou la marge, dont la valeur équivaut à celle du contrat dérivé ou lui est supérieure. La note 9 résume l'exposition du Fonds 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 Fonds. La note 9 résume l'exposition du Fonds 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 Fonds peut effectuer des opérations de prêt sur titres avec d'autres parties et peut aussi être exposé au risque de crédit découlant des contreparties aux instruments dérivés qu'il pourrait utiliser. Le risque de crédit associé à ces opérations est jugé minime puisque toutes les contreparties ont une cote de solvabilité équivalant à une note de crédit d'une agence de notation désignée d'au moins A-1 (faible) pour la dette à court terme ou de A pour la dette à long terme, selon le cas.

vii. Fonds sous-jacents

Le Fonds peut investir dans des fonds sous-jacents et peut être exposé indirectement au risque de change, au risque de taux d'intérêt, à l'autre risque de prix et au risque de crédit en raison des fluctuations de la valeur des instruments financiers détenus par les fonds sous-jacents. La note 9 résume l'exposition du Fonds à ces risques provenant des fonds sous-jacents, si une telle exposition s'applique et est considérable.



NOTES ANNEXES

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

a) Constitution du Fonds et renseignements sur les séries

Date de constitution 19 novembre 2008

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

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

Les titres des séries A, T6 et T8 sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$ (5 000 \$ pour les séries T6 et T8). Les investisseurs des séries T6 et T8 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel régulier de 6 % ou de 8 % par année, respectivement.

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

Les titres de série D sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$ par l'entremise d'un compte de courtage à escompte ou de tout autre compte approuvé par Mackenzie.

Les titres des séries F et F6 sont offerts aux investisseurs qui participent à un programme de services rémunérés à l'acte ou de comptes intégrés parrainé par le courtier, qui sont assujettis à des frais établis en fonction de l'actif plutôt qu'à des commissions pour chaque opération et qui investissent un minimum de 500 \$ (5 000 \$ pour la série F6); ils sont également proposés aux employés de Mackenzie et de ses filiales, et aux administrateurs de Mackenzie. Les investisseurs de série F6 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel régulier de 6 % par année.

Les titres des séries FB et FB5 sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$. Les investisseurs doivent négocier leurs honoraires de service du conseiller, lesquels ne peuvent dépasser 1,50 %, avec leur conseiller financier. Les investisseurs de série FB5 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année.

Les titres des séries O et O6 sont offerts seulement aux investisseurs qui investissent un minimum de 500 000 \$ et qui participent au Service d'architecture de portefeuille ou au Service d'architecture ouverte de Mackenzie; ils sont également proposés à certains investisseurs institutionnels et à certains employés admissibles de Mackenzie et de ses filiales. Les investisseurs de série O6 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 6 % par année.

Les titres des séries PW, PWT6 et PWT8 sont offerts à certains investisseurs à valeur nette élevée de nos Solutions Patrimoine privé qui investissent un minimum de 100 000 \$. Les investisseurs des séries PWT6 et PWT8 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 6 % ou de 8 % par année, respectivement.

Les titres des séries PWFB et PWFB5 sont offerts à certains investisseurs à valeur nette élevée de nos Solutions Patrimoine privé qui investissent un minimum de 100 000 \$. Les investisseurs doivent négocier leurs honoraires de service du conseiller, lesquels ne peuvent dépasser 1,50 %, avec leur conseiller financier. Les investisseurs de série PWFB5 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année.

Les titres de série PWX sont offerts à certains investisseurs à valeur nette élevée de nos Solutions Patrimoine privé qui investissent un minimum de 100 000 \$. Les investisseurs doivent négocier leurs honoraires de service du conseiller, lesquels ne peuvent dépasser 1,50 %, avec leur conseiller financier.

Les titres de série R sont offerts exclusivement à d'autres fonds affiliés et à certains investisseurs institutionnels relativement à des ententes de fonds de fonds.

Les titres de série S sont offerts aux sociétés d'assurance affiliées et à certains autres fonds communs, mais peuvent être vendus à d'autres investisseurs comme le déterminera Mackenzie.

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

Les titres de série G ne sont plus offerts à la vente, sauf dans le cas d'achats supplémentaires effectués par des investisseurs qui détiennent ces titres depuis le 11 décembre 2017.

Les titres des séries I et J ne sont plus offerts à la vente.

Les titres des séries PWF et PWF6 ne sont plus offerts à la vente. Le 1^{er} juin 2018, les titres des séries PWF et PWF6 ont été regroupés avec les titres des séries F et F6, respectivement.



NOTES ANNEXES

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

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

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

Les titres des séries LB et LX sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$ (5 000 \$ pour la série LX). Les investisseurs de série LX désirent également recevoir un flux de revenu mensuel régulier de 6 % par année.

Les titres des séries LW et LW6 sont offerts à certains investisseurs à valeur nette élevée du programme de tarification préférentielle qui investissent un minimum de 100 000 \$. Les investisseurs de série LW6 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel régulier de 6 % par année.

Les titres de série LM ne sont plus offerts à la vente, sauf aux investisseurs qui participaient aux programmes de prélèvements automatiques en vigueur en date du 25 novembre 2015.

Un investisseur dans le Fonds peut choisir parmi différents modes de souscription offerts au sein de chaque série. Ces modes de souscription comprennent le mode de souscription avec frais d'acquisition, le mode de souscription avec frais de rachat, divers modes de souscription avec frais modérés et le mode de souscription sans frais. Les frais du mode de souscription avec frais d'acquisition sont négociés entre l'investisseur et son courtier. Les frais du mode de souscription avec frais de rachat ou avec frais modérés sont payables à Mackenzie si un investisseur procède au rachat de ses titres du Fonds au cours de périodes précises. Les séries du Fonds ne sont pas toutes offertes selon tous les modes de souscription, et les frais de chaque mode de souscription peuvent varier selon la série. Pour de plus amples renseignements sur ces modes de souscription, veuillez vous reporter au prospectus simplifié du Fonds et à l'aperçu du Fonds.



PORTEFEUILLE ÉQUILBRÉ SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

PORTEFEUILLE DE GESTION DE L'ACTIF

NOTES ANNEXES

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

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

Série	Date d'établissement/ de rétablissement	Frais de gestion	Frais d'administration	Valeur liquidative par titre (\$)	
				30 sept. 2018	31 mars 2018
Série A	24 novembre 2008	1,85 %	0,20 %	15,42	15,21
Série AR	18 novembre 2011	1,85 %	0,20 %	12,65	12,48
Série B	6 mai 2011	1,85 % ⁷⁾	0,20 % ⁸⁾	11,32	11,17
Série C	13 mai 2011	1,76 %	0,27 %	11,44	11,29
Série D	19 mars 2014	1,10 %	0,16 %	10,67	10,48
Série F	22 décembre 2008	0,70 % ³⁾	0,15 % ⁶⁾	15,86	15,54
Série F6	28 octobre 2014	0,70 % ³⁾	0,15 % ⁶⁾	12,85	12,98
Série FB	26 octobre 2015	0,85 %	0,20 %	10,68	10,48
Série FB5	26 octobre 2015	0,85 %	0,20 %	13,85	13,94
Série G	29 juillet 2009	1,35 %	0,20 %	13,77	13,54
Série I	27 janvier 2009	1,40 %	0,20 %	15,02	14,78
Série J	18 février 2009	1,50 %	0,20 %	15,16	14,93
Série O	1 ^{er} avril 2010	— ¹⁾	—*	20,53	20,02
Série O6	16 octobre 2017	— ¹⁾	—*	14,41	14,48
Série PW	11 octobre 2013	1,70 % ⁴⁾	0,15 %	11,51	11,35
Série PWF	Aucun titre émis ⁹⁾	0,80 %	0,15 %	—	11,54
Série PWF6	Aucun titre émis ¹⁰⁾	0,80 %	0,15 %	—	14,24
Série PWF6	3 avril 2017	0,70 % ⁵⁾	0,15 %	10,24	10,03
Série PWF6	3 avril 2017	0,70 % ⁵⁾	0,15 %	14,38	14,43
Série PWT6	3 avril 2017	1,70 % ⁴⁾	0,15 %	13,88	14,10
Série PWT8	3 avril 2017	1,70 % ⁴⁾	0,15 %	13,57	13,94
Série PWX	19 décembre 2013	— ²⁾	— ²⁾	11,90	11,60
Série R	21 octobre 2015	—*	—*	10,76	10,71
Série S	31 janvier 2013	— ¹⁾	0,025 %	12,09	12,04
Série T6	13 mai 2013	1,85 %	0,20 %	12,72	12,94
Série T8	14 mai 2013	1,85 %	0,20 %	10,92	11,23
Série LB	18 janvier 2012	1,85 %	0,20 %	12,06	11,91
Série LM	30 janvier 2012	1,85 %	0,20 %	8,58	8,73
Série LW	1 ^{er} décembre 2017	1,80 %	0,15 %	9,88	9,74
Série LW6	1 ^{er} décembre 2017	1,80 %	0,15 %	14,08	14,32
Série LX	14 mai 2013	1,85 %	0,20 %	12,45	12,67

* Sans objet.

PORTEFEUILLE ÉQUILIBRÉ SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

PORTEFEUILLE DE GESTION DE L'ACTIF

NOTES ANNEXES

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

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

- 1) Ces frais sont négociables et sont payables directement à Mackenzie par les investisseurs dans cette série.
- 2) Ces frais sont payables directement à Mackenzie par les investisseurs dans cette série par l'entremise du rachat de leurs titres.
- 3) Avant le 1^{er} juin 2018, les frais de gestion pour cette série étaient imputés au Fonds au taux de 0,85 %.
- 4) Avant le 1^{er} juin 2018, les frais de gestion pour cette série étaient imputés au Fonds au taux de 1,80 %.
- 5) Avant le 1^{er} juin 2018, les frais de gestion pour cette série étaient imputés au Fonds au taux de 0,80 %.
- 6) Avant le 1^{er} juin 2018, les frais d'administration pour cette série étaient imputés au Fonds au taux de 0,16 %.
- 7) Avant le 17 août 2018, les frais de gestion pour la série B étaient imputés au Fonds au taux de 1,93 %.
- 8) Avant le 17 août 2018, les frais d'administration pour la série B étaient imputés au Fonds au taux de 0,27 %.
- 9) La date d'établissement initiale de la série est le 13 novembre 2013. Tous les titres de la série ont été regroupés avec les titres de la série F le 1^{er} juin 2018.
- 10) La date d'établissement initiale de la série est le 3 avril 2017. Tous les titres de la série ont été regroupés avec les titres de la série F6 le 1^{er} juin 2018.

b) Placements détenus par Mackenzie et des sociétés affiliées

Au 30 septembre 2018, Mackenzie, d'autres fonds gérés par Mackenzie et des sociétés d'assurance affiliées détenaient un placement de 168 \$, 491 427 \$ et 1 178 \$ (164 \$, 478 739 \$ et 1 004 \$ au 31 mars 2018), respectivement, dans le Fonds.

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	3 514	—
Valeur des biens reçus en garantie	3 707	—

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 Fonds pour les périodes closes les 30 septembre 2018 et 2017 est présenté ci-après :

	2018		2017	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
Revenus de prêts de titres bruts	76	100,0	4	100,0
Impôt retenu à la source	(10)	(13,2)	(1)	(25,0)
	66	86,8	3	75,0
Paiements à l'agent de prêt de titres	(17)	(22,4)	(1)	(25,0)
Revenu tiré du prêt de titres	49	64,4	2	50,0

e) Commissions

La valeur des services fournis par des tiers qui ont été payés par les courtiers au cours de la période est présentée dans le tableau ci-dessous :

	(\$)
30 septembre 2018	78
30 septembre 2017	3



MACKENZIE
Placements

PORTEFEUILLE ÉQUILIBRÉ SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

PORTEFEUILLE DE GESTION DE L'ACTIF

NOTES ANNEXES

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

f) Changement de sous-conseiller

Le 25 octobre 2017, Gestion de placements Connor, Clark & Lunn Ltée est devenue un sous-conseiller du fonds sous-jacent Fonds d'actions EAFE Symétrie.

g) 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	9 581	(4 496)	—	5 085
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(6 370)	4 496	7 870	5 996
Obligation pour options vendues	—	—	—	—
Total	3 211	—	7 870	11 081

	31 mars 2018			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	12 092	(7 440)	—	4 652
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(9 443)	7 440	16 564	14 561
Obligation pour options vendues	—	—	—	—
Total	2 649	—	16 564	19 213

h) Risques découlant des instruments financiers

i. Exposition au risque et gestion du risque

Le Fonds vise une croissance à long terme ainsi qu'un revenu en investissant principalement dans d'autres fonds communs de placement qui investissent dans des titres de participation et des titres à revenu fixe du Canada et de pays étrangers, ainsi que dans d'autres catégories d'actif, mais il peut aussi investir directement dans des titres. La répartition de l'actif du Fonds se situera généralement dans les fourchettes suivantes : 40 % à 60 % en titres de participation et 40 % à 60 % en titres à revenu fixe. Le Fonds est diversifié en termes d'exposition géographique, d'exposition sectorielle, d'exposition factorielle, de capitalisation boursière, de style de placement du gestionnaire de portefeuille, de qualité du crédit et de durée.

ii. Risque de change

Le Fonds est exposé au risque de change en raison de ses placements dans des fonds/billets négociés en bourse, des instruments dérivés et des fonds communs de placement. Tous les fonds sous-jacents sont libellés en dollars canadiens. Toutefois, le Fonds est indirectement exposé au risque que la valeur des instruments financiers libellés en devises détenus par les fonds sous-jacents fluctue en raison de variations des taux de change. Le Fonds et les fonds sous-jacents peuvent couvrir une partie ou la totalité de leur exposition au risque de change.

Au 30 septembre 2018, si le dollar canadien avait connu une hausse ou une baisse de 5 % relativement à toutes les devises, toute autre variable demeurant constante, l'actif net aurait diminué ou augmenté d'environ 27 117 \$ ou 1,2 % du total de l'actif net (34 432 \$ ou 1,5 % au 31 mars 2018). En pratique, les résultats réels de négociation peuvent différer et l'écart pourrait être important.



MACKENZIE
Placements

NOTES ANNEXES

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

h) Risques découlant des instruments financiers (suite)

iii. Risque de taux d'intérêt

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

	30 septembre 2018	31 mars 2018
Instruments dérivés	(\$)	(\$)
Moins de 1 an	128 384	(32 831)
1 an à 5 ans	—	—
5 ans à 10 ans	—	—
Plus de 10 ans	—	—
Total	128 384	(32 831)

Le Fonds est exposé indirectement au risque que la valeur des instruments financiers portant intérêt détenus dans les fonds sous-jacents fluctue selon les variations des taux d'intérêt du marché en vigueur.

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 73 019 \$ ou 3,2 % du total de l'actif net (64 384 \$ ou 2,8 % au 31 mars 2018). En pratique, les résultats réels de négociation peuvent différer et l'écart pourrait être important.

iv. Autre risque de prix

Pour ce fonds, le risque le plus important découlant du risque de prix provient de son placement direct dans des fonds/billets négociés en bourse et des contrats à terme standardisés, et indirectement des placements des fonds sous-jacents dans des titres de participation, des fonds/billets négociés en bourse et des fonds communs de placement. Au 30 septembre 2018, si les cours des Bourses où se négocient ces titres avaient augmenté ou diminué de 10 %, toute autre variable demeurant constante, l'actif net aurait augmenté ou diminué d'environ 106 985 \$ ou 4,6 % du total de l'actif net (123 710 \$ ou 5,4 % au 31 mars 2018). En pratique, les résultats réels de négociation peuvent différer et l'écart pourrait être important.

v. Risque de crédit

Pour ce Fonds, la plus forte concentration indirecte du risque de crédit se trouve dans les titres de créance, tels que les obligations, détenus par les fonds sous-jacents. La juste valeur des titres de créance tient compte de la solvabilité de l'émetteur de ces titres. Pour de plus amples renseignements au sujet du risque de crédit des fonds sous-jacents, veuillez vous reporter aux états financiers des fonds sous-jacents, disponibles sur le site Web de SEDAR à l'adresse www.sedar.com ou à l'adresse www.placementsmackenzie.com.



PORTEFEUILLE ÉQUILIBRÉ SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

PORTEFEUILLE DE GESTION DE L'ACTIF

NOTES ANNEXES

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

i) Classement de la juste valeur

Le tableau ci-après résume la juste valeur des instruments financiers du Fonds selon la hiérarchie de la juste valeur 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 (\$)
Fonds/billets négociés en bourse	25 789	–	–	25 789	14 476	–	–	14 476
Fonds communs de placement	2 037 083	–	–	2 037 083	2 000 250	–	–	2 000 250
Actifs dérivés	1 907	14 493	–	16 400	1 429	22 912	–	24 341
Passifs dérivés	(1 287)	(9 589)	–	(10 876)	(2 186)	(24 652)	–	(26 838)
Placements à court terme	105 455	133 550	–	239 005	92 704	163 161	–	255 865
Total	2 168 947	138 454	–	2 307 401	2 106 673	161 421	–	2 268 094

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

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

Les instruments financiers classés au niveau 2 sont évalués en incorporant des données de marché observables et en ayant recours à des pratiques standards sur les marchés. Les placements à court terme classés au niveau 2 sont évalués en fonction du coût amorti, majoré des intérêts courus, ce qui se rapproche de la juste valeur.



MACKENZIE
Placements