

États financiers intermédiaires non audités

Pour la période du 27 avril 2018 au 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.



FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

ÉTAT DE LA SITUATION FINANCIÈRE

En milliers (sauf les montants par titre)

Au

	30 sept. 2018 \$		30 sept. 2018 \$
ACTIF		Actif net attribuable aux porteurs de titres, par titre (note 3)	
Actifs courants			
Placements à la juste valeur	188 846	Série A	9,96
Trésorerie et équivalents de trésorerie	177 643	Série F	10,00
Intérêts courus à recevoir	15	Série FB	10,00
Dividendes à recevoir	297	Série O	10,05
Sommes à recevoir pour placements vendus	357	Série PW	9,96
Sommes à recevoir pour titres émis	455	Série PWFB	10,01
Couverture sur contrats à terme standardisés	5 333	Série PWX	10,05
Profits latents sur les contrats dérivés	3 698	Série R	9,97
Total de l'actif	376 644		
PASSIF			
Passifs courants			
Placements vendus à découvert, à la juste valeur	94 727		
Sommes à payer pour placements achetés	2 656		
Sommes à payer pour titres rachetés	-		
Intérêts à payer sur les titres vendus à découvert	65		
Dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	213		
Pertes latentes sur les contrats dérivés	1 818		
Total du passif	99 479		
Actif net attribuable aux porteurs de titres	277 165		
Actif net attribuable aux porteurs de titres, par série (note 3)			
Série A	1 037		
Série F	20 328		
Série FB	1		
Série O	51		
Série PW	998		
Série PWFB	1		
Série PWX	1		
Série R	254 748		

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

ÉTAT DU RÉSULTAT GLOBAL

Pour la période close le 30 septembre (note 1)
En milliers (sauf les montants par titre)

	2018 \$		2018 \$
Revenus (note 9e))		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, par titre	
Dividendes	1 153	Série A	0,01
Revenu d'intérêts	476	Série F	0,02
Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets		Série FB	–
Profit (perte) net(te) réalisé(e)	(1 965)	Série O	0,35
Profit (perte) net(te) latent(e)	1 892	Série PW	(0,04)
Total des revenus (pertes)	1 556	Série PWFB	0,06
		Série PWX	0,05
		Série R	0,05
Charges (note 6)			
Frais de gestion	47		
Frais d'administration	6		
Intérêts débiteurs	12		
Frais d'emprunt	125		
Commissions et autres coûts de transaction liés au portefeuille	230		
Frais du Comité d'examen indépendant	–		
Charges avant les montants absorbés par le gestionnaire	420		
Charges absorbées par le gestionnaire	–		
Charges nettes	420		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, avant impôt	1 136		
Impôt étranger retenu à la source	205		
Impôt étranger sur le résultat payé (recouvré)	–		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation	931		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, par série			
Série A	–		
Série F	19		
Série FB	–		
Série O	–		
Série PW	(2)		
Série PWFB	–		
Série PWX	–		
Série R	914		

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

ÉTAT DE L'ÉVOLUTION DE LA SITUATION FINANCIÈRE

Pour la période close le 30 septembre (note 1)
En milliers

	2018 Série A	2018 Série F	2018 Série FB	2018 Série O	2018 Série PW
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES	\$	\$	\$	\$	\$
À l'ouverture	-	-	-	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	-	19	-	-	(2)
Distributions aux porteurs de titres :					
Revenu de placement	-	-	-	-	-
Gains en capital	-	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de titres	-	-	-	-	-
Opérations sur les titres :					
Produit de l'émission de titres	1 980	20 719	1	51	1 352
Réinvestissement des distributions	-	-	-	-	-
Paiements au rachat de titres	(943)	(410)	-	-	(352)
Total des opérations sur les titres	1 037	20 309	1	51	1 000
Augmentation (diminution) totale de l'actif net	1 037	20 328	1	51	998
À la clôture	1 037	20 328	1	51	998

Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) :	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres
Titres en circulation, à l'ouverture	-	-	-	-	-
Émis	198	2 073	-	5	135
Réinvestissement des distributions	-	-	-	-	-
Rachetés	(94)	(41)	-	-	(35)
Titres en circulation, à la clôture	104	2 032	-	5	100

	Série PWFB	Série PWX	Série R	Total
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES	\$	\$	\$	\$
À l'ouverture	-	-	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	-	-	914	931
Distributions aux porteurs de titres :				
Revenu de placement	-	-	-	-
Gains en capital	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de titres	-	-	-	-
Opérations sur les titres :				
Produit de l'émission de titres	132	1	260 380	284 616
Réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Paiements au rachat de titres	(131)	-	(6 546)	(8 382)
Total des opérations sur les titres	1	1	253 834	276 234
Augmentation (diminution) totale de l'actif net	1	1	254 748	277 165
À la clôture	1	1	254 748	277 165

Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) :	Titres	Titres	Titres
Titres en circulation, à l'ouverture	-	-	-
Émis	13	-	26 215
Réinvestissement des distributions	-	-	-
Rachetés	(13)	-	(658)
Titres en circulation, à la clôture	-	-	25 557

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

TABLEAU DES FLUX DE TRÉSORERIE

Pour la période close le 30 septembre (note 1)
En milliers

	2018 \$
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	931
Ajustements pour :	
Perte (profit) net(te) réalisé(e) sur les placements	304
Variation de la perte (du profit) net(te) latent(e) sur les placements	(1 892)
Achat de placements	(276 231)
Produit de la vente et de l'échéance de placements	184 205
Variation des intérêts courus à recevoir	(15)
Variation des dividendes à recevoir	(297)
Variation des intérêts à payer sur les titres vendus à découvert	65
Variation des dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	213
Variation de la couverture sur contrats à terme standardisés	(5 333)
Trésorerie nette liée aux activités d'exploitation	(98 050)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	
Produit de l'émission de titres	283 378
Paiements au rachat de titres	(7 599)
Distributions versées, déduction faite des réinvestissements	—
Trésorerie nette liée aux activités de financement	275 779
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie	177 729
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à l'ouverture	—
Incidence des fluctuations des taux de change sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie	(86)
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture	177 643
Trésorerie	84 613
Équivalents de trésorerie	93 030
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture	177 643
Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :	
Dividendes reçus	1 257
Dividendes versés	188
Impôts étrangers payés	205
Intérêts reçus	522
Intérêts versés	8

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

TABLEAU DES PLACEMENTS

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
PORTEFEUILLE ACHETEUR					
OBLIGATIONS					
Cincinnati Bell Inc. 7,00 % 15-07-2024, rachetables 2019 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	250 000 USD	298	299
DISH DBS Corp. 5,875 % 15-11-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	250 000 USD	269	290
Vale Overseas Ltd. 6,25 % 10-08-2026	Brésil	Sociétés – Non convertibles	250 000 USD	354	354
Total des obligations				921	943
ACTIONS					
ABIOMED Inc.	États-Unis	Soins de santé	688	342	400
Acorda Therapeutics Inc.	États-Unis	Soins de santé	9 050	286	230
Adobe Systems Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	350	118	122
AECI Ltd.	Afrique du Sud	Matières	12 750	138	122
Aegon NV	Pays-Bas	Services financiers	20 350	167	171
AerCap Holdings NV	Irlande	Produits industriels	721	48	54
AG Mortgage Investment Trust Inc.	États-Unis	Services financiers	5 050	127	119
Ageas	Belgique	Services financiers	350	24	24
Akamai Technologies Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	6 500	628	614
Align Technology Inc.	États-Unis	Soins de santé	50	24	25
Alliance Data Systems Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	1 039	288	317
Allison Transmission Holdings Inc.	États-Unis	Produits industriels	10 028	581	674
Alphabet Inc., cat. A	États-Unis	Technologie de l'information	200	310	312
Alphabet Inc., cat. C	États-Unis	Technologie de l'information	200	306	308
Altair Engineering Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	9 250	435	519
Alteryx Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	1 550	124	115
Amadeus IT Group SA	Espagne	Technologie de l'information	6 515	741	782
Amazon.com Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	200	462	518
Ambac Financial Group Inc.	États-Unis	Services financiers	1 000	27	26
AMC Entertainment Holdings Inc., cat. A	États-Unis	Consommation discrétionnaire	5 400	121	143
American Eagle Outfitters Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	14 350	456	460
American National Insurance Co.	États-Unis	Services financiers	2 850	464	476
American Railcar Industries Inc.	États-Unis	Produits industriels	3 450	185	206
AnaptysBio Inc.	États-Unis	Soins de santé	1 100	112	142
ANGI Homeservices Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	5 700	118	173
Anritsu Corp.	Japon	Technologie de l'information	13 400	281	285
Anthem Inc.	États-Unis	Soins de santé	1 800	621	637
Applied Materials Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	3 003	207	150
Arbor Realty Trust Inc.	États-Unis	Services financiers	23 226	289	345
ArcelorMittal SA	Luxembourg	Matières	600	26	24
Arch Coal Inc., cat. A	États-Unis	Énergie	1 000	109	116
Arista Networks Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	50	18	17
ARMOUR Residential REIT Inc.	États-Unis	Services financiers	11 450	347	332
Artis Real Estate Investment Trust	Canada	Immobilier	13 700	185	161
Asahi Kasei Corp.	Japon	Matières	1 300	23	25
Ascendas Real Estate Investment Trust	Singapour	Immobilier	151 600	394	378
Ashtead Group PLC	Royaume-Uni	Produits industriels	14 000	576	575
ASML Holding NV	Pays-Bas	Technologie de l'information	100	27	24
Astellas Pharma Inc.	Japon	Soins de santé	15 000	300	338
Astral Foods Ltd.	Afrique du Sud	Consommation courante	12 450	354	280
Athabasca Oil Corp.	Canada	Énergie	84 800	138	135



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
ACTIONS (suite)					
Atlas Air Worldwide Holdings Inc.	États-Unis	Produits industriels	100	9	8
AXA SA	France	Services financiers	700	23	24
Banco Santander SA	Espagne	Services financiers	18 250	129	119
Barratt Developments PLC	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	67 100	605	641
BBX Capital Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	750	9	7
Beach Petroleum Ltd.	Australie	Énergie	124 300	204	248
Beiersdorf AG	Allemagne	Consommation courante	2 214	339	323
BJ's Restaurants Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	200	18	19
BlackRock Inc.	États-Unis	Services financiers	50	35	30
Bluegreen Vacations Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	4 500	130	104
The Boeing Co.	États-Unis	Produits industriels	400	185	192
Boise Cascade Co.	États-Unis	Matières	2 100	121	100
Boliden AB	Suède	Matières	170	8	6
Boot Barn Holdings Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	9 150	276	336
The Boston Beer Co. Inc.	États-Unis	Consommation courante	1 200	423	446
Brighthouse Financial Inc.	États-Unis	Services financiers	4 524	278	259
Bristow Group Inc.	États-Unis	Énergie	26 900	460	422
Brookfield Business Partners L.P.	Canada	Produits industriels	150	8	9
Brush Engineered Materials Inc.	États-Unis	Matières	1 950	151	152
Burberry Group PLC	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	16 050	614	545
Cal-Maine Foods Inc.	États-Unis	Consommation courante	2 400	147	150
Cambium Learning Group Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	7 200	120	110
Banque Canadienne Impériale de Commerce	Canada	Services financiers	950	110	115
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée	Canada	Produits industriels	50	12	14
La Société Canadian Tire Ltée, cat. A, sans droit de vote	Canada	Consommation discrétionnaire	150	25	23
Canfor Pulp Products Inc.	Canada	Matières	17 300	436	423
Cardinal Energy Ltd.	Canada	Énergie	22 800	123	122
Cardinal Health Inc.	États-Unis	Soins de santé	3 816	257	266
Career Education Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	16 150	379	312
Carnival PLC	États-Unis	Consommation discrétionnaire	7 815	624	627
Cascades Inc.	Canada	Matières	9 150	114	115
CBIZ Inc.	États-Unis	Produits industriels	14 700	411	450
CBL & Associates Properties Inc.	États-Unis	Immobilier	203 000	1 216	1 047
Celanese Corp., série A	États-Unis	Matières	20	3	3
Cerus Corp.	États-Unis	Soins de santé	16 500	162	154
Groupe CGI inc., cat. A, à droit de vote subalterne	Canada	Technologie de l'information	3 298	259	275
The Chefs' Warehouse Inc.	États-Unis	Consommation courante	3 550	137	167
Chemed Corp.	États-Unis	Soins de santé	1 150	480	475
Chimera Investment Corp.	États-Unis	Services financiers	1 000	24	23
China Shenhua Energy Co. Ltd., H	Chine	Énergie	200 000	575	590
Cigna Corp.	États-Unis	Soins de santé	1 439	333	387
Cisco Systems Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	2 325	131	146
Clearway Energy Inc., cat. A	États-Unis	Services publics	18 000	446	443
Clearway Energy Inc., cat. C	États-Unis	Services publics	17 800	430	443
Coca-Cola FEMSA SAB de CV	Mexique	Consommation courante	54 100	426	427
Colony NorthStar Inc., cat. A	États-Unis	Immobilier	74 800	600	589
Colruyt SA	Belgique	Consommation courante	1 500	110	110
Fonds de placement immobilier Cominar	Canada	Immobilier	2 000	24	23
Comtech Telecommunications Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	2 600	109	122



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
ACTIONS (suite)					
ConAgra Brands Inc.	États-Unis	Consommation courante	6 974	343	306
Concert Pharmaceuticals Inc.	États-Unis	Soins de santé	10 750	231	206
Conduent Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	5 500	137	160
ConMed Corp.	États-Unis	Soins de santé	1 150	116	118
Continental Resources Inc.	États-Unis	Énergie	2 922	245	258
CoreCivic Inc.	États-Unis	Immobilier	650	21	20
Corning Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	12 000	552	547
CoStar Group Inc.	États-Unis	Produits industriels	50	26	27
Covestro AG	Allemagne	Matières	5 055	597	530
CRA International Inc.	États-Unis	Produits industriels	2 250	162	146
Crocs Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	7 200	161	198
Crown Ltd.	Australie	Consommation discrétionnaire	43 000	584	550
CURO Group Holdings Corp.	États-Unis	Services financiers	13 300	473	520
CVS Health Corp.	États-Unis	Soins de santé	3 030	257	308
Dainippon Pharmaceutical Co. Ltd.	Japon	Soins de santé	5 500	141	163
Dassault Systèmes SA	France	Technologie de l'information	2 980	558	576
DBS Group Holdings Ltd.	Singapour	Services financiers	1 000	28	25
Deutsche Lufthansa AG, nom.	Allemagne	Produits industriels	7 305	267	232
DMC Global Inc.	États-Unis	Produits industriels	4 750	295	250
Dorian LPG Ltd.	États-Unis	Énergie	11 050	102	114
Fiducie de placement immobilier de bureaux Dream	Canada	Immobilier	250	6	6
Drive Shack Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	15 000	121	116
E.ON SE	Allemagne	Services publics	13 000	184	171
Echo Global Logistics Inc.	États-Unis	Produits industriels	2 600	115	104
EDF SA (Électricité de France)	France	Services publics	51 100	1 003	1 160
Electro Scientific Industries Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	5 200	135	117
Enanta Pharmaceuticals Inc.	États-Unis	Soins de santé	1 000	126	110
Ence Energía y Celulosa SA	Espagne	Matières	9 700	121	127
Les Systèmes Enghouse Ltée	Canada	Technologie de l'information	4 981	372	409
ENGIE SA	France	Services publics	1 250	26	24
EnPro Industries Inc.	États-Unis	Produits industriels	4 900	466	462
EnSCO PLC, cat. A	États-Unis	Énergie	22 550	216	246
ERA Group Inc.	États-Unis	Énergie	7 450	125	119
Essent Group Ltd.	États-Unis	Services financiers	5 203	247	298
Evercore Partners Inc., cat. A	États-Unis	Services financiers	2 615	375	340
EVRAZ PLC	Russie	Matières	59 536	510	568
Exantas Capital Corp.	États-Unis	Services financiers	48 650	727	690
Exelon Corp.	États-Unis	Services publics	6 531	349	368
F5 Networks Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	690	155	178
Fairfax Financial Holdings Ltd., à droit de vote subalterne	Canada	Services financiers	50	36	35
Fast Retailing Co. Ltd.	Japon	Consommation discrétionnaire	1 000	570	659
Faurecia	France	Consommation discrétionnaire	2 328	254	181
Ford Motor Co.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	39 883	554	477
Fortum OYJ	Finlande	Services publics	22 409	716	726
Fraser & Neave Holdings Bhd	Malaisie	Consommation courante	9 700	116	114
Fresh Del Monte Produce Inc.	États-Unis	Consommation courante	2 350	136	103
Freshpet Inc.	États-Unis	Consommation courante	10 400	495	493
FUJIFILM Holdings Corp.	Japon	Technologie de l'information	5 100	256	297
Fujiya Co. Ltd.	Japon	Consommation courante	6 700	206	195



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
ACTIONS (suite)					
Games Workshop Group PLC	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	4 200	234	268
Genco Shipping & Trading Ltd.	États-Unis	Produits industriels	7 950	185	144
Genesco Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	6 750	364	411
Gentex Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	450	14	12
The GEO Group Inc.	États-Unis	Immobilier	1 100	35	36
GlaxoSmithKline PLC	Royaume-Uni	Soins de santé	13 283	354	344
Glu Mobile Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	1 550	12	15
GN Store Nord AS (GN Great Nordic)	Danemark	Soins de santé	400	24	25
Graham Holdings Co.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	50	38	37
Gran Tierra Energy Inc.	Canada	Énergie	27 350	116	135
Gulf Keystone Petroleum Ltd.	Royaume-Uni	Énergie	28 200	126	137
H. Lundbeck AS	Danemark	Soins de santé	1 552	135	124
Hakuhodo DY Holdings Inc.	Japon	Consommation discrétionnaire	30 600	625	694
Halma PLC	Royaume-Uni	Technologie de l'information	15 108	379	368
Hamamatsu Photonics K.K.	Japon	Technologie de l'information	200	11	10
Hartalega Holdings Bhd	Malaisie	Soins de santé	6 200	13	13
Haynes International Inc.	États-Unis	Matières	2 450	128	112
Heidrick & Struggles International Inc.	États-Unis	Produits industriels	5 750	270	252
Hermès International	France	Consommation discrétionnaire	550	475	471
Hersha Hospitality Trust	États-Unis	Immobilier	21 500	606	630
Hertz Global Holdings Inc.	États-Unis	Produits industriels	6 300	130	133
Hewlett Packard Enterprise Co.	États-Unis	Technologie de l'information	6 800	139	143
Hexagon AB, B	Suède	Technologie de l'information	5 660	433	429
HIOKI E.E. Corp.	Japon	Technologie de l'information	2 700	138	114
Hitachi Ltd.	Japon	Technologie de l'information	400	19	18
HMS Holdings Corp.	États-Unis	Soins de santé	10 088	282	428
HollyFrontier Corp.	États-Unis	Énergie	1 800	172	163
Hongkong Land Holdings Ltd.	Hong Kong	Immobilier	50 800	472	435
Hostess Brands Inc.	États-Unis	Consommation courante	7 250	137	104
Hoya Corp.	Japon	Soins de santé	7 800	597	599
Humana Inc.	États-Unis	Soins de santé	1 114	427	487
Huntington Ingalls Industries Inc.	États-Unis	Produits industriels	10	3	3
Huntsman Corp.	États-Unis	Matières	8 081	344	284
IAMGOLD Corp.	Canada	Matières	23 150	166	110
ICF International Inc.	États-Unis	Produits industriels	1 550	137	151
Ichor Holdings Ltd.	États-Unis	Technologie de l'information	315	10	8
ICU Medical Inc.	États-Unis	Soins de santé	450	168	164
Infineon Technologies AG	Allemagne	Technologie de l'information	9 188	345	270
Inter Parfums Inc.	États-Unis	Consommation courante	2 700	223	225
International Seaways Inc.	États-Unis	Énergie	4 750	127	123
InterRent Real Estate Investment Trust	Canada	Immobilier	43 350	470	509
Intuitive Surgical Inc.	États-Unis	Soins de santé	50	32	37
Invesco Mortgage Capital Inc.	États-Unis	Services financiers	8 800	185	180
Investec Ltd.	Afrique du Sud	Services financiers	2 700	26	25
Iridium Communications Inc.	États-Unis	Services de télécommunications	19 000	386	552
J Sainsbury PLC	Royaume-Uni	Consommation courante	71 950	401	390
Japan Petroleum Exploration Co. Ltd.	Japon	Énergie	17 000	533	504
Japan Post Bank Co. Ltd.	Japon	Services financiers	1 400	23	21
Japan Post Holdings Co. Ltd.	Japon	Services financiers	1 600	24	25



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
ACTIONS (suite)					
JD Sports Fashion PLC	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	75 400	608	583
JetBlue Airways Corp.	États-Unis	Produits industriels	6 550	162	164
John Laing Group PLC	Royaume-Uni	Produits industriels	23 400	114	123
JXTG Holdings Inc.	Japon	Énergie	2 500	21	24
Kao Corp.	Japon	Consommation courante	2 600	259	271
KBR Inc.	États-Unis	Produits industriels	4 350	105	119
KDDI Corp.	Japon	Services de télécommunications	3 800	132	136
KEMET Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	6 400	167	153
Kering	France	Consommation discrétionnaire	702	505	486
Kforce Inc.	États-Unis	Produits industriels	150	7	7
Kinnevik AB	Suède	Services financiers	600	27	23
KLA-Tencor Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	1 425	210	187
Kobe Steel Ltd.	Japon	Matières	22 600	283	260
Kohl's Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	3 065	259	295
Koninklijke Ahold Delhaize NV	Pays-Bas	Consommation courante	23 219	733	688
Koninklijke DSM NV	Pays-Bas	Matières	3 707	496	507
Kose Corp.	Japon	Consommation courante	1 000	272	246
Learning Technologies Group PLC	Royaume-Uni	Technologie de l'information	73 150	129	205
Lennar Corp., cat. A	États-Unis	Consommation discrétionnaire	8 000	539	483
Lennar Corp., cat. B	États-Unis	Consommation discrétionnaire	2 468	133	123
Liberty Expedia Holdings Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	4 847	270	295
Ligand Pharmaceutical Inc., cat. B	États-Unis	Soins de santé	62	16	22
Lloyds Banking Group PLC	Royaume-Uni	Services financiers	21 100	23	21
Logitech International SA, nom.	Suisse	Technologie de l'information	4 423	234	255
Loral Space & Communications Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	2 150	111	126
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	France	Consommation discrétionnaire	1 261	570	576
LyondellBasell Industries NV, cat. A	États-Unis	Matières	1 508	223	200
Macy's Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	10 152	495	456
The Madison Square Garden Co., cat. A	États-Unis	Consommation discrétionnaire	450	154	183
Mallinckrodt PLC	États-Unis	Soins de santé	558	15	21
ManTech International Corp., A	États-Unis	Technologie de l'information	2 600	181	213
Marathon Oil Corp.	États-Unis	Énergie	5 300	142	159
Martinrea International Inc.	Canada	Consommation discrétionnaire	8 550	121	113
Marubeni Corp.	Japon	Produits industriels	2 200	23	26
Matrix Service Co.	États-Unis	Énergie	6 650	161	212
Matson Inc.	États-Unis	Produits industriels	3 600	168	184
McGrath RentCorp	États-Unis	Produits industriels	6 300	505	443
McKesson Corp.	États-Unis	Soins de santé	697	128	119
Mercer International Inc.	Canada	Matières	18 000	412	391
MERLIN Properties SOCIMI SA	Espagne	Immobilier	850	16	15
Metcash Ltd.	Australie	Consommation courante	45 850	124	128
MGM Growth Properties LLC, A	États-Unis	Immobilier	550	23	21
Mitsubishi Corp.	Japon	Produits industriels	7 000	257	279
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc.	Japon	Services financiers	14 700	119	119
Mitsui & Co. Ltd.	Japon	Produits industriels	1 100	26	25
Mizuho Financial Group Inc.	Japon	Services financiers	10 800	25	24
Mondi Ltd.	Afrique du Sud	Matières	7 500	278	266
Mondi PLC	Afrique du Sud	Matières	399	15	14
Movado Group Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	2 300	122	125



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
ACTIONS (suite)					
Murata Manufacturing Co. Ltd.	Japon	Technologie de l'information	2 800	582	556
National Western Life Group Inc.	États-Unis	Services financiers	300	124	124
Navigant Consulting Inc.	États-Unis	Produits industriels	10 100	284	301
Neste Oil OYJ	Finlande	Énergie	1 500	165	160
Nestlé SA, nom.	Suisse	Consommation courante	250	25	27
NetApp Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	3 461	344	384
Netflix Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	350	159	169
New Media Investment Group Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	11 950	274	242
New Residential Investment Corp.	États-Unis	Services financiers	12 900	303	297
New York REIT Inc.	États-Unis	Immobilier	1 050	25	25
News Corp., cat. A	États-Unis	Consommation discrétionnaire	38 050	733	649
Next PLC	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	6 476	626	599
Nikon Corp.	Japon	Consommation discrétionnaire	1 400	35	34
Nine Entertainment Co. Holdings Ltd.	Australie	Consommation discrétionnaire	4 100	9	9
Nissan Motor Co. Ltd.	Japon	Consommation discrétionnaire	14 900	197	180
NN Group NV	Pays-Bas	Services financiers	3 150	180	182
Noble Corporation PLC	États-Unis	Énergie	61 850	472	562
Nolato AB, cat. B	Suède	Produits industriels	1 500	166	119
Noritsu Koki Co. Ltd.	Japon	Consommation discrétionnaire	6 100	150	219
Northview Apartment Real Estate Investment Trust	Canada	Immobilier	5 850	157	150
Northwest Natural Gas Co.	États-Unis	Services publics	3 350	273	290
Novartis AG, nom.	Suisse	Soins de santé	250	24	28
NTT DoCoMo Inc.	Japon	Services de télécommunications	16 000	559	556
OBIC Co. Ltd.	Japon	Technologie de l'information	1 100	120	135
Old Republic International Corp.	États-Unis	Services financiers	350	9	10
On Deck Capital Inc.	États-Unis	Services financiers	27 895	259	273
ON Semiconductor Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	500	16	12
Oppenheimer Holdings Inc., cat. A, sans droit de vote	États-Unis	Services financiers	11 450	443	468
ORIX Corp.	Japon	Services financiers	28 000	580	587
Orthofix International NV	États-Unis	Soins de santé	1 650	124	123
Overseas Shipholding Group Inc., cat. A	États-Unis	Énergie	47 050	211	192
Owens Corning Inc.	États-Unis	Produits industriels	90	7	6
Owens-Illinois Inc.	États-Unis	Matières	800	20	19
Paradox Interactive AB	Suède	Technologie de l'information	11 623	347	262
Partners Group Holding AG	Suisse	Services financiers	10	9	10
PBF Energy Inc.	États-Unis	Énergie	430	29	28
PDL BioPharma Inc.	États-Unis	Soins de santé	40 050	137	136
Peabody Energy Corp.	États-Unis	Énergie	380	21	18
Pearson PLC	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	37 700	587	565
Perficient Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	8 400	288	289
Persimmon PLC	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	2 668	128	106
Petronas Chemicals Group BHD	Malaisie	Matières	2 800	8	8
PHH Corp.	États-Unis	Services financiers	1 750	24	25
Phillips 66	États-Unis	Énergie	2 325	348	339
Pola Orbis Holdings Inc.	Japon	Consommation courante	2 400	143	113
PPB Group BHD	Malaisie	Consommation courante	53 220	282	279
The Progressive Corp.	États-Unis	Services financiers	4 206	347	386
Providence Service Corp.	États-Unis	Soins de santé	2 100	200	183
PSA Peugeot Citroën	France	Consommation discrétionnaire	985	30	34



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
ACTIONS (suite)					
QAD Inc., cat. A	États-Unis	Technologie de l'information	2 100	127	154
QuinStreet Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	24 800	461	435
Radware Ltd.	Israël	Technologie de l'information	13 650	475	467
Rayonier Advanced Materials Inc.	États-Unis	Matières	17 800	435	424
Regis Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	5 000	115	132
Renewable Energy Group Inc.	États-Unis	Énergie	5 000	115	186
Repsol SA	Espagne	Énergie	1 032	25	27
Produits forestiers Résolu Inc.	États-Unis	Matières	32 850	477	550
Resona Holdings Inc.	Japon	Services financiers	2 300	17	17
Retail Value Inc.	États-Unis	Immobilier	2 750	121	116
Robert Half International Inc.	États-Unis	Produits industriels	2 998	250	273
Rogers Communications Inc., cat. B, sans droit de vote	Canada	Services de télécommunications	6 277	422	417
RWE AG	Allemagne	Services publics	400	13	13
Sandvik AB	Suède	Produits industriels	15 000	350	344
Santander Consumer USA Holdings Inc.	États-Unis	Services financiers	350	8	9
SEACOR Holdings Inc.	États-Unis	Énergie	4 150	285	265
SEACOR Marine Holdings Inc.	États-Unis	Énergie	6 350	199	186
Seagate Technology	États-Unis	Technologie de l'information	9 951	702	609
Ship Finance International Ltd.	Norvège	Énergie	6 750	125	121
Shiseido Co. Ltd.	Japon	Consommation courante	1 300	122	130
Showa Denko K. K.	Japon	Matières	400	25	29
SimCorp AS	Danemark	Technologie de l'information	200	23	22
SKF AB, B	Suède	Produits industriels	990	25	25
Skyworks Solutions Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	4 916	607	576
Snap-On Inc.	États-Unis	Produits industriels	70	13	17
SoftBank Group Corp.	Japon	Services de télécommunications	4 000	510	522
Softcat PLC	Royaume-Uni	Technologie de l'information	10 500	142	141
Sojitz Corp.	Japon	Produits industriels	85 300	397	398
Sony Corp., CAAE	Japon	Consommation discrétionnaire	260	19	20
Sony Corp.	Japon	Consommation discrétionnaire	8 300	549	658
South32 Ltd.	Australie	Matières	34 913	128	128
Speedway Motorsports Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	6 050	142	140
Spok Holdings Inc.	États-Unis	Services de télécommunications	23 150	444	461
St. Barbara Ltd.	Australie	Matières	33 300	150	109
Starwood Property Trust Inc.	États-Unis	Services financiers	6 500	184	181
Steel Dynamics, Inc.	États-Unis	Matières	2 100	120	123
STMicroelectronics NV	Suisse	Technologie de l'information	9 424	288	222
Stoneridge Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	4 050	175	156
Sumitomo Corp.	Japon	Produits industriels	1 100	24	24
Sumitomo Mitsui Construction Co. Ltd.	Japon	Produits industriels	14 100	144	123
Summerset Group Holdings Ltd.	Nouvelle-Zélande	Soins de santé	22 050	152	148
SunCoke Energy Inc.	États-Unis	Matières	7 800	129	117
SurModics Inc.	États-Unis	Soins de santé	4 600	362	444
Suzuki Motor Corp.	Japon	Consommation discrétionnaire	3 500	263	259
Svenska Cellulosa AB (SCA), B	Suède	Matières	10 150	148	149
The Swatch Group AG, nom.	Suisse	Consommation discrétionnaire	1 104	127	111
The Swatch Group AG	Suisse	Consommation discrétionnaire	208	130	107
Swedish Match AB	Suède	Consommation courante	8 260	562	546
Swedish Orphan Biovitrum AB	Suède	Soins de santé	150	6	6



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
ACTIONS (suite)					
Synlait Milk Ltd.	Nouvelle-Zélande	Consommation courante	23 500	234	218
Systemax Inc.	États-Unis	Produits industriels	3 050	131	130
Tabula Rasa HealthCare Inc.	États-Unis	Soins de santé	1 600	119	168
Taisho Pharmaceutical Holdings Co. Ltd.	Japon	Soins de santé	900	127	142
Tamarack Valley Energy Ltd.	Canada	Énergie	98 900	464	497
Target Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	1 539	144	175
Taylor Wimpey PLC	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	44 800	141	130
TCF Financial Corp.	États-Unis	Services financiers	200	7	6
TDK Corp.	Japon	Technologie de l'information	4 600	590	648
Team Inc.	États-Unis	Produits industriels	4 550	129	132
TechTarget Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	7 050	257	177
Telaria Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	26 350	138	129
Telefonaktiebolaget LM Ericsson, B	Suède	Technologie de l'information	3 000	35	34
Terex Corp.	États-Unis	Produits industriels	6 088	354	314
Tesco PLC	Royaume-Uni	Consommation courante	109 400	479	442
Third Point Reinsurance Ltd.	Bermudes	Services financiers	550	10	9
Tivity Health Inc.	États-Unis	Soins de santé	2 550	120	106
TOA Corp.	Japon	Produits industriels	4 000	132	114
Tokio Marine Holdings Inc.	Japon	Services financiers	9 500	592	609
Tokyo Electric Power Co. Holdings Inc.	Japon	Services publics	93 300	583	592
Toll Brothers Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	4 908	255	209
Top Glove Corp. BHD	Malaisie	Soins de santé	2 300	8	8
TORC Oil & Gas Ltd.	Canada	Énergie	17 750	133	117
TPG Telecom Ltd.	Australie	Services de télécommunications	70 000	546	558
TransAlta Corp.	Canada	Services publics	63 400	450	461
Transocean Ltd.	États-Unis	Énergie	28 900	481	521
Triple-S Management Corp.	Porto Rico	Soins de santé	6 250	301	153
U.S. Physical Therapy Inc.	États-Unis	Soins de santé	850	109	130
Ultimate Software Group Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	50	19	21
Uniper SE	Allemagne	Services publics	12 300	497	489
United Rentals Inc.	États-Unis	Produits industriels	3 103	620	656
UnitedHealth Group Inc.	États-Unis	Soins de santé	650	215	223
Universal Insurance Holdings Inc.	États-Unis	Services financiers	350	22	22
Universal Logistics Holdings Inc.	États-Unis	Produits industriels	2 550	96	121
UPM-Kymmene OYJ	Finlande	Matières	5 972	281	303
UroGen Pharma Ltd.	Israël	Soins de santé	7 350	438	449
Valener Inc.	Canada	Services publics	12 250	243	234
Valero Energy Corp.	États-Unis	Énergie	2 546	359	374
Valhi Inc.	États-Unis	Matières	21 200	133	62
Verso Corp., cat. A	États-Unis	Matières	700	19	30
Viavi Solutions Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	22 230	285	326
Village Super Market Inc.	États-Unis	Consommation courante	3 250	122	114
Vishay Precision Group Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	6 900	364	333
Vistra Energy Corp.	États-Unis	Services publics	16 300	490	524
Vital KSK Holdings Inc.	Japon	Soins de santé	8 400	113	122
Vodafone Group PLC	Royaume-Uni	Services de télécommunications	147 450	472	408
Vonage Holdings Corp.	États-Unis	Services de télécommunications	25 800	396	472
W.W. Grainger Inc.	États-Unis	Produits industriels	50	22	23
Walgreens Boots Alliance Inc.	États-Unis	Consommation courante	6 879	594	648



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
ACTIONS (suite)					
Walmart de México SAB de CV, série V	Mexique	Consommation courante	53 700	178	212
Warrior Met Coal Inc.	États-Unis	Matières	15 300	518	535
White Mountains Insurance Group Ltd.	États-Unis	Services financiers	100	116	121
William Morrison Supermarkets PLC	Royaume-Uni	Consommation courante	146 000	653	638
Wirecard AG	Allemagne	Technologie de l'information	804	159	225
WPX Energy Inc.	États-Unis	Énergie	350	8	9
Yamana Gold Inc.	Canada	Matières	36 300	129	117
Total des actions				93 645	94 193
FONDS/BILLETS NÉGOCIÉS EN BOURSE					
iShares 0-5 Year High Yield Corporate Bond ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	112 908	6 857	6 870
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	73 466	8 171	8 207
iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	149 605	22 625	22 219
iShares Short-Term Corporate Bond ETF	Fonds indiciels multipays	Fonds/billets négociés en bourse	66 816	4 499	4 475
iShares TIPS Bond ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	77 995	11 374	11 149
PowerShares Senior Loan Portfolio	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	537 189	16 049	16 084
SPDR Barclays Capital High Yield Bond ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	220 754	10 380	10 283
VanEck Vectors Fallen Angel High Yield Bond ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	145 635	5 472	5 473
Vanguard Short-Term Corporate Bond ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	88 622	9 018	8 950
Total des fonds/billets négociés en bourse				94 445	93 710
Total du portefeuille acheteur				189 011	188 846
PORTEFEUILLE VENDEUR					
OBLIGATIONS					
Consolidated Communications Holdings Inc. 6,50 % 01-10-2022, rachetables	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(250 000) USD	(306)	(306)
Delta Air Lines Inc. 4,38 % 19-04-2028, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(250 000) USD	(318)	(312)
DISH Network Corp. 3,38 % 15-08-2026, conv.	États-Unis	Sociétés – Convertibles	(250 000) USD	(289)	(308)
Energizer Gamma Acquisition Inc. 6,38 % 15-07-2026, rachetables 2021 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(250 000) USD	(334)	(334)
FMG Resources (August 2006) Pty. Ltd. 5,13 % 15-05-2024, rachetables 2024 144A	Australie	Sociétés – Non convertibles	(250 000) USD	(319)	(313)
GameStop Corp. 6,75 % 15-03-2021, rachetables 2019 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(250 000) USD	(325)	(332)
Mallinckrodt International Finance SA 5,50 % 15-04-2025, rachetables 2020 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(250 000) USD	(276)	(273)
Mattel Inc. 6,75 % 31-12-2025, rachetables 2020 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(250 000) USD	(314)	(318)
McDermott Escrow 1 Inc. 10,63 % 01-05-2024, rachetables 2021 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(250 000) USD	(348)	(346)
Micron Technology Inc. 5,50 % 01-02-2025, rachetables 2019	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(250 000) USD	(336)	(334)
Micron Technology Inc. 3,00 % 15-11-2043	États-Unis	Sociétés – Convertibles	(10 000) USD	(26)	(20)
Springleaf Finance Corp. 6,88 % 15-03-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(250 000) USD	(324)	(323)
Tesla Inc. 2,38 % 15-03-2022, conv.	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(175 000) USD	(252)	(230)
Tesla Inc. 5,30 % 15-08-2025, rachetables 2020 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(75 000) USD	(85)	(82)
United Continental Holdings Inc. 5,00 % 01-02-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(250 000) USD	(314)	(322)
Total des obligations				(4 166)	(4 153)



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
ACTIONS					
1&1 Drillisch AG	Allemagne	Services de télécommunications	(7 150)	(519)	(449)
51job Inc.	Chine	Produits industriels	(60)	(8)	(6)
A.P. Moller-Mærsk A/S, A	Danemark	Produits industriels	(66)	(119)	(112)
A.P. Moller-Mærsk A/S, B	Danemark	Produits industriels	(79)	(151)	(143)
AA PLC	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	(104 100)	(195)	(170)
AAON Inc.	États-Unis	Produits industriels	(220)	(9)	(11)
Acacia Communications Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(4 266)	(182)	(228)
Acuity Brands Inc.	États-Unis	Produits industriels	(1 350)	(236)	(274)
Acxiom Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	(4 150)	(230)	(265)
Adesto Technologies Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	(56 100)	(404)	(431)
Advanced Micro Devices Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(11 487)	(272)	(459)
Aerie Pharmaceuticals Inc.	États-Unis	Soins de santé	(4 300)	(383)	(342)
AFG Arbonia-Forster Holding AG	Suisse	Produits industriels	(20 000)	(389)	(351)
AGL Energy Ltd.	Australie	Services publics	(17 043)	(358)	(310)
Ain Holdings Inc.	Japon	Consommation courante	(1 200)	(114)	(125)
Albemarle Corp.	États-Unis	Matières	(1 100)	(135)	(142)
Alfa Financial Software Holdings PLC	Royaume-Uni	Technologie de l'information	(140 435)	(388)	(324)
Alimentation Couche-Tard inc., cat. B, à droit de vote subalterne	Canada	Consommation courante	(1 900)	(104)	(123)
Alkermes PLC	États-Unis	Soins de santé	(6 800)	(394)	(373)
Alnylam Pharmaceuticals Inc.	États-Unis	Soins de santé	(2 000)	(260)	(226)
ALS Ltd.	Australie	Produits industriels	(48 350)	(387)	(404)
Altium Ltd.	Australie	Technologie de l'information	(5 250)	(130)	(134)
Ambarella Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(4 215)	(237)	(211)
American Airlines Group Inc.	États-Unis	Produits industriels	(3 800)	(206)	(203)
AmerisourceBergen Corp.	États-Unis	Soins de santé	(1 100)	(119)	(131)
Amphenol Corp., cat. A	États-Unis	Technologie de l'information	(2 950)	(373)	(358)
Amyris Inc.	États-Unis	Énergie	(39 100)	(396)	(401)
Apache Corp.	États-Unis	Énergie	(6 600)	(378)	(407)
Argan Inc.	États-Unis	Produits industriels	(3 653)	(183)	(203)
Aristocrat Leisure Ltd.	Australie	Consommation discrétionnaire	(4 200)	(127)	(112)
Arrow Global Group PLC	Royaume-Uni	Services financiers	(95 000)	(384)	(370)
ASOS PLC	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	(3 800)	(386)	(369)
Associated British Foods PLC	Royaume-Uni	Consommation courante	(10 000)	(379)	(386)
ATCO Ltd., cat. I, sans droit de vote	Canada	Services publics	(4 529)	(176)	(171)
Auto Trader Group PLC	Royaume-Uni	Technologie de l'information	(27 450)	(202)	(206)
Autodesk Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(700)	(122)	(141)
Autoneum Holding AG	Suisse	Consommation discrétionnaire	(1 300)	(381)	(339)
Avid Technology Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(50 000)	(375)	(383)
Avis Budget Group Inc.	États-Unis	Produits industriels	(3 000)	(137)	(125)
Axalta Coating Systems Ltd.	États-Unis	Matières	(3 250)	(135)	(122)
Babcock & Wilcox Enterprises Inc.	États-Unis	Produits industriels	(52 043)	(180)	(69)
Baker Hughes a GE Co.	États-Unis	Énergie	(8 814)	(390)	(385)
Banque de Montréal	Canada	Services financiers	(1 350)	(136)	(144)
Basic Energy Services Inc.	États-Unis	Énergie	(800)	(9)	(10)
BCE Inc.	Canada	Services de télécommunications	(2 550)	(138)	(133)
Belden Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(2 200)	(198)	(203)
Bellamy's Australia Ltd.	Australie	Consommation courante	(43 472)	(445)	(415)
BioCryst Pharmaceuticals Inc.	États-Unis	Soins de santé	(370)	(3)	(4)
BioMarin Pharmaceutical Inc.	États-Unis	Soins de santé	(1 900)	(235)	(238)



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
ACTIONS (suite)					
bioMérieux SA	France	Soins de santé	(1 050)	(114)	(113)
Bitauto Holdings Ltd.	Chine	Technologie de l'information	(110)	(4)	(3)
BlackBerry Ltd.	Canada	Technologie de l'information	(28 000)	(378)	(409)
Blackstone Mortgage Trust Inc.	États-Unis	Services financiers	(300)	(12)	(13)
Blueprint Medicines Corp.	États-Unis	Soins de santé	(4 000)	(341)	(404)
Bombardier Inc., cat. B, à droit de vote subalterne	Canada	Produits industriels	(88 301)	(399)	(406)
Boral Ltd.	Australie	Matières	(17 550)	(110)	(113)
The Brink's Co.	États-Unis	Produits industriels	(3 150)	(326)	(284)
Britvic PLC	Royaume-Uni	Consommation courante	(27 415)	(384)	(361)
Brooks Automation Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(9 700)	(451)	(439)
Cabot Microelectronics Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	(2 516)	(383)	(335)
Caesars Entertainment Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(31 258)	(435)	(414)
Calbee Inc.	Japon	Consommation courante	(3 694)	(173)	(157)
Campbell Soup Co.	États-Unis	Consommation courante	(7 150)	(383)	(338)
Canada Goose Holdings Inc.	Canada	Consommation discrétionnaire	(1 750)	(133)	(146)
Canadian Utilities Ltd., cat. A, sans droit de vote	Canada	Services publics	(5 645)	(177)	(179)
Canon Inc.	Japon	Technologie de l'information	(2 900)	(129)	(119)
CarMax Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(1 200)	(107)	(116)
Carriage Services Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(270)	(9)	(8)
Carter's Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(1 242)	(180)	(158)
Catalent Inc.	États-Unis	Soins de santé	(3 150)	(166)	(185)
CBS Corp., cat. B, sans droit de vote	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(2 900)	(199)	(215)
Celgene Corp.	États-Unis	Soins de santé	(3 300)	(376)	(382)
Cellnex Telecom SA	Espagne	Services de télécommunications	(11 000)	(374)	(373)
CEVA Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(10 200)	(394)	(379)
Challenger Ltd.	Australie	Services financiers	(13 400)	(167)	(140)
Chenerie Energy Inc.	États-Unis	Énergie	(1 550)	(126)	(139)
Chiyoda Corp.	Japon	Produits industriels	(43 400)	(439)	(457)
Cimarex Energy Co.	États-Unis	Énergie	(3 050)	(382)	(366)
Clean Energy Fuels Corp.	États-Unis	Énergie	(112 845)	(392)	(379)
Clean Harbors Inc.	États-Unis	Produits industriels	(1 900)	(129)	(176)
The Clorox Co.	États-Unis	Consommation courante	(800)	(126)	(156)
Clovis Oncology Inc.	États-Unis	Soins de santé	(4 650)	(265)	(176)
Cogent Communications Holdings Inc.	États-Unis	Services de télécommunications	(5 550)	(369)	(400)
Cognex Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	(1 700)	(115)	(123)
Coherent Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(2 400)	(557)	(534)
Coherus BioSciences Inc.	États-Unis	Soins de santé	(440)	(9)	(9)
Commerzbank AG	Allemagne	Services financiers	(12 235)	(176)	(165)
Compagnie générale des établissements Michelin, B	France	Consommation discrétionnaire	(1 007)	(175)	(156)
Consolidated Communications Holdings Inc.	États-Unis	Services de télécommunications	(25 000)	(381)	(421)
Core Laboratories NV	États-Unis	Énergie	(850)	(136)	(127)
CoreSite Realty Corp.	États-Unis	Immobilier	(100)	(14)	(14)
Cornerstone OnDemand Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(2 350)	(149)	(172)
Coty Inc., cat. A	États-Unis	Consommation courante	(9 984)	(171)	(162)
Cray Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(14 386)	(429)	(400)
Credit Suisse Group AG, CAAE	Suisse	Services financiers	(18 020)	(373)	(350)
Crown Holdings Inc.	États-Unis	Matières	(4 300)	(251)	(267)
CytoSorbents Corp.	États-Unis	Soins de santé	(21 000)	(369)	(350)
Deere & Co.	États-Unis	Produits industriels	(750)	(151)	(146)



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
ACTIONS (suite)					
Delivery Hero AG	Allemagne	Technologie de l'information	(5 758)	(397)	(358)
Dermira Inc.	États-Unis	Soins de santé	(280)	(3)	(4)
DexCom Inc.	États-Unis	Soins de santé	(2 172)	(315)	(401)
Dine Brands Global Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(4 000)	(402)	(420)
Discovery Communications Inc., cat A	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(3 700)	(137)	(153)
DISH Network Corp., cat. A	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(8 500)	(345)	(393)
Dollarama inc.	Canada	Consommation discrétionnaire	(16 900)	(762)	(688)
Domino's Pizza Enterprises Ltd.	Australie	Consommation discrétionnaire	(7 800)	(368)	(388)
dorma+kaba Holding AG	Suisse	Produits industriels	(270)	(224)	(263)
Dowa Holdings Co. Ltd.	Japon	Matières	(4 140)	(176)	(170)
Dufry Group, nom.	Suisse	Consommation discrétionnaire	(5 050)	(821)	(736)
Dycom Industries Inc.	États-Unis	Produits industriels	(3 700)	(400)	(405)
Edgewell Personal Care Co.	États-Unis	Consommation courante	(5 800)	(381)	(347)
eHealth Inc.	États-Unis	Services financiers	(10 800)	(395)	(394)
Eiffage SA	France	Produits industriels	(900)	(130)	(130)
Eisai Co. Ltd.	Japon	Soins de santé	(2 000)	(256)	(252)
Electrolux AB, B	Suède	Consommation discrétionnaire	(7 211)	(230)	(205)
Enbridge Inc.	Canada	Énergie	(5 200)	(220)	(217)
Energizer Holdings Inc.	États-Unis	Consommation courante	(1 500)	(117)	(114)
EnerSys	États-Unis	Produits industriels	(1 050)	(109)	(118)
Enstar Group Ltd.	Bermudes	Services financiers	(782)	(219)	(211)
EQT Corp.	États-Unis	Énergie	(140)	(9)	(8)
Equity Commonwealth	États-Unis	Immobilier	(6 200)	(254)	(257)
Equity Lifestyle Properties Inc.	États-Unis	Immobilier	(50)	(6)	(6)
Euronav NV	Belgique	Énergie	(270)	(3)	(3)
Europcar Groupe SA	France	Produits industriels	(5 778)	(77)	(70)
Exact Sciences Corp.	États-Unis	Soins de santé	(4 610)	(456)	(470)
Extreme Networks Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(15 167)	(176)	(107)
Finisar Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	(9 984)	(234)	(246)
Flowserve Corp.	États-Unis	Produits industriels	(5 800)	(327)	(410)
Foot Locker Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(1 900)	(118)	(125)
FP Corp.	Japon	Matières	(3 400)	(259)	(267)
Fresnillo PLC	Mexique	Matières	(28 800)	(509)	(398)
Fugro NV CVA	Pays-Bas	Énergie	(13 314)	(234)	(227)
Furukawa Electric Co. Ltd.	Japon	Produits industriels	(400)	(16)	(17)
GCP Applied Technologies Inc.	États-Unis	Matières	(1 246)	(51)	(43)
GDS Holdings Ltd.	Chine	Technologie de l'information	(9 200)	(372)	(418)
GEA Group AG	Allemagne	Produits industriels	(2 400)	(120)	(110)
GoDaddy Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(1 920)	(178)	(207)
Great Canadian Gaming Corp.	Canada	Consommation discrétionnaire	(2 900)	(139)	(134)
GRENKE AG	Allemagne	Services financiers	(1 600)	(226)	(247)
H.B. Fuller Co.	États-Unis	Matières	(1 950)	(131)	(130)
H.I.S. Co. Ltd.	Japon	Consommation discrétionnaire	(400)	(16)	(17)
Hain Celestial Group Inc.	États-Unis	Consommation courante	(10 350)	(396)	(363)
HCI Group Inc.	États-Unis	Services financiers	(170)	(9)	(10)
Healthcare Realty Trust Inc.	États-Unis	Immobilier	(450)	(16)	(17)
Helvetia Holding AG	Suisse	Services financiers	(500)	(380)	(394)
Hennes & Mauritz AB, B	Suède	Consommation discrétionnaire	(21 300)	(393)	(508)
Heron Therapeutics Inc.	États-Unis	Soins de santé	(2 400)	(121)	(98)



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
ACTIONS (suite)					
Hikma Pharmaceuticals PLC	Jordanie	Soins de santé	(5 700)	(132)	(178)
Hitachi Capital Corp.	Japon	Services financiers	(1 870)	(66)	(67)
The Home Depot Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(900)	(236)	(241)
IDEXX Laboratories Inc.	États-Unis	Soins de santé	(500)	(131)	(161)
II-VI Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(2 200)	(122)	(134)
Iliad SA	France	Services de télécommunications	(3 720)	(759)	(628)
Illinois Tool Works Inc.	États-Unis	Produits industriels	(700)	(132)	(128)
Impinj Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(200)	(5)	(6)
Incyte Corp.	États-Unis	Soins de santé	(4 450)	(375)	(397)
Ingevity Corp.	États-Unis	Matières	(1 350)	(136)	(178)
Inmarsat PLC	Royaume-Uni	Services de télécommunications	(90 300)	(800)	(760)
Interactive Brokers Group Inc.	États-Unis	Services financiers	(3 100)	(247)	(222)
Intercept Pharmaceuticals Inc.	États-Unis	Soins de santé	(2 800)	(339)	(457)
Intra-Cellular Therapies Inc.	États-Unis	Soins de santé	(270)	(8)	(8)
Ionis Pharmaceuticals Inc.	États-Unis	Soins de santé	(7 050)	(411)	(470)
IPG Photonics Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	(1 800)	(398)	(363)
Itron Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(4 550)	(358)	(377)
Jack in the Box Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(3 450)	(375)	(374)
Japan Airport Terminal Co. Ltd.	Japon	Produits industriels	(2 100)	(127)	(124)
Japan Securities Finance Co. Ltd.	Japon	Services financiers	(54 000)	(391)	(418)
Jernigan Capital Inc.	États-Unis	Immobilier	(16 100)	(393)	(401)
JinkoSolar Holding Co. Ltd.	Chine	Technologie de l'information	(140)	(3)	(2)
John Bean Technologies Corp.	États-Unis	Produits industriels	(2 500)	(348)	(385)
John Wood Group PLC	Royaume-Uni	Énergie	(10 300)	(117)	(134)
Just Eat PLC	Royaume-Uni	Technologie de l'information	(16 644)	(234)	(188)
Kazakhmys PLC	République du Kazakhstan	Matières	(1 900)	(18)	(18)
Kellogg Co.	États-Unis	Consommation courante	(1 500)	(125)	(136)
Kennametal Inc.	États-Unis	Produits industriels	(3 000)	(150)	(169)
Kingfisher PLC	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	(35 161)	(180)	(153)
Kion Group AG	Allemagne	Produits industriels	(4 800)	(425)	(381)
Kobe Bussan Co. Ltd.	Japon	Consommation courante	(3 800)	(240)	(279)
Kopin Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	(128 000)	(364)	(400)
The Kraft Heinz Co.	États-Unis	Consommation courante	(2 330)	(175)	(166)
Kratos Defense & Security Solutions Inc.	États-Unis	Produits industriels	(23 600)	(397)	(451)
L Brands Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(9 700)	(416)	(380)
LafargeHolcim Ltd.	Suisse	Matières	(3 884)	(245)	(248)
LANXESS AG	Allemagne	Matières	(1 300)	(134)	(123)
Lar España Real Estate SOCIMI SA	Espagne	Immobilier	(29 900)	(387)	(393)
Lawson Inc.	Japon	Consommation courante	(5 100)	(411)	(401)
LCI Industries	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(1 250)	(146)	(134)
Lehto Group Oyj	Finlande	Produits industriels	(2 292)	(37)	(28)
LendingClub Corp.	États-Unis	Services financiers	(80 000)	(391)	(401)
LendingTree Inc.	États-Unis	Services financiers	(1 250)	(408)	(372)
Lexicon Pharmaceuticals Inc.	États-Unis	Soins de santé	(660)	(10)	(9)
Liberty Broadband Corp., cat. A	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(1 921)	(177)	(209)
Liberty Broadband Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(1 952)	(180)	(213)
Liberty Global PLC, cat. A	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	(10 200)	(374)	(381)
Liberty Media Corp. Liberty Formula One, cat. C	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(8 203)	(349)	(394)
Liberty Media Corp. – Liberty Braves	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(11 500)	(401)	(405)



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
ACTIONS (suite)					
Link Administration Holdings Ltd.	Australie	Technologie de l'information	(34 350)	(250)	(250)
Live Nation Entertainment Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(1 750)	(109)	(123)
LogMeIn Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(3 550)	(384)	(409)
Lowe's Companies Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(900)	(114)	(134)
Lumentum Holdings Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(4 400)	(331)	(341)
Magellan Financial Group Ltd.	Australie	Services financiers	(16 050)	(370)	(415)
Marvell Technology Group Ltd.	Bermudes	Technologie de l'information	(65)	(2)	(2)
Matador Resources Co.	États-Unis	Énergie	(5 550)	(240)	(237)
Mattel Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(8 480)	(175)	(172)
Maxwell Technologies Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(85 000)	(381)	(383)
McCormick & Co. Inc., sans droit de vote	États-Unis	Consommation courante	(1 775)	(246)	(302)
The Medicines Co.	États-Unis	Soins de santé	(7 850)	(371)	(303)
Mediclinic International PLC	Afrique du Sud	Soins de santé	(14 400)	(141)	(104)
Medidata Solutions Inc.	États-Unis	Soins de santé	(1 300)	(127)	(123)
Melco Resorts & Entertainment Ltd., CAAE	Hong Kong	Consommation discrétionnaire	(13 100)	(383)	(358)
Merck KGaA	Allemagne	Soins de santé	(850)	(112)	(113)
Merlin Entertainments PLC	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	(18 100)	(118)	(122)
Micro Focus International PLC	Royaume-Uni	Technologie de l'information	(25 250)	(528)	(608)
MINDBODY Inc., cat. A	États-Unis	Technologie de l'information	(4 659)	(241)	(245)
Miraca Holdings Inc.	Japon	Soins de santé	(6 800)	(254)	(229)
Mitsui Mining & Smelting Co. Ltd.	Japon	Matières	(4 800)	(245)	(180)
Monotaro Co. Ltd.	Japon	Produits industriels	(3 400)	(102)	(124)
Mori Hills REIT Investment Corp.	Japon	Immobilier	(100)	(168)	(164)
Morinaga & Co. Ltd.	Japon	Consommation courante	(300)	(19)	(14)
MS&AD Insurance Group Holdings Inc.	Japon	Services financiers	(3 000)	(121)	(129)
Banque Nationale du Canada	Canada	Services financiers	(1 800)	(114)	(116)
National Beverage Corp.	États-Unis	Consommation courante	(2 600)	(361)	(392)
Navistar International Corp.	États-Unis	Produits industriels	(9 250)	(486)	(460)
NCC AB, actions de cat. B	Suède	Produits industriels	(11 000)	(226)	(252)
NCR Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	(5 900)	(239)	(217)
Nektar Therapeutics	États-Unis	Soins de santé	(1 650)	(108)	(130)
NeoPhotonics Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	(34 834)	(343)	(374)
Neurocrine Biosciences Inc.	États-Unis	Soins de santé	(30)	(4)	(5)
New Oriental Education & Technology Group Inc., CAAE	Chine	Consommation discrétionnaire	(4 000)	(385)	(383)
New York Community Bancorp Inc.	États-Unis	Services financiers	(14 976)	(227)	(201)
Newell Brands Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(5 547)	(174)	(146)
NEXT Co. Ltd.	Japon	Consommation discrétionnaire	(1 400)	(10)	(10)
Nichicon Corp.	Japon	Technologie de l'information	(28 000)	(392)	(357)
Nifco Inc.	Japon	Consommation discrétionnaire	(11 800)	(420)	(410)
Nippon Paint Holdings Co. Ltd.	Japon	Matières	(2 400)	(129)	(116)
Nippon Paper Industries Co. Ltd.	Japon	Matières	(17 500)	(395)	(416)
Nippon Shinyaku Co. Ltd.	Japon	Soins de santé	(3 000)	(220)	(254)
Nitori Holdings Co. Ltd.	Japon	Consommation discrétionnaire	(1 100)	(252)	(204)
NKT Holding AS	Danemark	Produits industriels	(2 296)	(80)	(77)
NN Inc.	États-Unis	Produits industriels	(10 400)	(256)	(210)
NRG Energy Inc.	États-Unis	Services publics	(8 150)	(344)	(394)
Nufarm Ltd.	Australie	Matières	(64 400)	(407)	(403)
Nutanix Inc., cat. A	États-Unis	Technologie de l'information	(3 328)	(227)	(184)
NuVasive Inc.	États-Unis	Soins de santé	(3 200)	(243)	(294)



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
ACTIONS (suite)					
NXP Semiconductors NV	Pays-Bas	Technologie de l'information	(3 100)	(384)	(343)
Omeros Corp.	États-Unis	Soins de santé	(330)	(9)	(10)
OMRON Corp.	Japon	Technologie de l'information	(4 400)	(255)	(240)
Ontex Group NV*	Belgique	Consommation courante	(14 000)	(395)	(385)
ORBCOMM Inc.	États-Unis	Services de télécommunications	(27 000)	(384)	(379)
Osaka Gas Co. Ltd.	Japon	Services publics	(15 700)	(403)	(396)
Osram Licht AG	Allemagne	Produits industriels	(7 600)	(422)	(391)
Panasonic Corp.	Japon	Consommation discrétionnaire	(39 300)	(629)	(592)
Papa John's International Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(6 540)	(396)	(433)
Pattern Energy Group Inc.	États-Unis	Services publics	(9 651)	(235)	(248)
Paylocity Holding Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	(1 750)	(135)	(182)
PDF Solutions Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(32 000)	(372)	(373)
Pegasystems Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(4 700)	(351)	(380)
Pennon Group PLC	Royaume-Uni	Services publics	(10 350)	(138)	(124)
PennyMac Financial Services Inc.	États-Unis	Services financiers	(6 734)	(176)	(182)
Penta-Ocean Construction Co. Ltd.	Japon	Produits industriels	(50 200)	(398)	(432)
Philip Morris International Inc.	États-Unis	Consommation courante	(3 450)	(376)	(364)
Pilgrim's Pride Corp.	États-Unis	Consommation courante	(16 000)	(374)	(374)
Portola Pharmaceuticals Inc.	États-Unis	Soins de santé	(10 500)	(373)	(361)
Post Holdings Inc.	États-Unis	Consommation courante	(1 200)	(120)	(152)
PotlatchDeltic Corp.	États-Unis	Immobilier	(5 350)	(327)	(283)
PPL Corp.	États-Unis	Services publics	(1 861)	(88)	(70)
PrairieSky Royalty Ltd.	Canada	Énergie	(9 700)	(230)	(220)
Premier Investments Ltd.	Australie	Consommation discrétionnaire	(580)	(9)	(10)
PSP Swiss Property AG, nom.	Suisse	Immobilier	(3 000)	(368)	(376)
Puma AG Rudolf Dassler Sport	Allemagne	Consommation discrétionnaire	(600)	(396)	(383)
Ramsay Health Care Ltd.	Australie	Soins de santé	(7 700)	(422)	(395)
Redwood Trust Inc.	États-Unis	Services financiers	(18 091)	(384)	(380)
Relo Holdings Inc.	Japon	Immobilier	(3 800)	(127)	(144)
Renault SA	France	Consommation discrétionnaire	(2 108)	(238)	(236)
Republic Services Inc.	États-Unis	Produits industriels	(4 000)	(395)	(376)
Resorttrust Inc.	Japon	Consommation discrétionnaire	(6 230)	(153)	(133)
Restaurant Brands International Inc.	Canada	Consommation discrétionnaire	(1 550)	(123)	(119)
RH	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(2 400)	(436)	(406)
Fonds de placement immobilier RioCan	Canada	Immobilier	(4 500)	(113)	(111)
Banque Royale du Canada	Canada	Services financiers	(3 800)	(385)	(393)
Ryohin Keikaku Co. Ltd.	Japon	Consommation discrétionnaire	(1 000)	(416)	(385)
Sage Therapeutics Inc.	États-Unis	Soins de santé	(1 940)	(380)	(354)
Sanderson Farms Inc.	États-Unis	Consommation courante	(2 800)	(365)	(374)
SBA Communications Corp., cat. A	États-Unis	Immobilier	(1 900)	(393)	(394)
SCOR SE	France	Services financiers	(2 250)	(112)	(135)
The Scotts Miracle-Gro Co., cat. A	États-Unis	Matières	(3 850)	(402)	(392)
Seattle Genetics Inc.	États-Unis	Soins de santé	(1 550)	(111)	(154)
Semtech Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	(1 800)	(109)	(129)
Senseonics Holdings Inc.	États-Unis	Soins de santé	(73 900)	(375)	(456)
Seria Co. Ltd.	Japon	Consommation discrétionnaire	(6 900)	(395)	(316)
Seven Generations Energy Ltd.	Canada	Énergie	(8 100)	(137)	(125)
Severn Trent PLC	Royaume-Uni	Services publics	(12 250)	(406)	(381)
SGL Carbon SE	Allemagne	Produits industriels	(22 428)	(380)	(317)



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
ACTIONS (suite)					
Shafftesbury PLC	Royaume-Uni	Immobilier	(25 700)	(386)	(392)
Shimamura Co. Ltd.	Japon	Consommation discrétionnaire	(3 000)	(345)	(368)
Shochiku Co. Ltd.	Japon	Consommation discrétionnaire	(100)	(16)	(16)
Shopify Inc.	Canada	Technologie de l'information	(952)	(179)	(202)
Sientra Inc.	États-Unis	Soins de santé	(7 995)	(180)	(247)
Signet Jewelers Ltd.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(3 002)	(256)	(256)
SINA Corp.	Chine	Technologie de l'information	(1 600)	(185)	(144)
Singapore Telecommunications Ltd.	Singapour	Services de télécommunications	(19 377)	(61)	(59)
Smart Metering Systems PLC	Royaume-Uni	Technologie de l'information	(38 320)	(392)	(398)
Sodexo SA	France	Consommation discrétionnaire	(900)	(116)	(123)
Sophos Group PLC	Royaume-Uni	Technologie de l'information	(46 800)	(416)	(385)
Southern Copper Corp.	Pérou	Matières	(5 100)	(314)	(284)
Speedcast International Ltd.	Australie	Services de télécommunications	(100 000)	(372)	(375)
Spire Healthcare Group PLC	Royaume-Uni	Soins de santé	(137 000)	(363)	(329)
Square Inc., cat. A	États-Unis	Technologie de l'information	(4 145)	(348)	(530)
Start Today Co. Ltd.	Japon	Consommation discrétionnaire	(3 400)	(154)	(133)
Stemline Therapeutics Inc.	États-Unis	Soins de santé	(450)	(9)	(10)
Suntory Beverage & Food Ltd.	Japon	Consommation courante	(7 000)	(363)	(383)
SuperGroup PLC	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	(8 261)	(180)	(151)
Syrah Resources Ltd.	Australie	Matières	(55 575)	(173)	(119)
Tabcorp Holdings Ltd.	Australie	Consommation discrétionnaire	(25 550)	(113)	(116)
Taubman Centers Inc.	États-Unis	Immobilier	(1 950)	(136)	(151)
TD Ameritrade Holding Corp.	États-Unis	Services financiers	(5 098)	(378)	(348)
Ted Baker PLC	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	(11 152)	(412)	(435)
TELUS Corp.	Canada	Services de télécommunications	(2 950)	(135)	(140)
Tempur Sealy International Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(8 419)	(531)	(576)
Tenet Healthcare Corp.	États-Unis	Soins de santé	(2 850)	(126)	(105)
Tesla Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(441)	(158)	(151)
TG Therapeutics Inc.	États-Unis	Soins de santé	(55 000)	(363)	(398)
Thomas Cook Group PLC	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	(556 000)	(766)	(542)
The Timken Co.	États-Unis	Produits industriels	(1 850)	(116)	(119)
Toho Co. Ltd.	Japon	Consommation discrétionnaire	(3 839)	(170)	(156)
Toho Gas Co. Ltd.	Japon	Services publics	(4 000)	(188)	(196)
Toray Industries Inc.	Japon	Matières	(41 900)	(399)	(407)
Toridoll Holdings Corp.	Japon	Consommation discrétionnaire	(4 650)	(176)	(131)
La Banque Toronto-Dominion	Canada	Services financiers	(1 800)	(137)	(141)
Tourmaline Oil Corp.	Canada	Énergie	(5 750)	(134)	(131)
Tritax Big Box REIT PLC	Royaume-Uni	Immobilier	(155 700)	(389)	(387)
Ultragenyx Pharmaceutical Inc.	États-Unis	Soins de santé	(1 450)	(126)	(143)
United Arrows Ltd.	Japon	Consommation discrétionnaire	(3 583)	(177)	(197)
United Utilities Group PLC	Royaume-Uni	Services publics	(59 500)	(750)	(705)
Univar Inc.	États-Unis	Produits industriels	(3 850)	(136)	(153)
Universal Display Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	(2 450)	(323)	(373)
Valeo SA	France	Consommation discrétionnaire	(10 021)	(584)	(562)
Valvoline Inc.	États-Unis	Matières	(14 253)	(393)	(396)
Veeco Instruments Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(24 000)	(376)	(318)
Vermilion Energy Inc.	Canada	Énergie	(3 300)	(145)	(140)
Versum Materials Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(2 650)	(134)	(123)
Viasat Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(2 179)	(178)	(180)



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2018

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
ACTIONS (suite)					
W.R. Grace & Co.	États-Unis	Matières	(1 450)	(134)	(134)
Waste Management Inc.	États-Unis	Produits industriels	(3 250)	(394)	(380)
Wayfair Inc., cat. A	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(950)	(109)	(181)
Welltower Inc.	États-Unis	Immobilier	(1 750)	(128)	(145)
Wesfarmers Ltd.	Australie	Consommation courante	(2 850)	(127)	(133)
Western Digital Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	(1 550)	(160)	(117)
Willis Towers Watson PLC	États-Unis	Services financiers	(2 000)	(388)	(364)
WiseTech Global Ltd.	Australie	Technologie de l'information	(7 850)	(114)	(162)
Wix.com Ltd.	Israël	Technologie de l'information	(1 050)	(116)	(162)
Yakult Hansha Co. Ltd.	Japon	Consommation courante	(1 200)	(107)	(127)
Yelp Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(7 900)	(468)	(502)
Yum China Holdings Inc.	Chine	Consommation discrétionnaire	(3 050)	(144)	(138)
Yum! Brands Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(3 400)	(357)	(399)
Zalando SE	Allemagne	Consommation discrétionnaire	(6 030)	(396)	(303)
Zenkoku Hoshu Co. Ltd.	Japon	Services financiers	(100)	(6)	(5)
zooplus AG	Allemagne	Consommation discrétionnaire	(1 900)	(387)	(427)
Total des actions				(90 767)	(90 574)
Total du portefeuille vendeur				(94 933)	(94 727)
Coûts de transaction				(60)	–
Total des placements				94 018	94 119
Instruments dérivés (se reporter au tableau des instruments dérivés)					1 880
Trésorerie et équivalents de trésorerie					177 643
Autres éléments d'actif moins le passif					3 523
Total de l'actif net					277 165

* Liée à Mackenzie. Voir note 1.



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

APERÇU DU PORTEFEUILLE

30 septembre 2018	
Répartition effective du portefeuille	% de la VL
Portfeuille acheteur	134,2
Obligations	55,4
<i>Obligations</i>	33,5
<i>Positions acheteur sur contrats à terme</i>	21,9
Actions	51,5
<i>Actions</i>	34,0
<i>Positions acheteur sur contrats à terme</i>	17,4
<i>Swaps</i>	0,1
Trésorerie et placements à court terme	25,6
Autres éléments d'actif (de passif)	1,7
Portfeuille vendeur	(34,2)
Actions	(32,7)
<i>Actions</i>	(32,7)
<i>Positions vendeur sur contrats à terme</i>	(0,0)
Obligations	(1,5)
<i>Obligations</i>	(1,5)
<i>Positions vendeur sur contrats à terme</i>	0,0
Répartition régionale effective	% de la VL
Portfeuille acheteur	134,2
États-Unis	72,9
Trésorerie et placements à court terme	25,6
Allemagne	8,0
Royaume-Uni	5,3
Australie	5,0
Japon	4,6
Autres	3,1
Canada	2,7
Other assets (liabilities)	1,7
France	1,5
Pays-Bas	1,0
Suède	0,8
Espagne	0,8
Finlande	0,5
Suisse	0,4
Irlande	0,3
Portfeuille vendeur	(34,2)
États-Unis	(18,6)
Japon	(3,7)
Royaume-Uni	(3,2)
Australie	(1,7)
Canada	(1,7)
Allemagne	(1,4)
Suisse	(1,1)
France	(0,8)
Chine	(0,4)

30 septembre 2018	
Répartition régionale effective (suite)	% de la VL
Portfeuille vendeur (suite)	
Autres	(0,4)
Espagne	(0,3)
Suède	(0,3)
Pays-Bas	(0,2)
Belgique	(0,1)
Bermudes	(0,1)
Danemark	(0,1)
Hong Kong	(0,1)
Répartition sectorielle effective	% de la VL
Portfeuille acheteur	134,2
Obligations d'État étrangères	26,0
Trésorerie et placements à court terme	25,6
Obligations de sociétés	24,4
Autres	17,4
Consommation discrétionnaire	6,0
Technologie de l'information	5,5
Prêts à terme	5,1
Soins de santé	3,2
Consommation courante	3,1
Produits industriels	3,1
Services financiers	2,8
Énergie	2,7
Matières	2,5
Services publics	2,1
Autres éléments d'actif (de passif)	1,7
Immobilier	1,5
Services de télécommunications	1,5
Portfeuille vendeur	(34,2)
Consommation discrétionnaire	(7,1)
Technologie de l'information	(6,4)
Soins de santé	(3,7)
Produits industriels	(3,6)
Consommation courante	(2,5)
Services financiers	(2,4)
Matières	(1,8)
Services de télécommunications	(1,5)
Obligations de sociétés	(1,5)
Énergie	(1,3)
Immobilier	(1,3)
Services publics	(1,1)

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



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS

Au 30 septembre 2018

Tableau des swaps sur rendement total

Note de crédit de la contrepartie	Contrepartie	Nombre de contrats	Date d'échéance	Rendement payé à la contrepartie par le Fonds, en fonction de	Rendement payé au Fonds par la contrepartie, en fonction de	Montant notionnel \$ (en milliers)	Profits latents \$ (en milliers)
AA	Banque de Montréal	842 200	9 octobre 2018	Taux d'intérêt variable correspondant au TIOL (\$ US) à 1 mois majoré de 0,35 %	Invesco Senior Loan ETF	25 641	160
AA	Banque de Montréal	106 300	9 octobre 2018	Taux d'intérêt variable correspondant au TIOL (\$ US) à 1 mois majoré de 0,35 %	iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF	16 002	14
AA	Banque de Montréal	137 100	9 octobre 2018	Taux d'intérêt variable correspondant au TIOL (\$ US) à 1 mois majoré de 1,30 %	iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF	15 532	119
Total des contrats de swap						57 175	293

Tableau des contrats à terme standardisés

Nombre de contrats	Type de contrat	Date d'échéance	Prix moyen des contrats (\$)	Montant notionnel* \$ (en milliers)	Profits latents \$ (en milliers)		
3	Contrats à terme sur l'indice IBEX 35, octobre 2018	19 octobre 2018	9 372,00 EUR	422	–		
56	Contrats à terme sur le pétrole brut WTI, novembre 2018	22 octobre 2018	69,20 USD	5 301	321		
33	Contrats à terme sur le gaz naturel, novembre 2018	29 octobre 2018	2,87 USD	1 283	54		
2	Contrats à terme sur l'indice Hang Seng, octobre 2018	30 octobre 2018	27 868,00 HKD	460	–		
1	Contrats à terme sur le pétrole brut Brent, décembre 2018	31 octobre 2018	80,05 USD	107	3		
16	Contrats à terme sur l'essence RBOB, novembre 2018	31 octobre 2018	201,28 USD	1 811	50		
(101)	Contrats à terme sur le soja, novembre 2018	14 novembre 2018	837,39 USD	(5 518)	23		
(5)	Contrats à terme sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans de moindre valeur, décembre 2018	12 décembre 2018	150,24 JPY	(854)	1		
(1)	Contrats à terme sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans (OSE), décembre 2018	13 décembre 2018	150,34 JPY	(1 707)	3		
17	Contrats à terme libellés en yens sur l'indice Nikkei 225, décembre 2018	13 décembre 2018	22 703,75 JPY	2 335	160		
(35)	Contrats à terme sur le blé RVH de KC, décembre 2018	14 décembre 2018	520,42 USD	(1 156)	15		
(4)	Contrats à terme sur obligations canadiennes à 10 ans, décembre 2018	18 décembre 2018	134,31 CAD	(530)	–		
(42)	Contrats à terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans, décembre 2018	19 décembre 2018	119,36 USD	(6 447)	43		
10	Contrats à terme sur l'indice S&P/TSX 60, décembre 2018	20 décembre 2018	954,81 CAD	1 901	2		
2	Contrats à terme sur l'indice SPI 200, décembre 2018	20 décembre 2018	6 146,00 AUD	289	2		
106	Contrats à terme sur l'indice CME E-Mini Standard & Poor's 500, décembre 2018	21 décembre 2018	2 898,43 USD	19 993	153		
4	Contrats à terme sur l'indice E-Mini NASDAQ 100, décembre 2018	21 décembre 2018	7 573,45 USD	791	8		
81	Contrats à terme sur l'indice Euro STOXX 50, décembre 2018	21 décembre 2018	3 356,75 EUR	4 116	47		
12	Contrats à terme sur l'indice FTSE 100, décembre 2018	21 décembre 2018	7 303,63 GBP	1 513	35		
37	Contrats à terme sur l'indice MSCI Marchés émergents, décembre 2018	21 décembre 2018	1 014,53 USD	2 510	91		
11	Contrats à terme sur l'indice OMXS30, décembre 2018	21 décembre 2018	1 633,00 SEK	264	3		
–	Contrats à terme sur l'or, 100 oz, décembre 2018	27 décembre 2018	1 232,04 USD	–	66		
7	Contrats à terme sur l'argent, décembre 2018	27 décembre 2018	14,55 USD	665	8		
(51)	Contrats à terme sur le sucre n° 11, mars 2019	28 février 2019	11,39 USD	(827)	8		
Profits latents						26 722	1 096



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

Au 30 septembre 2018

Tableau des contrats à terme standardisés (suite)

Nombre de contrats	Type de contrat	Date d'échéance	Prix moyen des contrats (\$)	Montant notionnel* \$ (en milliers)	Profits (pertes) latent(e)s \$ (en milliers)
(1)	Contrats à terme sur le gazole à faible teneur en soufre, octobre 2018	11 octobre 2018	680,75 USD	(94)	(6)
(18)	Contrats à terme sur le carburant diesel à très faible teneur en soufre au port de New York, novembre 2018	31 octobre 2018	226,65 USD	(2 294)	(61)
82	Contrats à terme sur euro-obligations, décembre 2018	6 décembre 2018	159,91 EUR	19 534	(166)
74	Contrats à terme sur le maïs, décembre 2018	14 décembre 2018	366,00 USD	1 703	(47)
(12)	Contrats à terme sur l'huile de soja, décembre 2018	14 décembre 2018	28,17 USD	(270)	(9)
15	Contrats à terme sur le blé (CBT), décembre 2018	14 décembre 2018	517,50 USD	493	(8)
92	Contrats à terme sur obligations du Trésor australien à 10 ans, décembre 2018	17 décembre 2018	129,85 AUD	11 073	(84)
12	Contrats à terme sur l'aluminium LME, décembre 2018	17 décembre 2018	2 080,00 USD	805	(2)
(4)	Contrats à terme sur le nickel LME, décembre 2018	17 décembre 2018	12 504,67 USD	(391)	(2)
(1)	Contrats à terme sur l'indice CAC 40 (10 euros), décembre 2018	21 décembre 2018	5 424,50 EUR	(82)	(1)
(1)	Contrats à terme sur l'indice DAX, décembre 2018	21 décembre 2018	12 065,50 EUR	(459)	(7)
5	Contrats à terme sur l'indice E-Mini Russell 2000, décembre 2018	21 décembre 2018	1 728,85 USD	549	(9)
(10)	Contrats à terme sur l'indice Swiss Market, décembre 2018	21 décembre 2018	8 958,50 CHF	(1 194)	(17)
16	Contrats à terme sur obligations du Royaume-Uni, décembre 2018	27 décembre 2018	122,23 GBP	3 259	(35)
187	Contrats à terme sur obligations du Trésor américain à 5 ans, décembre 2018	31 décembre 2018	113,14 USD	27 181	(164)
(Pertes) latentes				59 813	(618)
Total des contrats à terme standardisés				86 535	478

* 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	562	Livre sterling (721)	Dollar américain	4 octobre 2018	932	947	15
AA	921	Dollar canadien (699)	Dollar américain	4 octobre 2018	(921)	(903)	18
AA	722	Euro (835)	Dollar américain	4 octobre 2018	1 079	1 083	4
A	134 000	Peso chilien (198)	Dollar américain	5 octobre 2018	256	263	7
A	180 000	Peso chilien (267)	Dollar américain	5 octobre 2018	345	354	9
A	722 000	Peso colombien (239)	Dollar américain	5 octobre 2018	309	315	6
A	226	Dollar américain (5 010)	Couronne tchèque	5 octobre 2018	(292)	(292)	–
A	111 100	Forint hongrois (397)	Dollar américain	5 octobre 2018	513	515	2
A	160	Dollar américain (44 500)	Forint hongrois	5 octobre 2018	(207)	(206)	1
A	242	Dollar américain (66 600)	Forint hongrois	5 octobre 2018	(313)	(309)	4
A	4 240 000	Rupiah indonésienne (282)	Dollar américain	5 octobre 2018	365	367	2
A	6 820 000	Rupiah indonésienne (456)	Dollar américain	5 octobre 2018	589	591	2
A	280	Dollar américain (4 170 000)	Rupiah indonésienne	5 octobre 2018	(362)	(361)	1
A	610	Peso mexicain (32)	Dollar américain	5 octobre 2018	41	42	1
A	2 270	Peso mexicain (116)	Dollar américain	5 octobre 2018	150	156	6
A	1 030	Nouveau sol péruvien (310)	Dollar américain	5 octobre 2018	401	402	1
A	710	Zloty polonais (191)	Dollar américain	5 octobre 2018	247	249	2
A	30	Dollar américain (110)	Zloty polonais	5 octobre 2018	(39)	(39)	–
A	7 900	Rouble russe (115)	Dollar américain	5 octobre 2018	149	156	7



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

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)
A	14 300	Rouble russe	(217)	Dollar américain	5 octobre 2018	281	282	1
A	568	Dollar de Singapour	(415)	Dollar américain	5 octobre 2018	536	537	1
A	1 580	Rand sud-africain	(108)	Dollar américain	5 octobre 2018	139	144	5
A	2 150	Rand sud-africain	(149)	Dollar américain	5 octobre 2018	192	196	4
A	2 170	Dollar taiwanais	(70)	Dollar américain	5 octobre 2018	91	92	1
A	28 560	Dollar taiwanais	(931)	Dollar américain	5 octobre 2018	1 203	1 212	9
A	16 500	Baht thaïlandais	(509)	Dollar américain	5 octobre 2018	658	660	2
A	180	Livre turque	(29)	Dollar américain	5 octobre 2018	37	38	1
A	660	Livre turque	(106)	Dollar américain	5 octobre 2018	137	140	3
AA	205	Dollar américain	(281)	Dollar australien	26 octobre 2018	(265)	(263)	2
AA	70	Dollar américain	(95)	Dollar australien	26 octobre 2018	(91)	(88)	3
AA	47	Dollar américain	(64)	Dollar australien	26 octobre 2018	(61)	(59)	2
AA	165	Dollar américain	(226)	Dollar australien	26 octobre 2018	(213)	(211)	2
AA	94	Dollar américain	(126)	Dollar australien	26 octobre 2018	(121)	(118)	3
AA	37	Dollar américain	(51)	Dollar australien	26 octobre 2018	(48)	(47)	1
AA	33	Dollar américain	(125)	Real brésilien	26 octobre 2018	(43)	(41)	2
AA	38	Dollar américain	(149)	Real brésilien	26 octobre 2018	(49)	(48)	1
AA	34	Dollar américain	(129)	Real brésilien	26 octobre 2018	(44)	(41)	3
AA	14	Livre sterling	(19)	Dollar américain	26 octobre 2018	24	24	–
AA	16	Livre sterling	(21)	Dollar américain	26 octobre 2018	27	27	–
AA	28	Livre sterling	(36)	Dollar américain	26 octobre 2018	46	47	1
AA	65	Livre sterling	(83)	Dollar américain	26 octobre 2018	107	109	2
AA	19	Livre sterling	(24)	Dollar américain	26 octobre 2018	31	31	–
AA	48	Livre sterling	(61)	Dollar américain	26 octobre 2018	79	80	1
AA	13	Livre sterling	(16)	Dollar américain	26 octobre 2018	21	21	–
AA	195	Dollar canadien	(149)	Dollar américain	26 octobre 2018	(195)	(192)	3
AA	90	Dollar canadien	(69)	Dollar américain	26 octobre 2018	(90)	(89)	1
AA	350	Dollar canadien	(267)	Dollar américain	26 octobre 2018	(351)	(345)	6
AA	299	Dollar canadien	(228)	Dollar américain	26 octobre 2018	(300)	(295)	5
AA	819	Dollar canadien	(630)	Dollar américain	26 octobre 2018	(821)	(814)	7
AA	613	Dollar canadien	(473)	Dollar américain	26 octobre 2018	(613)	(611)	2
AA	352	Dollar canadien	(267)	Dollar américain	26 octobre 2018	(352)	(345)	7
AA	507	Dollar canadien	(385)	Dollar américain	26 octobre 2018	(507)	(498)	9
AA	117	Dollar canadien	(89)	Dollar américain	26 octobre 2018	(117)	(115)	2
AA	83	Dollar canadien	(64)	Dollar américain	26 octobre 2018	(84)	(83)	1
AA	5 194	Dollar canadien	(3 960)	Dollar américain	26 octobre 2018	(5 200)	(5 118)	82
AA	2 996	Dollar canadien	(2 292)	Dollar américain	26 octobre 2018	(2 999)	(2 962)	37
AA	121	Dollar canadien	(91)	Dollar américain	26 octobre 2018	(120)	(118)	2
AA	4 065	Dollar canadien	(3 111)	Dollar américain	26 octobre 2018	(4 070)	(4 020)	50
AA	537	Dollar canadien	(412)	Dollar américain	26 octobre 2018	(538)	(532)	6
AA	55	Dollar américain	(71)	Dollar canadien	26 octobre 2018	71	71	–
AA	111	Dollar américain	(142)	Dollar canadien	26 octobre 2018	143	143	–
AA	366	Euro	(420)	Dollar américain	26 octobre 2018	543	550	7
AA	23	Dollar américain	(20)	Euro	26 octobre 2018	(30)	(30)	–



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

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	32	Dollar américain (27)	Euro	26 octobre 2018	(41)	(41)	–
AA	66	Dollar américain (56)	Euro	26 octobre 2018	(85)	(85)	–
AA	31	Dollar américain (2 206)	Roupie indienne	26 octobre 2018	(40)	(39)	1
AA	26	Dollar américain (1 856)	Roupie indienne	26 octobre 2018	(34)	(33)	1
AA	27	Dollar américain (1 923)	Roupie indienne	26 octobre 2018	(35)	(34)	1
AA	51	Dollar américain (3 587)	Roupie indienne	26 octobre 2018	(66)	(64)	2
AA	51	Dollar américain (3 628)	Roupie indienne	26 octobre 2018	(66)	(64)	2
AA	77	Dollar américain (5 477)	Roupie indienne	26 octobre 2018	(100)	(97)	3
AA	693	Dollar américain (48 845)	Roupie indienne	26 octobre 2018	(896)	(866)	30
AA	235	Dollar américain (16 372)	Roupie indienne	26 octobre 2018	(304)	(290)	14
AA	401 750	Rupiah indonésienne (26)	Dollar américain	26 octobre 2018	34	35	1
AA	997 262	Rupiah indonésienne (66)	Dollar américain	26 octobre 2018	85	86	1
AA	15	Dollar américain (227 594)	Rupiah indonésienne	26 octobre 2018	(20)	(20)	–
AA	16	Dollar américain (236 464)	Rupiah indonésienne	26 octobre 2018	(21)	(21)	–
AA	22	Dollar américain (324 912)	Rupiah indonésienne	26 octobre 2018	(28)	(28)	–
AA	397	Dollar américain (5 907 746)	Rupiah indonésienne	26 octobre 2018	(513)	(510)	3
AA	53	Dollar américain (784 249)	Rupiah indonésienne	26 octobre 2018	(69)	(68)	1
AA	92	Shekel israélien (25)	Dollar américain	26 octobre 2018	32	32	–
AA	127	Shekel israélien (35)	Dollar américain	26 octobre 2018	45	45	–
AA	3 136	Shekel israélien (852)	Dollar américain	26 octobre 2018	1 101	1 117	16
AA	163	Shekel israélien (45)	Dollar américain	26 octobre 2018	58	58	–
AA	6 410	Shekel israélien (1 741)	Dollar américain	26 octobre 2018	2 250	2 283	33
AA	111	Shekel israélien (30)	Dollar américain	26 octobre 2018	39	39	–
AA	1 109	Dollar américain (4 000)	Shekel israélien	26 octobre 2018	(1 433)	(1 424)	9
AA	47	Dollar américain (5 213)	Yen japonais	26 octobre 2018	(61)	(60)	1
AA	19	Dollar américain (2 114)	Yen japonais	26 octobre 2018	(25)	(24)	1
AA	73	Dollar américain (8 093)	Yen japonais	26 octobre 2018	(94)	(92)	2
AA	60	Dollar américain (6 643)	Yen japonais	26 octobre 2018	(78)	(76)	2
AA	29	Dollar américain (3 193)	Yen japonais	26 octobre 2018	(37)	(36)	1
AA	778	Peso mexicain (41)	Dollar américain	26 octobre 2018	53	53	–
AA	6 272	Peso mexicain (325)	Dollar américain	26 octobre 2018	420	431	11
AA	8 300	Peso mexicain (429)	Dollar américain	26 octobre 2018	555	570	15
AA	488	Peso mexicain (26)	Dollar américain	26 octobre 2018	33	33	–
AA	84	Dollar néo-zélandais (55)	Dollar américain	26 octobre 2018	71	72	1
AA	230	Dollar néo-zélandais (152)	Dollar américain	26 octobre 2018	197	198	1
AA	38	Dollar néo-zélandais (26)	Dollar américain	26 octobre 2018	33	33	–
AA	93	Dollar néo-zélandais (61)	Dollar américain	26 octobre 2018	79	79	–
AA	28	Dollar néo-zélandais (19)	Dollar américain	26 octobre 2018	24	24	–
AA	102	Dollar néo-zélandais (67)	Dollar américain	26 octobre 2018	87	88	1
AA	43	Dollar américain (63)	Dollar néo-zélandais	26 octobre 2018	(56)	(55)	1
AA	499	Dollar américain (734)	Dollar néo-zélandais	26 octobre 2018	(645)	(629)	16
AA	34	Dollar américain (50)	Dollar néo-zélandais	26 octobre 2018	(44)	(43)	1
AA	467	Couronne norvégienne (56)	Dollar américain	26 octobre 2018	72	74	2
AA	5 615	Couronne norvégienne (675)	Dollar américain	26 octobre 2018	872	893	21
AA	3 749	Couronne norvégienne (459)	Dollar américain	26 octobre 2018	593	596	3



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

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	55	Couronne norvégienne	(7)	Dollar américain	26 octobre 2018	9	9	–
AA	94	Dollar américain	(757)	Couronne norvégienne	26 octobre 2018	(121)	(121)	–
AA	87	Dollar américain	(706)	Couronne norvégienne	26 octobre 2018	(112)	(112)	–
AA	302	Zloty polonais	(82)	Dollar américain	26 octobre 2018	106	106	–
AA	687	Zloty polonais	(183)	Dollar américain	26 octobre 2018	237	241	4
AA	127	Zloty polonais	(34)	Dollar américain	26 octobre 2018	44	45	1
AA	1 126	Dollar de Singapour	(820)	Dollar américain	26 octobre 2018	1 060	1 065	5
AA	107	Dollar de Singapour	(78)	Dollar américain	26 octobre 2018	101	101	–
AA	36	Dollar américain	(50)	Dollar de Singapour	26 octobre 2018	(47)	(47)	–
AA	18	Dollar américain	(24)	Dollar de Singapour	26 octobre 2018	(23)	(23)	–
AA	29	Dollar américain	(40)	Dollar de Singapour	26 octobre 2018	(38)	(38)	–
AA	40	Dollar américain	(55)	Dollar de Singapour	26 octobre 2018	(52)	(52)	–
AA	7 258	Rand sud-africain	(505)	Dollar américain	26 octobre 2018	652	661	9
AA	687	Rand sud-africain	(48)	Dollar américain	26 octobre 2018	62	63	1
AA	94 795	Won sud-coréen	(84)	Dollar américain	26 octobre 2018	109	110	1
AA	22 161	Won sud-coréen	(19)	Dollar américain	26 octobre 2018	25	25	–
AA	1 485 539	Won sud-coréen	(1 315)	Dollar américain	26 octobre 2018	1 700	1 730	30
AA	34 926	Won sud-coréen	(31)	Dollar américain	26 octobre 2018	40	40	–
AA	131 477	Won sud-coréen	(116)	Dollar américain	26 octobre 2018	150	153	3
AA	739 942	Won sud-coréen	(655)	Dollar américain	26 octobre 2018	847	862	15
AA	23 765	Won sud-coréen	(21)	Dollar américain	26 octobre 2018	27	27	–
AA	207	Couronne suédoise	(23)	Dollar américain	26 octobre 2018	30	30	–
AA	384	Couronne suédoise	(43)	Dollar américain	26 octobre 2018	55	56	1
AA	621	Couronne suédoise	(68)	Dollar américain	26 octobre 2018	88	90	2
AA	164	Couronne suédoise	(18)	Dollar américain	26 octobre 2018	23	24	1
AA	237	Couronne suédoise	(26)	Dollar américain	26 octobre 2018	34	35	1
AA	187	Couronne suédoise	(21)	Dollar américain	26 octobre 2018	27	28	1
AA	145	Couronne suédoise	(15)	Dollar américain	26 octobre 2018	20	21	1
AA	234	Couronne suédoise	(26)	Dollar américain	26 octobre 2018	33	34	1
AA	307	Couronne suédoise	(34)	Dollar américain	26 octobre 2018	44	45	1
AA	254	Dollar américain	(2 238)	Couronne suédoise	26 octobre 2018	(328)	(326)	2
AA	19	Dollar américain	(161)	Couronne suédoise	26 octobre 2018	(24)	(24)	–
AA	103	Franc suisse	(104)	Dollar américain	26 octobre 2018	134	135	1
AA	201	Franc suisse	(204)	Dollar américain	26 octobre 2018	263	266	3
AA	59	Franc suisse	(60)	Dollar américain	26 octobre 2018	78	78	–
AA	51	Franc suisse	(52)	Dollar américain	26 octobre 2018	67	68	1
AA	328	Franc suisse	(332)	Dollar américain	26 octobre 2018	429	433	4
AA	89	Franc suisse	(91)	Dollar américain	26 octobre 2018	117	117	–
AA	135	Livre turque	(21)	Dollar américain	26 octobre 2018	27	28	1
AA	2 252	Livre turque	(358)	Dollar américain	26 octobre 2018	462	473	11
AA	4 464	Livre turque	(619)	Dollar américain	26 octobre 2018	800	938	138
AA	267	Livre turque	(42)	Dollar américain	26 octobre 2018	54	57	3
AA	1 400	Livre turque	(194)	Dollar américain	26 octobre 2018	251	294	43
AA	147	Livre turque	(23)	Dollar américain	26 octobre 2018	30	31	1
AA	295	Livre turque	(46)	Dollar américain	26 octobre 2018	59	62	3



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

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	131	Livre turque	(19)	Dollar américain	26 octobre 2018	24	27	3
AA	9 915	Dollar canadien	(7 600)	Dollar américain	9 novembre 2018	(9 915)	(9 806)	109
AA	10 110	Dollar canadien	(7 757)	Dollar américain	9 novembre 2018	(10 110)	(10 008)	102
A	722 000	Peso colombien	(240)	Dollar américain	9 novembre 2018	310	314	4
A	6 890 000	Rupiah indonésienne	(459)	Dollar américain	9 novembre 2018	593	594	1
A	2 690	Peso mexicain	(141)	Dollar américain	9 novembre 2018	182	185	3
A	135	Dollar américain	(490)	Zloty polonais	9 novembre 2018	(174)	(172)	2
AA	43 033	Dollar canadien	(32 800)	Dollar américain	30 novembre 2018	(43 033)	(42 307)	726
AA	1 050	Dollar canadien	(800)	Dollar américain	30 novembre 2018	(1 050)	(1 032)	18
AA	273	Dollar australien	(196)	Dollar américain	7 décembre 2018	253	255	2
AA	200	Dollar américain	(273)	Dollar australien	7 décembre 2018	(258)	(255)	3
AA	22	Dollar américain	(30)	Dollar australien	7 décembre 2018	(28)	(28)	–
AA	228	Dollar américain	(312)	Dollar australien	7 décembre 2018	(294)	(291)	3
AA	36	Dollar américain	(50)	Dollar australien	7 décembre 2018	(47)	(47)	–
AA	211	Real brésilien	(50)	Dollar américain	7 décembre 2018	65	67	2
AA	377	Real brésilien	(93)	Dollar américain	7 décembre 2018	120	120	–
AA	540	Real brésilien	(128)	Dollar américain	7 décembre 2018	166	171	5
AA	799	Real brésilien	(197)	Dollar américain	7 décembre 2018	254	254	–
AA	103	Livre sterling	(133)	Dollar américain	7 décembre 2018	172	174	2
AA	145	Livre sterling	(187)	Dollar américain	7 décembre 2018	242	245	3
AA	202	Dollar américain	(153)	Livre sterling	7 décembre 2018	(261)	(258)	3
AA	67	Dollar américain	(51)	Livre sterling	7 décembre 2018	(87)	(86)	1
AA	423	Dollar américain	(320)	Livre sterling	7 décembre 2018	(547)	(541)	6
AA	113	Dollar américain	(86)	Livre sterling	7 décembre 2018	(146)	(145)	1
AA	842	Dollar canadien	(645)	Dollar américain	7 décembre 2018	(843)	(833)	10
AA	386	Dollar canadien	(297)	Dollar américain	7 décembre 2018	(387)	(384)	3
AA	1 180	Dollar canadien	(905)	Dollar américain	7 décembre 2018	(1 183)	(1 169)	14
AA	9 030	Dollar canadien	(6 917)	Dollar américain	7 décembre 2018	(9 049)	(8 939)	110
AA	2 382	Dollar canadien	(1 825)	Dollar américain	7 décembre 2018	(2 387)	(2 358)	29
AA	16	Dollar américain	(14)	Euro	7 décembre 2018	(21)	(21)	–
AA	18	Dollar américain	(15)	Euro	7 décembre 2018	(23)	(23)	–
AA	163	Dollar américain	(137)	Euro	7 décembre 2018	(210)	(208)	2
AA	329	Dollar américain	(278)	Euro	7 décembre 2018	(425)	(420)	5
AA	21	Dollar américain	(18)	Euro	7 décembre 2018	(27)	(27)	–
AA	39	Dollar américain	(33)	Euro	7 décembre 2018	(50)	(50)	–
AA	554	Dollar américain	(474)	Euro	7 décembre 2018	(716)	(716)	–
AA	1 011	Dollar américain	(866)	Euro	7 décembre 2018	(1 307)	(1 307)	–
AA	337	Dollar américain	(23 924)	Roupie indienne	7 décembre 2018	(436)	(422)	14
AA	438 461	Rupiah indonésienne	(29)	Dollar américain	7 décembre 2018	37	37	–
AA	549 130	Rupiah indonésienne	(36)	Dollar américain	7 décembre 2018	46	47	1
AA	685 109	Rupiah indonésienne	(45)	Dollar américain	7 décembre 2018	58	58	–
AA	232 222	Rupiah indonésienne	(15)	Dollar américain	7 décembre 2018	20	20	–
AA	1 166 531	Rupiah indonésienne	(76)	Dollar américain	7 décembre 2018	98	100	2
AA	110	Dollar américain	(1 630 063)	Rupiah indonésienne	7 décembre 2018	(142)	(140)	2
AA	1 848	Dollar américain	(6 671)	Shekel israélien	7 décembre 2018	(2 388)	(2 383)	5



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

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	702	Dollar américain	(2 506)	Shekel israélien	7 décembre 2018	(907)	(895)	12
AA	1 131	Dollar américain	(4 080)	Shekel israélien	7 décembre 2018	(1 461)	(1 458)	3
AA	1 449	Dollar américain	(5 170)	Shekel israélien	7 décembre 2018	(1 872)	(1 847)	25
AA	108	Dollar américain	(11 874)	Yen japonais	7 décembre 2018	(139)	(136)	3
AA	740	Dollar américain	(81 817)	Yen japonais	7 décembre 2018	(956)	(935)	21
AA	179	Dollar américain	(19 767)	Yen japonais	7 décembre 2018	(231)	(226)	5
AA	10 083	Peso mexicain	(527)	Dollar américain	7 décembre 2018	681	689	8
AA	9 473	Peso mexicain	(494)	Dollar américain	7 décembre 2018	639	647	8
AA	11 528	Peso mexicain	(601)	Dollar américain	7 décembre 2018	777	787	10
AA	4 931	Peso mexicain	(258)	Dollar américain	7 décembre 2018	333	337	4
AA	61	Dollar néo-zélandais	(40)	Dollar américain	7 décembre 2018	52	52	–
AA	295	Dollar néo-zélandais	(195)	Dollar américain	7 décembre 2018	252	253	1
AA	48	Dollar néo-zélandais	(32)	Dollar américain	7 décembre 2018	41	41	–
AA	40	Dollar néo-zélandais	(26)	Dollar américain	7 décembre 2018	34	34	–
AA	123	Dollar américain	(185)	Dollar néo-zélandais	7 décembre 2018	(159)	(159)	–
AA	884	Dollar américain	(1 327)	Dollar néo-zélandais	7 décembre 2018	(1 143)	(1 137)	6
AA	68	Dollar américain	(102)	Dollar néo-zélandais	7 décembre 2018	(88)	(88)	–
AA	874	Dollar américain	(1 311)	Dollar néo-zélandais	7 décembre 2018	(1 129)	(1 123)	6
AA	1 089	Couronne norvégienne	(134)	Dollar américain	7 décembre 2018	173	174	1
AA	3 298	Couronne norvégienne	(393)	Dollar américain	7 décembre 2018	508	525	17
AA	1 677	Couronne norvégienne	(200)	Dollar américain	7 décembre 2018	258	267	9
AA	733	Couronne norvégienne	(90)	Dollar américain	7 décembre 2018	116	117	1
AA	3 943	Couronne norvégienne	(474)	Dollar américain	7 décembre 2018	612	628	16
AA	328	Zloty polonais	(89)	Dollar américain	7 décembre 2018	115	115	–
AA	1 422	Dollar de Singapour	(1 042)	Dollar américain	7 décembre 2018	1 346	1 347	1
AA	1 753	Dollar de Singapour	(1 284)	Dollar américain	7 décembre 2018	1 659	1 660	1
AA	6 354	Rand sud-africain	(443)	Dollar américain	7 décembre 2018	573	575	2
AA	4 601	Rand sud-africain	(319)	Dollar américain	7 décembre 2018	412	417	5
AA	7 382	Rand sud-africain	(511)	Dollar américain	7 décembre 2018	661	669	8
AA	3 078	Rand sud-africain	(215)	Dollar américain	7 décembre 2018	278	279	1
AA	34 596	Won sud-coréen	(31)	Dollar américain	7 décembre 2018	40	41	1
AA	130 996	Won sud-coréen	(117)	Dollar américain	7 décembre 2018	151	153	2
AA	77 576	Won sud-coréen	(69)	Dollar américain	7 décembre 2018	89	90	1
AA	27 519	Won sud-coréen	(25)	Dollar américain	7 décembre 2018	32	32	–
AA	3 193	Couronne suédoise	(352)	Dollar américain	7 décembre 2018	455	467	12
AA	416	Couronne suédoise	(46)	Dollar américain	7 décembre 2018	59	61	2
AA	40	Dollar américain	(352)	Couronne suédoise	7 décembre 2018	(52)	(52)	–
AA	7 859	Livre turque	(1 230)	Dollar américain	7 décembre 2018	1 590	1 606	16
AA	804	Livre turque	(115)	Dollar américain	7 décembre 2018	149	164	15
AA	4 677	Livre turque	(729)	Dollar américain	7 décembre 2018	942	955	13
AA	3 833	Livre turque	(600)	Dollar américain	7 décembre 2018	776	784	8
AA	4 646	Livre turque	(724)	Dollar américain	7 décembre 2018	936	949	13
AA	192	Livre turque	(28)	Dollar américain	7 décembre 2018	36	40	4

Profits latents

2 309



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

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)	(Pertes) latentes \$ (en milliers)
AA	321	Dollar américain	(448)	Dollar australien	4 octobre 2018	(415)	(418)	(3)
AA	94 500	Yen japonais	(850)	Dollar américain	4 octobre 2018	1 098	1 076	(22)
AA	856	Dollar américain	(1 308)	Dollar néo-zélandais	4 octobre 2018	(1 106)	(1 120)	(14)
AA	1 716	Dollar américain	(14 430)	Couronne norvégienne	4 octobre 2018	(2 217)	(2 291)	(74)
AA	1 061	Dollar américain	(9 660)	Couronne suédoise	4 octobre 2018	(1 371)	(1 405)	(34)
AA	132	Franc suisse	(135)	Dollar américain	4 octobre 2018	175	174	(1)
A	460	Dollar américain	(314 000)	Peso chilien	5 octobre 2018	(594)	(617)	(23)
A	241	Dollar américain	(722 000)	Peso colombien	5 octobre 2018	(311)	(315)	(4)
A	5 010	Couronne tchèque	(227)	Dollar américain	5 octobre 2018	293	292	(1)
A	461	Dollar américain	(6 890 000)	Rupiah indonésienne	5 octobre 2018	(596)	(597)	(1)
A	10	Dollar américain	(190)	Peso mexicain	5 octobre 2018	(13)	(13)	–
A	142	Dollar américain	(2 690)	Peso mexicain	5 octobre 2018	(183)	(186)	(3)
A	310	Dollar américain	(1 030)	Nouveau sol péruvien	5 octobre 2018	(401)	(403)	(2)
A	490	Zloty polonais	(135)	Dollar américain	5 octobre 2018	174	172	(2)
A	296	Dollar américain	(1 090)	Zloty polonais	5 octobre 2018	(382)	(382)	–
A	251	Dollar américain	(17 200)	Rouble russe	5 octobre 2018	(325)	(339)	(14)
A	74	Dollar américain	(5 000)	Rouble russe	5 octobre 2018	(96)	(99)	(3)
A	412	Dollar américain	(568)	Dollar de Singapour	5 octobre 2018	(533)	(537)	(4)
A	102	Dollar américain	(1 580)	Rand sud-africain	5 octobre 2018	(132)	(144)	(12)
A	145	Dollar américain	(2 150)	Rand sud-africain	5 octobre 2018	(188)	(196)	(8)
A	141	Dollar américain	(4 320)	Dollar taiwanais	5 octobre 2018	(182)	(183)	(1)
A	859	Dollar américain	(26 410)	Dollar taiwanais	5 octobre 2018	(1 110)	(1 120)	(10)
A	505	Dollar américain	(16 500)	Baht thaïlandais	5 octobre 2018	(653)	(660)	(7)
A	92	Dollar américain	(620)	Livre turque	5 octobre 2018	(119)	(132)	(13)
A	33	Dollar américain	(220)	Livre turque	5 octobre 2018	(42)	(47)	(5)
AA	70	Dollar australien	(51)	Dollar américain	26 octobre 2018	66	66	–
AA	118	Dollar australien	(86)	Dollar américain	26 octobre 2018	111	110	(1)
AA	172	Dollar australien	(127)	Dollar américain	26 octobre 2018	164	160	(4)
AA	30	Dollar australien	(22)	Dollar américain	26 octobre 2018	28	28	–
AA	32	Dollar américain	(44)	Dollar australien	26 octobre 2018	(41)	(41)	–
AA	570	Real brésilien	(145)	Dollar américain	26 octobre 2018	188	182	(6)
AA	29	Dollar américain	(119)	Real brésilien	26 octobre 2018	(37)	(38)	(1)
AA	19	Livre sterling	(25)	Dollar américain	26 octobre 2018	32	32	–
AA	33	Livre sterling	(43)	Dollar américain	26 octobre 2018	56	56	–
AA	23	Dollar américain	(18)	Livre sterling	26 octobre 2018	(30)	(30)	–
AA	79	Dollar américain	(60)	Livre sterling	26 octobre 2018	(102)	(102)	–
AA	44	Dollar américain	(58)	Dollar canadien	26 octobre 2018	58	57	(1)
AA	40	Dollar américain	(53)	Dollar canadien	26 octobre 2018	53	52	(1)
AA	53	Dollar américain	(69)	Dollar canadien	26 octobre 2018	70	69	(1)
AA	69	Dollar américain	(90)	Dollar canadien	26 octobre 2018	90	89	(1)
AA	37	Dollar américain	(48)	Dollar canadien	26 octobre 2018	49	48	(1)
AA	80	Dollar américain	(104)	Dollar canadien	26 octobre 2018	105	103	(2)
AA	140	Dollar américain	(182)	Dollar canadien	26 octobre 2018	183	181	(2)
AA	2	Dollar américain	(2)	Dollar canadien	26 octobre 2018	2	2	–
AA	52	Dollar américain	(68)	Dollar canadien	26 octobre 2018	68	67	(1)



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

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)	(Pertes) latentes \$ (en milliers)
AA	99	Dollar américain	(130)	Dollar canadien	26 octobre 2018	130	128	(2)
AA	34	Euro	(39)	Dollar américain	26 octobre 2018	51	50	(1)
AA	35	Euro	(41)	Dollar américain	26 octobre 2018	53	52	(1)
AA	19	Dollar américain	(16)	Euro	26 octobre 2018	(24)	(24)	–
AA	96	Dollar américain	(84)	Euro	26 octobre 2018	(124)	(126)	(2)
AA	60	Dollar américain	(52)	Euro	26 octobre 2018	(78)	(79)	(1)
AA	136	Dollar américain	(119)	Euro	26 octobre 2018	(176)	(179)	(3)
AA	152	Dollar américain	(132)	Euro	26 octobre 2018	(196)	(199)	(3)
AA	268	Dollar américain	(234)	Euro	26 octobre 2018	(346)	(351)	(5)
AA	34	Dollar américain	(29)	Euro	26 octobre 2018	(44)	(44)	–
AA	8 986	Roupie indienne	(128)	Dollar américain	26 octobre 2018	165	160	(5)
AA	1 836	Roupie indienne	(26)	Dollar américain	26 octobre 2018	34	33	(1)
AA	6 379	Roupie indienne	(91)	Dollar américain	26 octobre 2018	117	113	(4)
AA	238 222	Rupiah indonésienne	(16)	Dollar américain	26 octobre 2018	21	21	–
AA	263 179	Rupiah indonésienne	(18)	Dollar américain	26 octobre 2018	23	23	–
AA	257 520	Rupiah indonésienne	(18)	Dollar américain	26 octobre 2018	23	23	–
AA	530 554	Rupiah indonésienne	(36)	Dollar américain	26 octobre 2018	46	45	(1)
AA	598	Shekel israélien	(166)	Dollar américain	26 octobre 2018	214	213	(1)
AA	148	Shekel israélien	(41)	Dollar américain	26 octobre 2018	53	53	–
AA	307	Shekel israélien	(85)	Dollar américain	26 octobre 2018	110	110	–
AA	101	Shekel israélien	(28)	Dollar américain	26 octobre 2018	36	36	–
AA	713	Shekel israélien	(197)	Dollar américain	26 octobre 2018	254	254	–
AA	213	Shekel israélien	(59)	Dollar américain	26 octobre 2018	76	76	–
AA	205	Dollar américain	(754)	Shekel israélien	26 octobre 2018	(265)	(269)	(4)
AA	1 604	Dollar américain	(5 902)	Shekel israélien	26 octobre 2018	(2 073)	(2 102)	(29)
AA	10 588	Yen japonais	(96)	Dollar américain	26 octobre 2018	124	121	(3)
AA	2 266	Yen japonais	(20)	Dollar américain	26 octobre 2018	26	26	–
AA	1 945	Yen japonais	(18)	Dollar américain	26 octobre 2018	23	22	(1)
AA	22 148	Yen japonais	(201)	Dollar américain	26 octobre 2018	260	253	(7)
AA	2 387	Yen japonais	(22)	Dollar américain	26 octobre 2018	28	27	(1)
AA	74	Dollar américain	(1 425)	Peso mexicain	26 octobre 2018	(96)	(98)	(2)
AA	562	Dollar américain	(10 846)	Peso mexicain	26 octobre 2018	(726)	(746)	(20)
AA	69	Dollar américain	(1 308)	Peso mexicain	26 octobre 2018	(89)	(90)	(1)
AA	15	Dollar américain	(280)	Peso mexicain	26 octobre 2018	(19)	(20)	(1)
AA	270	Dollar américain	(5 217)	Peso mexicain	26 octobre 2018	(349)	(358)	(9)
AA	33	Dollar américain	(644)	Peso mexicain	26 octobre 2018	(43)	(44)	(1)
AA	29	Dollar américain	(566)	Peso mexicain	26 octobre 2018	(38)	(38)	–
AA	235	Dollar néo-zélandais	(158)	Dollar américain	26 octobre 2018	204	201	(3)
AA	294	Dollar néo-zélandais	(196)	Dollar américain	26 octobre 2018	253	252	(1)
AA	128	Dollar néo-zélandais	(85)	Dollar américain	26 octobre 2018	110	110	–
AA	117	Dollar néo-zélandais	(78)	Dollar américain	26 octobre 2018	101	100	(1)
AA	653	Dollar américain	(992)	Dollar néo-zélandais	26 octobre 2018	(844)	(849)	(5)
AA	91	Dollar américain	(137)	Dollar néo-zélandais	26 octobre 2018	(117)	(118)	(1)
AA	53	Dollar américain	(439)	Couronne norvégienne	26 octobre 2018	(68)	(70)	(2)
AA	78	Dollar américain	(653)	Couronne norvégienne	26 octobre 2018	(101)	(104)	(3)



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

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)	(Pertes) latentes \$ (en milliers)	
AA	60	Dollar américain (495)	Couronne norvégienne	26 octobre 2018	(77)	(79)	(2)
AA	16	Dollar américain (137)	Couronne norvégienne	26 octobre 2018	(21)	(22)	(1)
AA	25	Dollar américain (204)	Couronne norvégienne	26 octobre 2018	(32)	(33)	(1)
AA	32	Dollar américain (264)	Couronne norvégienne	26 octobre 2018	(41)	(42)	(1)
AA	97	Dollar américain (793)	Couronne norvégienne	26 octobre 2018	(125)	(126)	(1)
AA	46	Dollar américain (389)	Couronne norvégienne	26 octobre 2018	(60)	(62)	(2)
AA	22	Dollar américain (81)	Zloty polonais	26 octobre 2018	(28)	(28)	–
AA	17	Dollar américain (62)	Zloty polonais	26 octobre 2018	(22)	(22)	–
AA	74	Dollar américain (277)	Zloty polonais	26 octobre 2018	(95)	(97)	(2)
AA	63	Dollar américain (235)	Zloty polonais	26 octobre 2018	(81)	(83)	(2)
AA	36	Dollar américain (137)	Zloty polonais	26 octobre 2018	(47)	(48)	(1)
AA	29	Dollar américain (112)	Zloty polonais	26 octobre 2018	(38)	(39)	(1)
AA	16	Dollar américain (60)	Zloty polonais	26 octobre 2018	(21)	(21)	–
AA	1 130	Dollar de Singapour (830)	Dollar américain	26 octobre 2018	1 073	1 069	(4)
AA	61	Dollar américain (84)	Dollar de Singapour	26 octobre 2018	(79)	(80)	(1)
AA	38	Dollar américain (53)	Dollar de Singapour	26 octobre 2018	(49)	(49)	–
AA	66	Dollar américain (90)	Dollar de Singapour	26 octobre 2018	(85)	(85)	–
AA	1 100	Dollar américain (1 511)	Dollar de Singapour	26 octobre 2018	(1 422)	(1 430)	(8)
AA	22	Dollar américain (31)	Dollar de Singapour	26 octobre 2018	(29)	(29)	–
AA	563	Dollar américain (772)	Dollar de Singapour	26 octobre 2018	(727)	(731)	(4)
AA	4 858	Rand sud-africain (357)	Dollar américain	26 octobre 2018	461	442	(19)
AA	216	Rand sud-africain (16)	Dollar américain	26 octobre 2018	21	20	(1)
AA	548	Dollar américain (7 897)	Rand sud-africain	26 octobre 2018	(708)	(719)	(11)
AA	25	Dollar américain (354)	Rand sud-africain	26 octobre 2018	(32)	(32)	–
AA	78	Dollar américain (1 129)	Rand sud-africain	26 octobre 2018	(101)	(102)	(1)
AA	258	Dollar américain (3 717)	Rand sud-africain	26 octobre 2018	(333)	(338)	(5)
AA	43	Dollar américain (610)	Rand sud-africain	26 octobre 2018	(55)	(56)	(1)
AA	29	Dollar américain (31 869)	Won sud-coréen	26 octobre 2018	(37)	(37)	–
AA	741	Dollar américain (838 816)	Won sud-coréen	26 octobre 2018	(957)	(977)	(20)
AA	1 004	Dollar américain (1 131 552)	Won sud-coréen	26 octobre 2018	(1 298)	(1 318)	(20)
AA	70	Dollar américain (78 122)	Won sud-coréen	26 octobre 2018	(90)	(91)	(1)
AA	415	Couronne suédoise (47)	Dollar américain	26 octobre 2018	61	60	(1)
AA	327	Couronne suédoise (37)	Dollar américain	26 octobre 2018	48	47	(1)
AA	214	Dollar américain (1 941)	Couronne suédoise	26 octobre 2018	(277)	(283)	(6)
AA	91	Dollar américain (816)	Couronne suédoise	26 octobre 2018	(117)	(119)	(2)
AA	23	Franc suisse (23)	Dollar américain	26 octobre 2018	30	30	–
AA	15	Dollar américain (15)	Franc suisse	26 octobre 2018	(20)	(20)	–
AA	450	Dollar américain (444)	Franc suisse	26 octobre 2018	(581)	(586)	(5)
AA	488	Dollar américain (481)	Franc suisse	26 octobre 2018	(630)	(635)	(5)
AA	3 850	Livre turque (770)	Dollar américain	26 octobre 2018	995	809	(186)
AA	159	Livre turque (32)	Dollar américain	26 octobre 2018	41	33	(8)
AA	39	Dollar américain (264)	Livre turque	26 octobre 2018	(51)	(55)	(4)
AA	826	Dollar américain (5 994)	Livre turque	26 octobre 2018	(1 068)	(1 259)	(191)
AA	272	Dollar américain (1 975)	Livre turque	26 octobre 2018	(352)	(415)	(63)
AA	19	Dollar américain (122)	Livre turque	26 octobre 2018	(24)	(26)	(2)



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

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)	(Pertes) latentes \$ (en milliers)
A	267	Dollar américain	(180 000)	Peso chilien	9 novembre 2018	(345)	(355)	(10)
A	66 600	Forint hongrois	(243)	Dollar américain	9 novembre 2018	314	310	(4)
A	217	Dollar américain	(14 300)	Rouble russe	9 novembre 2018	(280)	(281)	(1)
A	148	Dollar américain	(2 150)	Rand sud-africain	9 novembre 2018	(191)	(195)	(4)
A	932	Dollar américain	(28 560)	Dollar taïwanais	9 novembre 2018	(1 205)	(1 213)	(8)
A	509	Dollar américain	(16 500)	Baht thaïlandais	9 novembre 2018	(658)	(660)	(2)
A	104	Dollar américain	(660)	Livre turque	9 novembre 2018	(134)	(137)	(3)
AA	199	Dollar australien	(145)	Dollar américain	7 décembre 2018	188	186	(2)
AA	36	Dollar américain	(51)	Dollar australien	7 décembre 2018	(47)	(47)	–
AA	20	Dollar américain	(28)	Dollar australien	7 décembre 2018	(26)	(26)	–
AA	77	Dollar américain	(108)	Dollar australien	7 décembre 2018	(100)	(101)	(1)
AA	89	Dollar américain	(123)	Dollar australien	7 décembre 2018	(115)	(115)	–
AA	2	Dollar américain	(11)	Real brésilien	7 décembre 2018	(3)	(3)	–
AA	250	Dollar américain	(1 029)	Real brésilien	7 décembre 2018	(323)	(327)	(4)
AA	414	Livre sterling	(544)	Dollar américain	7 décembre 2018	703	700	(3)
AA	91	Dollar américain	(70)	Livre sterling	7 décembre 2018	(117)	(118)	(1)
AA	187	Dollar américain	(144)	Livre sterling	7 décembre 2018	(242)	(243)	(1)
AA	535	Dollar américain	(414)	Livre sterling	7 décembre 2018	(691)	(700)	(9)
AA	64	Dollar américain	(84)	Dollar canadien	7 décembre 2018	83	83	–
AA	96	Dollar américain	(124)	Dollar canadien	7 décembre 2018	125	124	(1)
AA	148	Dollar américain	(192)	Dollar canadien	7 décembre 2018	192	191	(1)
AA	108	Dollar américain	(143)	Dollar canadien	7 décembre 2018	143	140	(3)
AA	182	Dollar américain	(236)	Dollar canadien	7 décembre 2018	237	235	(2)
AA	296	Dollar américain	(386)	Dollar canadien	7 décembre 2018	387	382	(5)
AA	21	Dollar américain	(27)	Dollar canadien	7 décembre 2018	27	27	–
AA	866	Euro	(1 017)	Dollar américain	7 décembre 2018	1 314	1 307	(7)
AA	1 537	Roupie indienne	(21)	Dollar américain	7 décembre 2018	27	27	–
AA	2 801	Roupie indienne	(39)	Dollar américain	7 décembre 2018	50	50	–
AA	31 928	Roupie indienne	(450)	Dollar américain	7 décembre 2018	582	563	(19)
AA	78	Dollar américain	(5 759)	Roupie indienne	7 décembre 2018	(101)	(101)	–
AA	139	Dollar américain	(10 157)	Roupie indienne	7 décembre 2018	(179)	(179)	–
AA	18	Dollar américain	(1 317)	Roupie indienne	7 décembre 2018	(23)	(23)	–
AA	3 682 375	Rupiah indonésienne	(248)	Dollar américain	7 décembre 2018	321	315	(6)
AA	456	Shekel israélien	(128)	Dollar américain	7 décembre 2018	166	163	(3)
AA	1 124	Shekel israélien	(316)	Dollar américain	7 décembre 2018	408	402	(6)
AA	10 772	Yen japonais	(96)	Dollar américain	7 décembre 2018	124	123	(1)
AA	2 546	Yen japonais	(23)	Dollar américain	7 décembre 2018	30	30	–
AA	3 707	Yen japonais	(33)	Dollar américain	7 décembre 2018	43	42	(1)
AA	81 817	Yen japonais	(734)	Dollar américain	7 décembre 2018	949	935	(14)
AA	22 730	Yen japonais	(202)	Dollar américain	7 décembre 2018	261	260	(1)
AA	3 377	Yen japonais	(30)	Dollar américain	7 décembre 2018	39	38	(1)
AA	7 513	Yen japonais	(68)	Dollar américain	7 décembre 2018	88	86	(2)
AA	1 046	Couronne norvégienne	(129)	Dollar américain	7 décembre 2018	167	167	–
AA	558	Couronne norvégienne	(69)	Dollar américain	7 décembre 2018	89	89	–
AA	425	Dollar américain	(3 540)	Couronne norvégienne	7 décembre 2018	(549)	(564)	(15)



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

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	89	Zloty polonais (25)	Dollar américain	7 décembre 2018	32	32	–
AA	77	Zloty polonais (21)	Dollar américain	7 décembre 2018	27	27	–
AA	120	Dollar américain (445)	Zloty polonais	7 décembre 2018	(155)	(156)	(1)
AA	11	Dollar américain (40)	Zloty polonais	7 décembre 2018	(14)	(14)	–
AA	48	Dollar américain (179)	Zloty polonais	7 décembre 2018	(62)	(62)	–
AA	191	Dollar de Singapour (140)	Dollar américain	7 décembre 2018	181	181	–
AA	99	Dollar de Singapour (73)	Dollar américain	7 décembre 2018	94	94	–
AA	535	Dollar américain (734)	Dollar de Singapour	7 décembre 2018	(691)	(695)	(4)
AA	63	Dollar américain (87)	Dollar de Singapour	7 décembre 2018	(82)	(82)	–
AA	59	Dollar américain (80)	Dollar de Singapour	7 décembre 2018	(76)	(76)	–
AA	258	Dollar américain (353)	Dollar de Singapour	7 décembre 2018	(333)	(335)	(2)
AA	67	Dollar américain (1 038)	Rand sud-africain	7 décembre 2018	(86)	(94)	(8)
AA	41	Dollar américain (644)	Rand sud-africain	7 décembre 2018	(53)	(58)	(5)
AA	932	Dollar américain (1 037 146)	Won sud-coréen	7 décembre 2018	(1 204)	(1 210)	(6)
AA	1 298	Dollar américain (1 442 731)	Won sud-coréen	7 décembre 2018	(1 677)	(1 683)	(6)
AA	1 524	Dollar américain (1 693 803)	Won sud-coréen	7 décembre 2018	(1 969)	(1 976)	(7)
AA	457	Dollar américain (508 858)	Won sud-coréen	7 décembre 2018	(591)	(594)	(3)
AA	161	Dollar américain (1 452)	Couronne suédoise	7 décembre 2018	(208)	(213)	(5)
AA	103	Dollar américain (928)	Couronne suédoise	7 décembre 2018	(133)	(136)	(3)
AA	40	Franc suisse (42)	Dollar américain	7 décembre 2018	54	53	(1)
AA	23	Franc suisse (24)	Dollar américain	7 décembre 2018	31	30	(1)
AA	24	Franc suisse (25)	Dollar américain	7 décembre 2018	32	32	–
AA	49	Franc suisse (51)	Dollar américain	7 décembre 2018	66	65	(1)
AA	60	Franc suisse (62)	Dollar américain	7 décembre 2018	80	79	(1)
AA	233	Franc suisse (243)	Dollar américain	7 décembre 2018	314	309	(5)
AA	2	Euro (2)	Dollar américain	7 décembre 2018	2	2	–
AA	840	Dollar américain (819)	Franc suisse	7 décembre 2018	(1 085)	(1 086)	(1)
AA	345	Dollar américain (337)	Franc suisse	7 décembre 2018	(446)	(446)	–
AA	239	Dollar américain (233)	Franc suisse	7 décembre 2018	(309)	(309)	–
AA	76	Dollar américain (501)	Livre turque	7 décembre 2018	(98)	(103)	(5)
AA	38	Dollar américain (253)	Livre turque	7 décembre 2018	(49)	(51)	(2)
(Pertes) latentes						(1 200)	
Total des contrats de change à terme						1 109	
Total des instruments dérivés à la juste valeur						1 880	



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 revenus et des charges

Le revenu et les charges d'intérêts provenant des placements productifs d'intérêts sont comptabilisés au moyen de la méthode du taux d'intérêt effectif. Le revenu et les charges de dividendes sont constatés à 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 les charges, dans le profit (la perte) réalisé(e) à la vente de placements ou dans le revenu provenant des rabais sur les frais, selon le cas.

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.



NOTES ANNEXES

3. Principales méthodes comptables (suite)

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.

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.

l) Frais de vente à découvert et d'emprunt

Le Fonds effectue des ventes à découvert d'actions et d'obligations dans le cadre de sa stratégie de placement globale. Lorsqu'un Fonds procède à la vente à découvert d'une action ou d'une obligation, il doit emprunter ce titre d'un courtier et verser en échange des frais d'emprunt au courtier, afin de finaliser la vente. Le Fonds peut réaliser un gain sur la vente à découvert si le cours du titre diminue entre le moment de la vente à découvert et la date à laquelle le Fonds ferme sa position vendeur, en rachetant le titre à un cours inférieur et en le remettant au courtier. Une perte surviendra si le prix du titre augmente. Les restrictions prévues par la stratégie de placement du Fonds en matière de ventes à découvert comprennent ce qui suit : i) la valeur marchande globale de tous les titres vendus à découvert par le Fonds ne doit pas dépasser 50 % de l'actif net total du Fonds; ii) la valeur marchande globale de tous les titres d'un émetteur en particulier vendus à découvert par le Fonds ne doit pas dépasser 10 % de l'actif net total du Fonds; iii) le Fonds peut emprunter des liquidités correspondant à un maximum de 50 % de sa valeur liquidative; iv) la valeur marchande globale des titres vendus à découvert sera limitée à 50 % de sa valeur liquidative; et v) le recours à la vente à découvert combinée à l'emprunt de liquidités par le Fonds est assujéti à une limite globale de 50 % de sa valeur liquidative. Les gains et les pertes découlant de la vente à découvert d'actions et d'obligations sont comptabilisés à l'état du résultat global au poste Profit (perte) net(te) réalisé(e). Les dividendes et les intérêts versés découlant de la vente à découvert d'actions et d'obligations sont comptabilisés à l'état du résultat global aux postes Dividendes et Revenu d'intérêts, respectivement.



NOTES ANNEXES

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.

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.



NOTES ANNEXES

6. Frais de gestion et frais d'exploitation

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

Chaque série du Fonds 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 bénéfiques), 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.

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.

NOTES ANNEXES

8. Risques découlant des instruments financiers (suite)

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.

v. Autre risque de prix

L'autre risque de prix est le risque que la valeur des instruments financiers fluctue en fonction des variations des cours du marché (autres que celles découlant du risque de taux d'intérêt ou du risque de change), que ces variations découlent de facteurs propres à un placement individuel ou à son émetteur, ou d'autres facteurs ayant une incidence sur tous les instruments négociés sur un marché ou un segment du marché. Tous les placements présentent un risque de perte en capital. Ce risque est géré grâce à une sélection minutieuse de placements et d'autres instruments financiers conformes aux stratégies de placement. À l'exception de certains contrats dérivés et titres vendus à découvert, le risque maximal découlant des instruments financiers équivaut à leur juste valeur. Le risque maximal de perte sur certains contrats dérivés, comme des contrats à terme, 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. Dans le cas de titres vendus à découvert, 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. Ce risque est atténué au moyen de restrictions quant à la capacité du Fonds de vendre des titres à découvert. Ces restrictions sont décrites à la note 3I). 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.



FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

NOTES ANNEXES

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

a) Constitution du Fonds et renseignements sur les séries

Date de constitution 27 avril 2018

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

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

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

Les titres de série F sont offerts aux particuliers qui participent à un programme de services rémunérés à l'acte ou de comptes intégrés parrainé par le courtier, qui sont assujettis à des frais établis en fonction de l'actif plutôt qu'à des commissions pour chaque opération et qui investissent un minimum de 500 \$; ils sont également proposés aux employés de Mackenzie et de ses filiales, et aux administrateurs de Mackenzie.

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

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

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

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

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

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

Chaque série est offerte selon le mode de souscription avec frais d'acquisition. Les frais du mode de souscription avec frais d'acquisition sont négociés entre l'investisseur et son courtier. Pour de plus amples renseignements sur ce mode de souscription, veuillez vous reporter au prospectus simplifié du Fonds et à l'aperçu du Fonds.

Série	Date d'établissement/ de rétablissement	Frais de gestion	Frais d'administration	Valeur liquidative par titre (\$) 30 sept. 2018
Série A	23 mai 2018	2,25 %	0,28 %	9,96
Série F	23 mai 2018	1,15 %	0,15 %	10,00
Série FB	23 mai 2018	1,25 %	0,28 %	10,00
Série O	23 mai 2018	— ¹⁾	—*	10,05
Série PW	23 mai 2018	2,15 %	0,15 %	9,96
Série PWFB	23 mai 2018	1,15 %	0,15 %	10,01
Série PWX	23 mai 2018	— ²⁾	— ²⁾	10,05
Série R	23 mai 2018	—*	—*	9,97

* Sans objet.

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.

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

NOTES ANNEXES

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

b) Placements détenus par Mackenzie et d'autres fonds gérés par Mackenzie

Au 30 septembre 2018, Mackenzie et d'autres fonds gérés par Mackenzie détenaient un placement de 7 \$ et 254 748 \$, respectivement, dans le Fonds.

c) Reports prospectifs de pertes

Puisque le Fonds a été lancé le 27 avril 2018, il n'a pas encore eu de fin d'année d'imposition et n'a donc aucune perte en capital ni autre qu'en capital disponible pour un report prospectif aux fins de l'impôt.

d) Prêt de titres

Au 30 septembre 2018, aucune opération de prêt, de mise en pension ou de prise en pension de titres n'était en cours.

e) Dividendes et revenu d'intérêts

Des dividendes et des intérêts versés découlant de la vente à découvert de titres de 401 \$ et de 61 \$, respectivement, sont inclus dans les dividendes et le revenu d'intérêts pour la période close le 30 septembre 2018.

f) Effet de levier

Un effet de levier survient lorsque l'exposition théorique du Fonds aux actifs sous-jacents est supérieure au montant investi. Cet effet de levier ne peut pas dépasser 300 % de la valeur liquidative du Fonds. L'exposition théorique correspond au total des éléments suivants : i) la valeur marchande globale des positions acheteur du Fonds; ii) la valeur marchande globale des ventes à découvert de titres de capitaux propres, de titres à revenu fixe ou d'autres actifs en portefeuille; et iii) la valeur théorique globale des positions sur dérivés visés du Fonds, à l'exception des dérivés visés utilisés à des fins de couverture. Ce calcul exclut la trésorerie et autres actifs nets du Fonds.

Au cours de la période comprise entre la création du Fonds et le 30 septembre 2018, l'effet de levier du Fonds a varié entre 107,1 % et 236,6 % de la valeur liquidative du Fonds. Le bas de la fourchette a été atteint au lancement du Fonds, lorsque ses stratégies ont d'abord été mises en œuvre. Le haut de la fourchette a été atteint en septembre, lorsque le Fonds a augmenté son exposition aux marchés du crédit. Les principales sources de levier ont été les positions vendeur sur actions et obligations, et les positions acheteur sur contrats à terme, les positions vendeur sur contrats à terme et les swaps de rendement total.

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	1 873	(1 395)	—	478
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(1 497)	1 395	5 333	5 231
Obligation pour options vendues	—	—	—	—
Total	376	—	5 333	5 709

h) Risques découlant des instruments financiers

i. Exposition au risque et gestion du risque

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



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

NOTES ANNEXES

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

h) Risques découlant des instruments financiers (suite)

ii. Risque de change

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

Devise	30 septembre 2018			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)
Dollar américain	91 377	9 271	(82 003)	18 645
Livre turque	–	–	5 203	5 203
Yen japonais	1 890	27	1 618	3 535
Peso mexicain	639	–	2 337	2 976
Rand sud-africain	693	–	1 532	2 225
Dollar de Singapour	344	–	1 765	2 109
Euro	2 667	196	(1 013)	1 850
Rupiah indonésienne	–	–	617	617
Dollar de Hong Kong	590	(6)	–	584
Ringgit malaisien	422	–	–	422
Peso colombien	–	–	314	314
Forint hongrois	–	–	310	310
Real brésilien	–	–	296	296
Nouveau sol péruvien	–	–	(1)	(1)
Couronne norvégienne	–	–	(87)	(87)
Couronne danoise	(161)	(1)	–	(162)
Zloty polonais	–	–	(176)	(176)
Rouble russe	–	–	(281)	(281)
Livre sterling	(640)	38	270	(332)
Peso chilien	–	–	(355)	(355)
Couronne suédoise	978	24	(1 557)	(555)
Baht thaïlandais	–	–	(660)	(660)
Dollar taïwanais	–	–	(1 212)	(1 212)
Roupie indienne	–	–	(1 266)	(1 266)
Dollar néo-zélandais	366	–	(3 784)	(3 418)
Franc suisse	(2 519)	(4)	(1 230)	(3 753)
Dollar australien	(2 664)	87	(1 432)	(4 009)
Won sud-coréen	–	–	(4 623)	(4 623)
Shekel israélien	–	–	(5 497)	(5 497)
Total	93 982	9 632	(90 915)	12 699
% de l'actif net	33,9	3,5	(32,8)	4,6

* Comprend les instruments financiers monétaires et non monétaires.



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

NOTES ANNEXES

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

h) Risques découlant des instruments financiers (suite)

ii. Risque de change (suite)

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 635 \$ ou 0,2 % du total de l'actif net. En pratique, les résultats réels de négociation peuvent différer et l'écart pourrait être important.

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

Durée jusqu'à l'échéance	30 septembre 2018 (\$)			
	Obligations		Instruments dérivés	
	Positions acheteur	Positions vendeur	Positions acheteur	Positions vendeur
Moins de 1 an	–	(3 263)	118 222	(9 539)
1 an à 5 ans	–	(536)	–	–
5 ans à 10 ans	943	(334)	–	–
Plus de 10 ans	–	(20)	–	–
Total	943	(4 153)	118 222	(9 539)

Le Fonds est exposé indirectement au risque que la valeur des instruments financiers portant intérêt détenus par les FNB 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 11 249 \$ ou 4,1 % du total de l'actif net. 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 ses placements dans des titres de participation. 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 362 \$ ou 0,1 % du total de l'actif net. En pratique, les résultats réels de négociation peuvent différer et l'écart pourrait être important.

v. Risque de crédit

Au 30 septembre 2018, le Fonds n'avait aucune exposition importante au risque de crédit.



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2018

FONDS ALTERNATIF

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			
	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations – Positions acheteur	–	943	–	943
Obligations – Positions vendeur	–	(4 153)	–	(4 153)
Actions – Positions acheteur	94 193	–	–	94 193
Actions – Positions vendeur	(90 574)	–	–	(90 574)
Fonds/billets négociés en bourse	93 710	–	–	93 710
Actifs dérivés	1 096	2 602	–	3 698
Passifs dérivés	(618)	(1 200)	–	(1 818)
Placements à court terme	–	93 030	–	93 030
Total	97 807	91 222	–	189 029

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.

Conformément à la politique d'évaluation du Fonds, ce dernier applique des facteurs de rajustement à la juste valeur aux prix cotés pour les actions autres que nord-américaines lorsque les variations boursières intrajournalières nord-américaines dépassent les seuils de tolérance prédéterminés. Les facteurs de rajustement sont appliqués afin d'estimer l'incidence sur la juste valeur d'événements ayant lieu entre la clôture des marchés autres que nord-américains et la clôture pour le Fonds. Si des facteurs de rajustement de la juste valeur sont appliqués, les actions autres que nord-américaines sont classées dans le niveau 2. De ce fait, au cours de la période close le 30 septembre 2018, les actions autres que nord-américaines étaient fréquemment transférées entre le niveau 1 (prix non rajustés cotés) et le niveau 2 (prix rajustés). Au 30 septembre 2018, ces titres étaient classés dans le niveau 1.

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