

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

RAPPORT DE LA DIRECTION

Responsabilité de la direction en matière d'information financière

Les états financiers ci-joints ont été préparés par Corporation Financière Mackenzie, le gestionnaire du Fonds multistratégie à rendement absolu Mackenzie (le « Fonds »). Le gestionnaire est responsable de l'intégrité, de l'objectivité et de la fiabilité des données présentées. Cette responsabilité comprend le choix de principes comptables appropriés et la formulation de jugements et d'estimations conformes aux Normes internationales d'information financière. Le gestionnaire est également responsable de l'établissement de contrôles internes à l'égard du processus de présentation de l'information financière destinés à fournir une assurance raisonnable quant à la pertinence et à la fiabilité de l'information financière présentée.

Le conseil d'administration (le « conseil ») de Corporation Financière Mackenzie est responsable de l'examen et de l'approbation des états financiers ainsi que de la surveillance de la façon dont le gestionnaire s'acquitte de ses responsabilités quant à la présentation de l'information financière. Le conseil rencontre aussi régulièrement le gestionnaire, les auditeurs internes et les auditeurs externes afin de discuter des contrôles internes à l'égard du processus de présentation de l'information financière, des questions d'audit et des questions de présentation de l'information financière.

Le 31 mars 2023, KPMG s.r.l./S.E.N.C.R.L. a été nommé auditeur externe du Fonds. Il est nommé par le conseil. L'auditeur externe a audité les états financiers conformément aux normes d'audit généralement reconnues du Canada afin de lui permettre d'exprimer une opinion sur les états financiers à l'intention des porteurs de titres. Son rapport est présenté ci-dessous.

Au nom de Corporation Financière Mackenzie,
gestionnaire du Fonds

Le président et chef de la direction,



Luke Gould

Le chef des finances, Fonds,



Terry Rountes

Le 5 juin 2023

RAPPORT DE L'AUDITEUR INDÉPENDANT

Aux porteurs de titres du Fonds multistratégie à rendement absolu Mackenzie (le « Fonds »)

Opinion

Nous avons effectué l'audit des états financiers du Fonds, qui comprennent :

- l'état de la situation financière au 31 mars 2023;
- l'état du résultat global pour la période close à cette date, comme il est indiqué à la note 1;
- l'état de l'évolution de la situation financière pour la période close à cette date, comme il est indiqué à la note 1;
- le tableau des flux de trésorerie pour la période close à cette date, comme il est indiqué à la note 1;
- ainsi que les notes annexes, y compris le résumé des principales méthodes comptables; (ci-après, les « états financiers »).

À notre avis, les états financiers ci-joints donnent, dans tous leurs aspects significatifs, une image fidèle de la situation financière du Fonds au 31 mars 2023, ainsi que de sa performance financière et de ses flux de trésorerie pour la période close à cette date, comme il est indiqué à la note 1, conformément aux Normes internationales d'information financière (IFRS) publiées par l'International Accounting Standards Board (IASB).

Fondement de l'opinion

Nous avons effectué notre audit conformément aux normes d'audit généralement reconnues du Canada. Les responsabilités qui nous incombent en vertu de ces normes sont plus amplement décrites dans la section « Responsabilités de l'auditeur à l'égard de l'audit des états financiers » de notre rapport de l'auditeur.

Nous sommes indépendants du Fonds conformément aux règles de déontologie qui s'appliquent à notre audit des états financiers au Canada et nous nous sommes acquittés des autres responsabilités déontologiques qui nous incombent selon ces règles.

Nous estimons que les éléments probants que nous avons obtenus sont suffisants et appropriés pour fonder notre opinion d'audit.

Autre point – Informations comparatives

Les états financiers pour la période close le 31 mars 2022 ont été audités par un autre auditeur qui a exprimé sur ces états une opinion non modifiée en date du 15 juin 2022.



MACKENZIE
Placements

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

RAPPORT DE L'AUDITEUR INDÉPENDANT (suite)

Autres informations

La responsabilité des autres informations incombe à la direction. Les autres informations se composent :

– des informations contenues dans le rapport annuel de la direction sur le rendement du fonds.

Notre opinion sur les états financiers ne s'étend pas aux autres informations et nous n'exprimons et n'exprimerons aucune forme d'assurance que ce soit sur ces informations.

En ce qui concerne notre audit des états financiers, notre responsabilité consiste à lire les autres informations désignées ci-dessus et, ce faisant, à apprécier s'il existe une incohérence significative entre celles-ci et les états financiers ou la connaissance que nous avons acquise au cours de l'audit, et à demeurer attentifs aux éléments indiquant que les autres informations semblent comporter une anomalie significative.

Nous avons obtenu les informations contenues dans le rapport annuel de la direction sur le rendement du fonds déposé auprès des commissions des valeurs mobilières canadiennes compétentes à la date du présent rapport de l'auditeur. Si, à la lumière des travaux que nous avons effectués sur ces autres informations, nous concluons à la présence d'une anomalie significative dans ces autres informations, nous sommes tenus de signaler ce fait dans le rapport de l'auditeur.

Nous n'avons rien à signaler à cet égard.

Responsabilités de la direction et des responsables de la gouvernance à l'égard des états financiers

La direction est responsable de la préparation et de la présentation fidèle des états financiers conformément aux Normes internationales d'information financière (IFRS) publiées par l'International Accounting Standards Board (IASB), ainsi que du contrôle interne qu'elle considère comme nécessaire pour permettre la préparation d'états financiers exempts d'anomalies significatives, que celles-ci résultent de fraudes ou d'erreurs.

Lors de la préparation des états financiers, c'est à la direction qu'il incombe d'évaluer la capacité du Fonds à poursuivre son exploitation, de communiquer, le cas échéant, les questions relatives à la continuité de l'exploitation et d'appliquer le principe comptable de continuité d'exploitation, sauf si la direction a l'intention de liquider le Fonds ou de cesser son activité ou si aucune autre solution réaliste ne s'offre à elle.

Il incombe aux responsables de la gouvernance de surveiller le processus d'information financière du Fonds.

Responsabilités de l'auditeur à l'égard de l'audit des états financiers

Nos objectifs sont d'obtenir l'assurance raisonnable que les états financiers pris dans leur ensemble sont exempts d'anomalies significatives, que celles-ci résultent de fraudes ou d'erreurs, et de délivrer un rapport de l'auditeur contenant notre opinion.

L'assurance raisonnable correspond à un niveau élevé d'assurance, qui ne garantit toutefois pas qu'un audit réalisé conformément aux normes d'audit généralement reconnues du Canada permettra toujours de détecter toute anomalie significative qui pourrait exister.

Les anomalies peuvent résulter de fraudes ou d'erreurs et elles sont considérées comme significatives lorsqu'il est raisonnable de s'attendre à ce que, individuellement ou collectivement, elles puissent influencer sur les décisions économiques que les utilisateurs des états financiers prennent en se fondant sur ceux-ci.

Dans le cadre d'un audit réalisé conformément aux normes d'audit généralement reconnues du Canada, nous exerçons notre jugement professionnel et faisons preuve d'esprit critique tout au long de cet audit.

En outre :

- nous identifions et évaluons les risques que les états financiers comportent des anomalies significatives, que celles-ci résultent de fraudes ou d'erreurs, concevons et mettons en œuvre des procédures d'audit en réponse à ces risques, et réunissons des éléments probants suffisants et appropriés pour fonder notre opinion.
Le risque de non-détection d'une anomalie significative résultant d'une fraude est plus élevé que celui d'une anomalie significative résultant d'une erreur, car la fraude peut impliquer la collusion, la falsification, les omissions volontaires, les fausses déclarations ou le contournement du contrôle interne;
- nous acquérons une compréhension des éléments du contrôle interne pertinents pour l'audit afin de concevoir des procédures d'audit appropriées aux circonstances, et non dans le but d'exprimer une opinion sur l'efficacité du contrôle interne;
- nous apprécions le caractère approprié des méthodes comptables retenues et le caractère raisonnable des estimations comptables faites par la direction, de même que des informations y afférentes fournies par cette dernière;
- nous tirons une conclusion quant au caractère approprié de l'utilisation par la direction du principe comptable de continuité de l'exploitation et, selon les éléments probants obtenus, quant à l'existence ou non d'une incertitude significative liée à des événements ou situations susceptibles de jeter un doute important sur la capacité du Fonds à poursuivre son exploitation. Si nous concluons à l'existence d'une incertitude significative, nous sommes tenus d'attirer l'attention des lecteurs de notre rapport de l'auditeur sur les informations fournies dans les états financiers au sujet de cette incertitude ou, si ces informations ne sont pas adéquates, d'exprimer une opinion modifiée. Nos conclusions s'appuient sur les éléments probants obtenus jusqu'à la date de notre rapport de l'auditeur. Des événements ou situations futurs pourraient par ailleurs amener le Fonds à cesser son exploitation;
- nous évaluons la présentation d'ensemble, la structure et le contenu des états financiers, y compris les informations fournies dans les notes, et apprécions si les états financiers représentent les opérations et événements sous-jacents d'une manière propre à donner une image fidèle;
- nous communiquons aux responsables de la gouvernance notamment l'étendue et le calendrier prévus des travaux d'audit et nos constatations importantes, y compris toute déficience importante du contrôle interne que nous aurions relevée au cours de notre audit.



Comptables professionnels agréés, experts-comptables autorisés
Toronto (Ontario)
Le 5 juin 2023

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

au 31 mars (en milliers de \$, sauf les montants par titre)

	2023 \$	2022 \$
ACTIF		
Actifs courants		
Placements à la juste valeur	71 551	87 447
Trésorerie et équivalents de trésorerie	49 656	58 652
Intérêts courus à recevoir	398	322
Dividendes à recevoir	428	241
Sommes à recevoir pour placements vendus	221	192
Sommes à recevoir pour titres émis	–	77
Sommes à recevoir du gestionnaire	–	3
Marge sur instruments dérivés	2 807	4 158
Actifs dérivés	2 238	3 107
Total de l'actif	127 299	154 199
PASSIF		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert à la juste valeur	29 081	41 477
Sommes à payer pour placements achetés	223	144
Sommes à payer pour titres rachetés	77	–
Intérêts à payer sur les titres vendus à découvert	7	23
Dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	397	177
Sommes à payer au gestionnaire	11	–
Obligation pour options vendues	73	562
Passifs dérivés	1 734	3 695
Total du passif	31 603	46 078
Actif net attribuable aux porteurs de titres	95 696	108 121

	Actif net attribuable aux porteurs de titres (note 3)			
	par titre		par série	
	2023	2022	2023	2022
Série A	8,09	8,27	846	1 390
Série CL	8,95	8,94	4 435	4 028
série F	8,56	8,64	6 887	5 162
Série FB	8,47	8,58	1	1
Série O	9,02	9,01	233	1
Série PW	8,17	8,33	553	1 133
Série PWFB	8,64	8,69	1	1
Série PWX	9,03	9,02	547	23
Série R	8,95	8,94	69 116	84 593
Série S	9,63	9,61	13 077	11 789
			95 696	108 121

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

Pour les périodes closes les 31 mars
(en milliers de \$, sauf les montants par titre)

	2023 \$	2022 \$
Revenus (note 10j))		
Dividendes	1 169	821
Revenus d'intérêts aux fins de distribution	2 387	736
Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets		
Profit (perte) net(te) réalisé(e)	(4 251)	2 975
Profit (perte) net(te) latent(e)	1 823	(1 946)
Revenu provenant des rabais sur les frais	2	11
Total des revenus (pertes)	1 130	2 597
Charges (note 6)		
Frais de gestion	161	168
Frais d'administration	25	24
Intérêts débiteurs	57	12
Frais d'emprunt	155	922
Commissions et autres coûts de transaction liés au portefeuille	255	236
Frais du comité d'examen indépendant	–	–
Autre	1	–
Charges avant les montants absorbés par le gestionnaire	654	1 362
Charges absorbées par le gestionnaire	–	–
Charges nettes	654	1 362
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, avant impôt	476	1 235
Charge (économie) d'impôt étranger retenu à la source	132	93
Charge d'impôt étranger sur le résultat (recouvrée)	–	–
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation	344	1 142

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation (note 3)			
	par titre		par série	
	2023	2022	2023	2022
Série A	(0,20)	0,16	(30)	46
Série CL	0,06	(0,13)	30	(44)
série F	0,04	0,19	45	143
Série FB	(0,09)	–	–	–
Série O	0,08	0,84	18	6
Série PW	(0,17)	0,20	(32)	43
Série PWFB	(0,03)	0,03	–	–
Série PWX	(0,09)	(1,67)	(27)	(1)
Série R	0,03	0,12	260	1 129
Série S	0,06	(0,22)	80	(180)
			344	1 142

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

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

Pour les périodes closes les 31 mars
(en milliers de \$, sauf les montants par titre)

	Série PWX		Série R		Série S	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES						
À l'ouverture	23	1	84 593	79 881	11 789	3 858
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(27)	(1)	260	1 129	80	(180)
Distributions aux porteurs de titres :						
Revenu de placement	(18)	–	(297)	–	(51)	–
Gains en capital	–	–	–	–	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	(18)	–	(297)	–	(51)	–
Opérations sur les titres :						
Produit de l'émission de titres	11 376	23	1 017	9 727	2 534	8 521
Réinvestissement des distributions	18	–	–	–	51	–
Paiements au rachat de titres	(10 825)	–	(16 457)	(6 144)	(1 326)	(410)
Total des opérations sur les titres	569	23	(15 440)	3 583	1 259	8 111
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	524	22	(15 477)	4 712	1 288	7 931
À la clôture	547	23	69 116	84 593	13 077	11 789
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :	Titres		Titres		Titres	
Titres en circulation, à l'ouverture	3	–	9 461	9 071	1 226	407
Émis	1 267	3	114	1 056	266	860
Réinvestissement des distributions	2	–	–	–	5	–
Rachetés	(1 211)	–	(1 857)	(666)	(138)	(41)
Titres en circulation, à la clôture	61	3	7 718	9 461	1 359	1 226

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

Pour les périodes closes les 31 mars (en milliers de \$)

	2023	2022
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation	344	1 142
Ajustements pour :		
Perte (profit) net(te) réalisé(e) sur les placements	3 365	(1 040)
Variation de la perte (du profit) net(te) latent(e) sur les placements	(1 823)	1 946
Achat de placements	(100 294)	(186 286)
Produit de la vente et de l'échéance de placements	100 616	164 035
(Augmentation) diminution des sommes à recevoir et autres actifs	1 091	(366)
Augmentation (diminution) des sommes à payer et autres passifs	215	(95)
Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités d'exploitation	3 514	(20 664)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de titres	32 067	22 486
Paiements au rachat de titres	(44 364)	(15 746)
Distributions versées, déduction faite des réinvestissements	(318)	—
Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités de financement	(12 615)	6 740
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie	(9 101)	(13 924)
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à l'ouverture	58 652	72 484
Incidence des fluctuations des taux de change sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie	105	92
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture	49 656	58 652
Trésorerie	25 105	35 332
Équivalents de trésorerie	24 551	23 320
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture	49 656	58 652
Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :		
Dividendes reçus	2 040	1 624
Dividendes versés	838	795
Impôts étrangers payés	132	93
Intérêts reçus	2 391	646
Intérêts versés	153	242

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS

au 31 mars 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
POSITIONS ACHETEUR					
OBLIGATIONS					
Algonquin Power & Utilities Corp., taux variable 18-01-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	269 000	255	217
Alphabet Inc. 2,25 % 15-08-2060	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	40 000 USD	35	33
AltaGas Ltd., taux variable 11-01-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	151 000	144	122
AltaGas Ltd., taux variable 17-08-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	66 000	66	64
Altice France SA 2,13 % 15-02-2025	France	Sociétés – Non convertibles	100 000 EUR	146	136
Altice France SA 5,13 % 15-07-2029	France	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	206	204
Altice International SARL 5,00 % 15-01-2028, rachetables 2023 144A	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	227	220
Apple Inc. 2,40 % 20-08-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	70 000 USD	66	63
Arcos Dorados BV 6,13 % 27-05-2029	Brésil	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	255	258
Ardagh Metal Packaging 4,00 % 01-09-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	33 000 USD	43	35
Ardagh Packaging Finance PLC 5,25 % 15-08-2027 (émission de 2019) 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	188	214
Ardagh Packaging Finance PLC 5,25 % 15-08-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	92 000 USD	105	99
Artis Real Estate Investment Trust 5,60 % 29-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000	100	97
Ashton Woods USA LLC 4,63 % 01-08-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	156 000 USD	191	173
Atlantica Sustainable Infrastructure PLC 4,13 % 15-06-2028 144A	Espagne	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	244	245
AutoCanada Inc. 5,75 % 07-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000	100	86
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000	264	231
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000	50	50
Black Knight InfoServ LLC 3,63 % 01-09-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	56 000 USD	70	69
BlueLinx Holdings Inc. 6,00 % 15-11-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	50 000 USD	62	56
Broadcast Media Partners Holdings Inc. 4,50 % 01-05-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	72 000 USD	90	82
Brookfield Residential Properties Inc. 5,13 % 15-06-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	119 000	120	96
California Resources Corp. 7,13 % 01-02-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	102 000 USD	132	140
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 28-07-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	38 000	38	37
Capital Power Corp., taux variable 09-09-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	174 000	174	171
Carnival Corp. 9,88 % 01-08-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	35 000 USD	51	49
Carriage Purchaser Inc. 7,88 % 15-10-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	86 000 USD	101	88
Cascades inc. 5,13 % 15-01-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	150 000	146	145
Cascades inc. 5,13 % 15-01-2026, rachetables 2023 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	102 000 USD	137	132
CCO Holdings LLC 4,25 % 01-02-2031, rachetables 2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	68 000 USD	74	76
Charter Communications Operating LLC 4,50 % 01-05-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	75 000 USD	84	83
Clearway Energy Group LLC 3,75 % 15-02-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	30 000 USD	35	35
Clearway Energy LLC 3,75 % 15-01-2032 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	40 000 USD	51	45
Clydesdale Acquisition Holdings Inc. 8,75 % 15-04-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	70 000 USD	83	85
Cogent Communications Group Inc. 7,00 % 15-06-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	48 000 USD	61	64
Coinbase Global Inc. 3,63 % 01-10-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	242 000 USD	175	183
Cologix Data Centers Issuer LLC 4,94 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	102 000	102	94
Cologix Data Centers Issuer LLC 5,68 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	81 000	81	75
Columbia Care Inc. 6,00 % 29-06-2025, conv.	Canada	Sociétés – Convertibles	89 000 USD	117	120
CommScope Inc. 4,75 % 01-09-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	41 000 USD	52	46
CommScope Technologies Finance LLC 8,25 % 01-03-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	151 000 USD	180	166
Condor Merger Sub Inc. 7,38 % 15-02-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	91 000 USD	111	103
Connect Finco SARL 6,75 % 01-10-2026	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	263	255
Continental Resources Inc. 5,75 % 15-01-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	35 000 USD	53	45
Corus Entertainment Inc. 5,00 % 11-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	190 000	184	142
Country Garden Holdings Co. Ltd. 2,70 % 12-07-2026	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	171	172
Covert Mergerco Inc. 4,88 % 01-12-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000 USD	12	12
Crocs Inc. 4,25 % 15-03-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	40 000 USD	52	48
Crown Americas LLC 5,25 % 01-04-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	125 000 USD	160	164
CSC Holdings LLC 4,63 % 01-12-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	234	134
Curaleaf Holdings Inc. 8,00 % 15-12-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	60 000 USD	77	67
Dana Inc. 4,50 % 15-02-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	175 000 USD	187	192
DaVita Inc. 3,75 % 15-02-2031, rachetables 2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	143 000 USD	174	153
Diamond Sports Group LLC 5,38 % 15-08-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	128 000 USD	100	10
Diamond Sports Group LLC 6,63 % 15-08-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	66 000 USD	32	1
Domtar Corp. 6,75 % 01-10-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	178 000 USD	225	215
Ecopetrol SA 4,63 % 02-11-2031	Colombie	Sociétés – Non convertibles	62 000 USD	74	65

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
POSITIONS ACHETEUR (suite)					
OBLIGATIONS (suite)					
Eldorado Gold Corp. 6,25 % 01-09-2029 144A	Turquie	Sociétés – Non convertibles	31 000 USD	39	39
Embeta Corp. 5,00 % 15-02-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	44 000 USD	54	51
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	262 000	275	243
Enel SPA 2,25 % 12-07-2031 144A	Italie	Sociétés – Non convertibles	45 000 USD	46	48
Ensign Drilling Inc. 9,25 % 15-04-2024 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	103 000 USD	125	135
Expedia Group Inc. 2,95 % 15-03-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	47 000 USD	50	53
Fair Isaac Corp. 4,00 % 15-06-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	65 000 USD	78	82
Compagnie Crédit Ford du Canada 2,96 % 16-09-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	299 000	279	266
Ford Motor Co. 3,25 % 12-02-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	48 000 USD	50	51
Ford Motor Credit Co. LLC 2,70 % 10-08-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	92 000 USD	111	111
Frontier Communications Corp. 5,88 % 15-10-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	33 000 USD	45	41
Frontier Communications Corp. 6,75 % 01-05-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	61 000 USD	72	66
FXI Holdings Inc. 7,88 % 01-11-2024 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	7 000 USD	9	9
Corporation de Sécurité Garda World 6,00 % 01-06-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	150 000 USD	151	162
Gibson Energy Inc., taux variable 22-12-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	193 000	191	164
GoDaddy Operating Co. LLC 3,50 % 01-03-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	113 000 USD	136	132
Gray Escrow Inc. 7,00 % 15-05-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	88 000 USD	107	100
Gray Television Inc. 5,38 % 15-11-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	211 000 USD	268	188
Gulfport Energy Corp. 8,00 % 17-05-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	28 000 USD	38	38
Hadrian Merger Sub Inc. 8,50 % 01-05-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	85 000 USD	114	95
Hilton Domestic Operating Co. Inc. 4,88 % 15-01-2030, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	47 000 USD	57	61
Innovative Industrial Properties Inc. 5,50 % 25-05-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	56 000 USD	75	65
Inter Pipeline Ltd., taux variable 26-03-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000	243	241
Inter Pipeline Ltd., taux variable 19-11-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	180 000	196	169
International Game Technology PLC 2,38 % 15-04-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 EUR	111	130
Iris Escrow Issuer Corp. 10,00 % 15-12-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	160 000 USD	187	160
Iris Merger Sub 2019 Inc. 9,38 % 15-02-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	81 000 USD	112	112
Iron Mountain Inc. 5,00 % 15-07-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	61 000 USD	79	77
Iron Mountain Inc. 5,25 % 15-07-2030, rachetables 2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	21 000 USD	28	26
Jabil Inc. 3,00 % 15-01-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	91 000 USD	105	104
Jazz Pharmaceuticals PLC 4,38 % 15-01-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	266	248
Kaisa Group Holdings Ltd. 10,50 % 24-02-2023	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	92	34
Kaisa Group Holdings Ltd. 8,50 % 24-02-2023	Chine	Sociétés – Non convertibles	400 000 USD	173	69
Kaisa Group Holdings Ltd. 8,65 % 24-02-2023	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	91	34
Keyera Corp., taux variable 10-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000	199	175
Keyera Corp., taux variable 13-06-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	290 000	307	278
Kleopatra Fincos SARL 4,25 % 01-03-2026	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	100 000 EUR	121	123
Kronos Acquisition Holdings Inc. 5,00 % 31-12-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	29 000 USD	36	36
Produits Kruger S.E.C. 5,38 % 09-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	165 000	169	142
Produits Kruger S.E.C. 6,00 % 24-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000	192	193
L Brands Inc. 6,63 % 01-10-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	45 000 USD	58	59
LABL Escrow Issuer LLC 10,50 % 15-07-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	80 000 USD	99	101
LABL Escrow Issuer LLC 6,75 % 15-07-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	182 000 USD	235	238
LABL Inc. 8,25 % 01-11-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	22 000 USD	26	25
Banque Laurentienne du Canada, taux variable 15-06-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	300 000	291	230
Level 3 Financing Inc. 3,75 % 15-07-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	18 000 USD	22	13
Lions Gate Entertainment Inc. 5,50 % 15-04-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	38 000 USD	49	34
Logan Group Co. Ltd. 4,70 % 06-07-2026	Chine	Sociétés – Non convertibles	404 000 USD	282	127
Magallanes Inc. 4,28 % 15-03-2032 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000 USD	23	24
Société Financière Manuvie, taux variable 19-06-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	38 000	38	37
Marriott International Inc. 4,90 % 15-04-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	24 000 USD	32	32
Mattamy Group Corp. 4,63 % 01-03-2030, rachetables 2025 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	41 000 USD	44	49
Mattel Inc. 3,38 % 01-04-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	86 000 USD	111	110
Mattel Inc. 3,75 % 01-04-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000 USD	24	24
Mauser Packaging Solutions 9,25 % 15-04-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	113 000 USD	151	141
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 7,88 % 15-08-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	62 000 USD	83	84
Mav Acquisition Corp. 5,75 % 01-08-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	170 000 USD	210	200
MEDNAX Inc. 5,38 % 15-02-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	24 000 USD	27	29
MEG Energy Corp. 5,88 % 01-02-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	162 000 USD	205	210

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
POSITIONS ACHETEUR (suite)					
OBLIGATIONS (suite)					
MEG Energy Corp. 7,13 % 01-02-2027, rachetables 2023 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	122 000 USD	161	169
Mercer International Inc., taux variable 01-02-2029	Allemagne	Sociétés – Non convertibles	28 000 USD	36	32
Microsoft Corp. 2,68 % 01-06-2060	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000 USD	19	19
Minerva Merger Sub Inc. 6,50 % 15-02-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	161 000 USD	199	177
Molina Healthcare Inc. 3,88 % 15-05-2032 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000 USD	25	23
Mozart Debt Merger Sub Inc. 3,88 % 01-04-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	145 000 USD	179	170
Mozart Debt Merger Sub Inc. 5,25 % 01-10-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	215 000 USD	268	253
Murphy Oil USA Inc. 3,75 % 15-02-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	122 000 USD	140	140
Nabors Industries Ltd. 7,25 % 15-01-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	31 000 USD	36	40
Banque Nationale du Canada, taux variable 15-08-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000	86	74
Banque Nationale du Canada, taux variable 16-11-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000	41	40
New Red Finance Inc. 4,00 % 15-10-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	88 000 USD	109	102
NuVista Energy Ltd. 7,88 % 23-07-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	102 000	102	104
Open Text Corp. 3,88 % 01-12-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	82 000 USD	96	94
Open Text Holdings Inc. 4,13 % 01-12-2031 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	14 000 USD	16	16
Corporation Parkland 4,38 % 26-03-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	214 000	202	186
Corporation Parkland du Canada 4,50 % 01-10-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	372 000 USD	470	448
Pattern Energy Operations LP 4,50 % 15-08-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	41 000 USD	55	52
Pembina Pipeline Corp., taux variable 25-01-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	357 000	339	298
Perrigo Co. PLC 3,15 % 15-06-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	24 000 USD	27	29
Petróleos Mexicanos 6,70 % 16-02-2032	Mexique	Sociétés – Non convertibles	24 000 USD	31	26
PharmaCann LLC 12,00 % 30-06-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	90 000 USD	115	114
Pilgrim's Pride Corp. 3,50 % 01-03-2032 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	46 000 USD	50	50
Rogers Communications Inc., taux variable 15-03-2082 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	190 000 USD	241	226
Rogers Communications Inc., taux variable 17-12-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	126 000	126	115
Banque Royale du Canada, taux variable 24-11-2080, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	450 000	444	420
Sealed Air Corp. 6,13 % 01-02-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000 USD	14	14
Seaspan Corp. 5,50 % 01-08-2029 144A	Hong Kong	Sociétés – Non convertibles	37 000 USD	48	39
Secure Energy Services Inc. 7,25 % 30-12-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	264 000	267	260
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 4,75 % 05-08-2029	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	107	107
Source energy Services 10,50 % 15-03-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	89 850	51	70
Southwestern Energy Co. 4,75 % 01-02-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	75 000 USD	90	89
Square Inc. 2,75 % 01-06-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	110 000 USD	135	136
Sunac China Holdings Ltd. 5,95 % 26-04-2024	Chine	Sociétés – Non convertibles	214 000 USD	79	70
Supérieur Plus S.E.C. 4,25 % 18-05-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	266 000	262	236
Supérieur Plus S.E.C. 4,50 % 15-03-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	81 000 USD	107	98
Tacora Resources Inc. 8,25 % 15-05-2026 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	23 000 USD	31	23
Tamarack Valley Energy Ltd. 7,25 % 10-05-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	207 000	200	198
TEGNA Inc. 4,63 % 15-03-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	51 000 USD	66	61
Tenet Health 6,13 % 01-10-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	80 000 USD	100	103
Tenet Healthcare 4,25 % 01-06-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	147 000 USD	182	180
Tenet Healthcare Corp. 4,38 % 15-01-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	85 000 USD	105	104
TerraForm Power Operating LLC 4,75 % 15-01-2030, rachetables 2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	41 000 USD	55	51
TerraForm Power Operating LLC 5,00 % 31-01-2028, rachetables 2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	135	129
La Banque de Nouvelle-Écosse 2,38 % 01-05-2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	107 000	106	107
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 27-07-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	38 000	38	37
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 15-09-2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	403 000 USD	505	544
The Goodyear Tire & Rubber Co. 5,00 % 15-07-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	40 000 USD	47	48
La Banque Toronto-Dominion 1,91 % 18-07-2023, série DPNT	Canada	Sociétés – Non convertibles	91 000	89	90
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-01-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	330 000	325	328
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 22-04-2030, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	104 000	107	99
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-10-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000	100	74
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-10-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000	50	50
TopBuild Corp. 4,13 % 15-02-2032 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	119 000 USD	143	138
TransAlta Corp. 7,75 % 15-11-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	60 000 USD	80	85
TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	412 000	424	371

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
POSITIONS ACHETEUR (suite)					
OBLIGATIONS (suite)					
Trulieve Cannabis Corp. 8,00 % 06-10-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	110 000 USD	131	119
Trulieve Cannabis Corp. 9,75 % 18-06-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	24 000 USD	33	31
Uber Technologies Inc. 4,50 % 15-08-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	50 000 USD	57	62
Uber Technologies Inc. 6,25 % 15-01-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	85 000 USD	117	115
Uber Technologies Inc. 8,00 % 01-11-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	90 000 USD	126	125
Obligations du Trésor des États-Unis 1,88 % 28-02-2027	États-Unis	Gouvernements étrangers	1 300 000 USD	1 618	1 641
Vermilion Energy Inc. 6,88 % 01-05-2030 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	270 000 USD	335	334
Viasat Inc. 6,50 % 15-07-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	82 000 USD	110	82
Vidéotron Itée 3,13 % 15-01-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	217 000	204	173
Vidéotron Itée 4,50 % 15-01-2030, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000	207	178
Vidéotron Itée 5,13 % 15-04-2027 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	173 000 USD	226	226
Vidéotron Itée 5,75 % 15-01-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000	98	99
VistaJet Malta Finance PLC 6,38 % 01-02-2030 144A	Suisse	Sociétés – Non convertibles	220 000 USD	275	266
VMED O2 UK Financing I PLC 4,25 % 31-01-2031	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	256	230
Weatherford International Ltd. 8,63 % 30-04-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	340 000 USD	426	467
Weatherford International PLC 11,00 % 01-12-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 000 USD	3	3
WeWork Inc. 5,00 % 10-07-2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	24 000 USD	26	17
WildBrain Ltd. 5,88 % 30-09-2024, conv.	Canada	Sociétés – Convertibles	142 000	138	133
Ziggo BV 4,88 % 15-01-2030, rachetables 2024 144A	Pays-Bas	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	225	230
Total des obligations				26 369	24 667
ACTIONS					
1-800-FLOWERS.COM Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	17 950	270	279
2U Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	400	3	4
3SBio Inc.	Chine	Soins de santé	16 000	23	22
8x8 Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	35 860	286	202
Abcam PLC	Royaume-Uni	Soins de santé	1 880	40	34
Acco Brands Corp.	États-Unis	Produits industriels	5 400	58	39
Adeia Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	18 200	230	218
Advantage Energy Ltd.	Canada	Énergie	74 400	197	581
Advantest Corp.	Japon	Technologie de l'information	500	35	63
Aena SA	Espagne	Produits industriels	84	17	18
Aéroports de Paris	France	Produits industriels	48	10	9
Aier Eye Hospital Group Co. Ltd., cat. A	Chine	Soins de santé	11 900	72	73
Air Canada	Canada	Produits industriels	2 335	42	45
Air China Ltd., H	Chine	Produits industriels	54 000	61	66
Air France-KLM	France	Produits industriels	13 079	20	33
AirBoss of America Corp.	Canada	Matériaux	900	8	7
Airbus SE	France	Produits industriels	43	7	8
Alcoa Corp.	États-Unis	Matériaux	40	2	2
Alibaba Group Holding Ltd.	Chine	Consommation discrétionnaire	11 450	211	197
Alk-Abelló AS	Danemark	Soins de santé	1 203	25	25
Alps Alpine Co. Ltd.	Japon	Technologie de l'information	3 600	45	47
ALTEN	France	Technologie de l'information	71	14	15
American International Group Inc.	États-Unis	Services financiers	529	37	36
Amicus Therapeutics Inc.	États-Unis	Soins de santé	15 356	222	230
AMP Ltd.	Australie	Services financiers	2 125	3	2
Amplitude Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	100	2	2
Andritz AG	Autriche	Produits industriels	265	19	24
Anheuser-Busch InBev NV	Belgique	Consommation de base	170	14	15
Anhui Gujing Distillery Co. Ltd.	Chine	Consommation de base	1 500	31	36
Anyang Iron & Steel Inc.	Chine	Matériaux	22 400	10	9
APA Group	Australie	Services publics	2 802	26	26
Apellis Pharmaceuticals Inc.	États-Unis	Soins de santé	2 700	237	241
Applied Materials Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	239	44	40
AppLovin Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	209	4	4
ARC Resources Ltd.	Canada	Énergie	36 752	294	563
ArcelorMittal SA	Luxembourg	Matériaux	228	9	9
Arcos Dorados Holdings Inc.	Brésil	Consommation discrétionnaire	24 010	176	250
Arhaus Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	12 600	226	141

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
POSITIONS ACHETEUR (suite)					
ACTIONS (suite)					
Arista Networks Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	90	14	20
Asana Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	159	5	5
Astellas Pharma Inc.	Japon	Soins de santé	700	14	13
ATCO Ltd., cat. I, sans droit de vote	Canada	Services publics	500	21	22
Atkore International Group Inc.	États-Unis	Produits industriels	100	14	19
Atlassian Corp. PLC, cat. A	États-Unis	Technologie de l'information	146	33	34
Auckland International Airport Ltd.	Nouvelle-Zélande	Produits industriels	2 607	19	19
Aurora Innovation Inc.	États-Unis	Produits industriels	4 200	7	8
Aurubis AG	Allemagne	Matériaux	147	20	18
Auto Trader Group PLC	Royaume-Uni	Services de communication	5 046	50	52
AutoZone Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	11	28	37
Azimut Holding SPA	Italie	Services financiers	1 522	44	44
Baidu Inc., CAAE	Chine	Services de communication	48	9	10
Balfour Beatty PLC	Royaume-Uni	Produits industriels	8 818	40	55
Banca Mediolanum SPA	Italie	Services financiers	1 153	14	14
Banco de Sabadell SA	Espagne	Services financiers	26 291	33	38
Bank Hapoalim	Israël	Services financiers	3 562	41	40
Bank of Hangzhou Co. Ltd.	Chine	Services financiers	47 800	119	110
Bank of Jiangsu Co. Ltd., cat. A	Chine	Services financiers	5 600	8	8
Bank of Nanjing Co. Ltd.	Chine	Services financiers	13 900	26	25
Bavarian Nordic AS	Danemark	Soins de santé	119	5	5
BAWAG Group AG	Autriche	Services financiers	170	12	11
BCE Inc.					
4,54 %, à div. cumulatif, rachetables, priv. de premier rang, série R, rachetables	Canada	Services de communication	361	7	5
BCE Inc., priv., série AA	Canada	Services de communication	277	5	5
BCE Inc., priv., série AL	Canada	Services de communication	125	2	2
Beijing Capital International Airport Co. Ltd., H	Chine	Produits industriels	54 000	52	54
Beijing United Information Technology Co. Ltd.	Chine	Produits industriels	6 300	128	103
Beijing-Shanghai High Speed Railway Co. Ltd.	Chine	Produits industriels	15 800	16	16
Betsson AB, cat. B	Suède	Consommation discrétionnaire	696	6	9
BGC Partners Inc., cat. A	États-Unis	Services financiers	1 600	8	11
BioCryst Pharmaceuticals Inc.	États-Unis	Soins de santé	18 160	291	205
Blink Charging Co.	États-Unis	Produits industriels	1 100	28	13
BlueScope Steel Ltd.	Australie	Matériaux	2 267	40	42
Bombardier Inc., cat. B, à droit de vote subalterne	Canada	Produits industriels	392	26	29
Booking Holdings Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	3	10	11
Boral Ltd.	Australie	Matériaux	3 768	10	12
BOW Technology Group Co. Ltd., cat. A	Chine	Technologie de l'information	141 900	116	124
BP PLC, CAAE	Royaume-Uni	Énergie	13 000	610	667
Brandywine Realty Trust	États-Unis	Biens immobiliers	6 500	52	42
British American Tobacco PLC	Royaume-Uni	Consommation de base	354	18	17
Brixmor Property Group Inc.	États-Unis	Biens immobiliers	672	20	20
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 46	Canada	Biens immobiliers	155	4	3
Brookfield Renewable Partners L.P., priv., série 13	Canada	Services publics	131	3	3
BRP inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	341	32	36
Brunello Cucinelli SPA	Italie	Consommation discrétionnaire	144	13	19
BYD Co. Ltd., H	Chine	Consommation discrétionnaire	4 500	189	179
BYD Electronic International Co. Ltd.	Chine	Technologie de l'information	9 500	42	40
Cadence Design Systems Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	141	32	40
California Resources Corp.	États-Unis	Énergie	8 300	314	432
Canadian Natural Resources Ltd.	Canada	Énergie	9 900	375	740
La Société Canadian Tire Ltée, cat. A, sans droit de vote	Canada	Consommation discrétionnaire	13	2	2
Capital Power Corp.	Canada	Services publics	969	48	40
Carrefour SA	France	Consommation de base	1 917	42	52
CCL Industries Inc., cat. B, sans droit de vote	Canada	Matériaux	663	42	45
Celestica Inc., à droit de vote subalterne	Canada	Technologie de l'information	2 770	30	48
Cenovus Energy Inc., priv., série 3	Canada	Énergie	49	1	1
Cenovus Energy Inc., priv., série 7	Canada	Énergie	412	9	8
Centennial Resource Development Inc.	États-Unis	Énergie	16 500	184	234
Chengdu CORPRO Technology Co. Ltd.	Chine	Technologie de l'information	400	2	2

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
POSITIONS ACHETEUR (suite)					
ACTIONS (suite)					
Chervon Holdings Ltd.	Chine	Consommation discrétionnaire	900	7	6
Chesapeake Energy Corp.	États-Unis	Énergie	2 050	169	211
China BlueChemical Ltd., H	Chine	Matériaux	146 000	60	51
China Construction Bank Corp., H	Chine	Services financiers	186 000	166	163
China Datang Corp. Renewable Power Co. Ltd., cat. H	Chine	Services publics	106 000	41	51
China Merchants Bank Co. Ltd., H	Chine	Services financiers	1 000	7	7
China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co. Ltd.	Chine	Biens immobiliers	7 800	21	21
China National Accord Medicines Corp. Ltd., cat. B	Chine	Soins de santé	6 600	20	20
China National Medicines Corp. Ltd.	Chine	Soins de santé	2 100	14	15
China Oilfield Services Ltd., H	Chine	Énergie	2 000	3	3
China Oriental Group Co. Ltd.	Chine	Matériaux	40 000	11	10
China Pacific Insurance (Group) Co. Ltd.	Chine	Services financiers	800	2	3
China Petroleum and Chemical Corp., H (Sinopec)	Chine	Énergie	106 000	68	84
China Resources Phoenix Healthcare Holdings Co. Ltd.	Chine	Soins de santé	23 035	28	27
China Southern Airlines Co. Ltd.	Chine	Produits industriels	78 458	65	76
China Tower Corp. Ltd.	Chine	Services de communication	628 000	103	103
China Unicom (Hong Kong) Ltd.	Chine	Services de communication	108 600	83	116
Chiyoda Corp.	Japon	Produits industriels	12 200	48	49
Chubb Ltd.	États-Unis	Services financiers	131	32	34
Chubu Electric Power Co. Inc.	Japon	Services publics	3 100	41	44
Cineworld Group PLC	Royaume-Uni	Services de communication	152 932	42	7
Cintas Corp.	États-Unis	Produits industriels	24	15	15
Cisco Systems Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	294	16	21
Citizens Financial Group Inc.	États-Unis	Services financiers	292	14	12
Clear Secure Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	100	4	4
CNOOC Energy Technology & Services Ltd.	Chine	Énergie	90 200	57	59
Coca-Cola European Partners PLC	Royaume-Uni	Consommation de base	694	45	56
Coca-Cola HBC AG-DI	Suisse	Consommation de base	1 345	44	50
Cochlear Ltd.	Australie	Soins de santé	185	38	40
Coherus BioSciences Inc.	États-Unis	Soins de santé	21 280	319	197
Colgate-Palmolive Co.	États-Unis	Consommation de base	359	36	36
CommScope Holding Co. Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	23 704	343	204
Compagnie des Alpes	France	Consommation discrétionnaire	2 143	44	40
Compagnie Financière Richemont SA	Suisse	Consommation discrétionnaire	254	49	55
Compass Inc.	États-Unis	Biens immobiliers	500	2	2
Contemporary Amperex Technology Co. Ltd.	Chine	Produits industriels	2 100	218	169
Corebridge Financial Inc.	États-Unis	Services financiers	751	16	16
CT Real Estate Investment Trust	Canada	Biens immobiliers	900	15	14
CTS EVENTIM AG & Co. KGaA	Allemagne	Services de communication	456	35	38
CVS Health Corp.	États-Unis	Soins de santé	258	33	26
CymaBay Therapeutics Inc.	États-Unis	Soins de santé	23 590	266	278
Daan Gene Co. Ltd.	Chine	Soins de santé	2 000	6	6
Daito Trust Construction Co. Ltd.	Japon	Biens immobiliers	300	44	41
Dalata Hotel Group PLC	Irlande	Consommation discrétionnaire	3 462	18	21
Dart Group PLC	Royaume-Uni	Produits industriels	2 415	47	53
DB HiTek Co. Ltd.	Corée du Sud	Technologie de l'information	674	38	51
Deutsche Lufthansa AG, nom.	Allemagne	Produits industriels	3 401	27	51
Devon Energy Corp.	États-Unis	Énergie	7 400	391	507
Diamondback Energy Inc.	États-Unis	Énergie	4 000	753	731
DocuSign Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	664	36	52
Domo Inc., cat. B	États-Unis	Technologie de l'information	700	27	13
Doximity Inc.	États-Unis	Soins de santé	112	5	5
Drax Group PLC	Royaume-Uni	Services publics	56	1	1
Dropbox Inc., cat. A	États-Unis	Technologie de l'information	959	29	28
Dufry Group, nom.	Suisse	Consommation discrétionnaire	858	39	52
East West Bancorp Inc.	États-Unis	Services financiers	500	47	38
Eiffage SA	France	Produits industriels	345	42	51
Elanco Animal Health Inc.	États-Unis	Soins de santé	166	2	2
Electronic Arts Inc.	États-Unis	Services de communication	239	38	39
Element Fleet Management Corp.	Canada	Services financiers	190	3	3
Elmos Semiconductor AG	Allemagne	Technologie de l'information	49	6	6

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
POSITIONS ACHETEUR (suite)					
ACTIONS (suite)					
Emera Inc., priv., série J	Canada	Services publics	16	–	–
Emera Inc., priv., série L	Canada	Services publics	2 220	56	41
Emerson Electric Co.	États-Unis	Produits industriels	312	37	37
Empire State Realty Trust Inc.	États-Unis	Biens immobiliers	1 000	9	9
Enerflex Ltd.	Canada	Énergie	2 400	16	19
Enfusion Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	1 700	24	24
ENGIE SA	France	Services publics	2 517	45	54
en Japan Inc.	Japon	Produits industriels	200	4	5
Esperion Therapeutics Inc.	États-Unis	Soins de santé	31 620	310	68
Essent Group Ltd.	États-Unis	Services financiers	531	27	29
Essential Energy Services Ltd.	Canada	Énergie	252 000	83	83
Evercore Partners Inc., cat. A	États-Unis	Services financiers	139	20	22
Excellence Commercial Property & Facilities Management Group Ltd.	Chine	Biens immobiliers	2 000	1	1
Expedia Group Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	260	47	34
Expensify Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	400	5	4
Fairfax Financial Holdings Ltd., priv., série E	Canada	Services financiers	54	1	1
Fastighets AB Balder	Suède	Biens immobiliers	7 037	51	39
Ferrotec Corp.	Japon	Technologie de l'information	1 100	32	38
FinecoBank Banca Fineco SPA	Italie	Services financiers	482	8	10
Fletcher Building Ltd.	Nouvelle-Zélande	Produits industriels	426	2	2
Flight Centre Travel Group Ltd.	Australie	Consommation discrétionnaire	2 518	40	42
FMC Corp.	États-Unis	Matériaux	187	27	31
Fortinet Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	272	18	24
Fortress Real Estate Investments Ltd., cat. B	Afrique du Sud	Biens immobiliers	137 606	46	47
Freshworks Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	300	6	6
Frontier Developments PLC	Royaume-Uni	Services de communication	1 809	14	14
Fufeng Group Ltd.	Chine	Matériaux	22 000	15	17
General Electric Co.	États-Unis	Produits industriels	214	22	28
Genmab AS	Danemark	Soins de santé	23	13	12
Genting Singapore Ltd.	Singapour	Consommation discrétionnaire	32 700	36	37
George Weston Itée	Canada	Consommation de base	101	17	18
Les Vêtements de Sport Gildan Inc.	Canada	Consommation discrétionnaire	618	31	28
GlaxoSmithKline PLC	Royaume-Uni	Soins de santé	274	6	7
Glodon Co. Ltd.	Chine	Technologie de l'information	6 800	69	100
GoPro Inc., cat. A	États-Unis	Consommation discrétionnaire	33 400	240	227
Grafton Group PLC	Royaume-Uni	Produits industriels	1 353	20	20
GrainCorp Ltd.	Australie	Consommation de base	1 627	8	10
Grifols SA	Espagne	Soins de santé	134	2	2
Guangshen Railway Co. Ltd.	Hong Kong	Produits industriels	88 000	21	22
Guangzhou Baiyun International Airport Co. Ltd.	Chine	Produits industriels	9 800	29	30
Guangzhou Baiyun International Airport Co. Ltd. (Bourse de Shanghai)	Chine	Produits industriels	19 800	57	61
H. Lundbeck AS	Danemark	Soins de santé	1 735	10	11
Halliburton Co.	États-Unis	Énergie	708	34	30
Hankyu Hanshin REIT Inc.	Japon	Biens immobiliers	9	13	13
Hanwha Corp.	Corée du Sud	Produits industriels	1 700	58	46
Hargreaves Lansdown PLC	Royaume-Uni	Services financiers	227	3	3
Harmonic Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	14 100	239	278
Haw Par Corp. Ltd.	Singapour	Soins de santé	200	2	2
Headwater Exploration Inc.	Canada	Énergie	15 000	82	95
Hebei Hengshui Laobaigan Liquor Co. Ltd.	Chine	Consommation de base	2 100	13	15
The Hello Group Inc.	Chine	Services de communication	2 200	15	27
Hewlett Packard Enterprise Co.	États-Unis	Technologie de l'information	1 527	29	33
HMS Networks AB	Suède	Technologie de l'information	46	3	3
Howden Joinery Group PLC	Royaume-Uni	Produits industriels	1 012	8	12
Huazhu Group Ltd.	Chine	Consommation discrétionnaire	1 805	118	120
Hugo Boss AG	Allemagne	Consommation discrétionnaire	331	29	32
Hulic Co. Ltd.	Japon	Biens immobiliers	2 000	22	22
Hulic REIT Inc.	Japon	Biens immobiliers	32	60	49
iA Société financière inc.	Canada	Services financiers	458	42	39
iFLYTEK Co. Ltd.	Chine	Technologie de l'information	400	3	5
IG Group Holdings PLC	Royaume-Uni	Services financiers	603	7	7

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
POSITIONS ACHETEUR (suite)					
ACTIONS (suite)					
Iluka Resources Ltd.	Australie	Matériaux	606	5	6
Imperial Brands PLC	Royaume-Uni	Consommation de base	509	16	16
Inchcape PLC	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	576	8	7
Incyte Corp.	États-Unis	Soins de santé	184	16	18
Industria de Diseño Textil SA (Inditex)	Espagne	Consommation discrétionnaire	199	8	9
Industrial and Commercial Bank of China Ltd., H	Chine	Services financiers	23 000	17	17
Infinera Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	26 750	191	281
Insperty Inc.	États-Unis	Produits industriels	201	29	33
Intapp Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	100	3	6
Interactive Brokers Group Inc.	États-Unis	Services financiers	4	5	–
InterDigital Communications Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	400	40	39
International Game Technology PLC	États-Unis	Consommation discrétionnaire	1 295	43	47
Intuit Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	6	4	4
Invesco Ltd.	États-Unis	Services financiers	1 513	41	34
iovance Biotherapeutics Inc.	États-Unis	Soins de santé	25 040	216	207
Ipsen SA	France	Soins de santé	90	12	13
Israel Discount Bank Ltd.	Israël	Services financiers	5 798	46	39
Japan Post Holdings Co. Ltd.	Japon	Services financiers	4 300	42	47
Jefferies Financial Group Inc.	États-Unis	Services financiers	726	28	31
JEOL Ltd.	Japon	Soins de santé	100	5	4
Jerónimo Martins SGPS SA	Portugal	Consommation de base	167	5	5
Jiangsu General Science Technology Co. Ltd.	Chine	Consommation discrétionnaire	42 100	36	34
Jiangsu King's Luck Brewery JSC Ltd.	Chine	Consommation de base	700	7	9
Jinduicheng Molybdenum Co. Ltd.	Chine	Matériaux	2 000	5	5
Jointown Pharmaceutical Group Co. Ltd.	Chine	Soins de santé	9 900	26	29
Kainos Group PLC	Royaume-Uni	Technologie de l'information	1 765	44	41
Kansai Electric Power Co. Inc.	Japon	Services publics	3 500	41	46
KCC Corp.	Corée du Sud	Matériaux	16	4	4
Kenedix Retail REIT Corp.	Japon	Biens immobiliers	5	12	12
Keppel Corp. Ltd.	Singapour	Produits industriels	6 700	34	38
Kingsoft Corp. Ltd.	Chine	Services de communication	4 000	21	27
Kweichow Moutai Co. Ltd., cat. A	Chine	Consommation de base	200	72	72
KWG Living Group Holdings Ltd.	Chine	Biens immobiliers	45 000	16	10
Lamar Advertising Co., cat. A	États-Unis	Biens immobiliers	269	37	36
LegalZoom.com Inc.	États-Unis	Produits industriels	20 900	249	265
Lendlease Global Commercial REIT	Singapour	Services financiers	72 900	50	50
Lens Technology Co. Ltd.	Chine	Technologie de l'information	43 400	94	116
Li Auto Inc.	Chine	Consommation discrétionnaire	650	19	22
Lightspeed Commerce Inc.	Canada	Technologie de l'information	700	15	14
Lions Gate Entertainment Corp., cat. A	États-Unis	Services de communication	16 340	139	245
Liuzhou Iron & Steel Co. Ltd.	Chine	Matériaux	19 300	17	16
Liuzhou Iron & Steel Co. Ltd. (Bourse de Shanghai)	Chine	Matériaux	37 500	30	31
Live Nation Entertainment Inc.	États-Unis	Services de communication	346	39	33
LivePerson Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	15 600	237	93
Les Compagnies Loblaw Itée 5,30 %, à div. cumulatif, rachetables, priv. de second rang, série B	Canada	Consommation de base	609	16	14
LyondellBasell Industries NV, cat. A	États-Unis	Matériaux	297	39	38
Macy's Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	100	3	2
Maire Tecnimont SPA	Italie	Produits industriels	1 314	6	8
Man Group PLC	Royaume-Uni	Services financiers	2 683	12	11
Manulife US Real Estate Investment Trust	Singapour	Biens immobiliers	94 600	36	28
Marathon Petroleum Corp.	États-Unis	Énergie	2 500	141	456
Marks & Spencer Group PLC	Royaume-Uni	Consommation de base	6 278	15	18
Martinrea International Inc.	Canada	Consommation discrétionnaire	400	4	6
Maruichi Steel Tube Ltd.	Japon	Matériaux	1 700	49	51
Masco Corp.	États-Unis	Produits industriels	48	15	3
Mastercard Inc., cat. A	États-Unis	Services financiers	17	8	8
Mazda Motor Corp.	Japon	Consommation discrétionnaire	3 900	41	49
MCBC Holdings Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	1 100	52	45
Medtronic PLC	États-Unis	Soins de santé	32	3	3
MEG Energy Corp.	Canada	Énergie	39 699	369	862

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
POSITIONS ACHETEUR (suite)					
ACTIONS (suite)					
Meinian Onehealth Healthcare Holdings Co. Ltd.	Chine	Soins de santé	10 800	14	16
Meituan-Dianping	Chine	Consommation discrétionnaire	7 315	186	180
Melco Resorts & Entertainment Ltd., CAAE	Hong Kong	Consommation discrétionnaire	2 814	44	48
Meltwater Holding BV	Pays-Bas	Produits industriels	4 376	17	10
Mercury NZ Ltd.	Nouvelle-Zélande	Services publics	2 003	10	11
Mersana Therapeutics Inc.	États-Unis	Soins de santé	28 730	263	160
Meta Platforms Inc.	États-Unis	Services de communication	143	26	41
Methanex Corp.	Canada	Matériaux	100	6	6
Mettler-Toledo International Inc.	États-Unis	Soins de santé	11	22	23
MFA Financial Inc.	États-Unis	Services financiers	1 200	18	16
MGIC Investment Corp.	États-Unis	Services financiers	2 023	36	37
MINISO Group Holding Ltd., CAAE	Chine	Consommation discrétionnaire	1 868	45	45
Mitchells & Butlers PLC	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	2 367	7	6
Mitsubishi Motors Corp.	Japon	Consommation discrétionnaire	400	2	2
Moncler SPA	Italie	Consommation discrétionnaire	482	43	45
MORI TRUST Sogo REIT Inc.	Japon	Biens immobiliers	70	47	49
MTU Aero Engines AG	Allemagne	Produits industriels	53	16	18
Neinor Homes SA	Espagne	Consommation discrétionnaire	3 551	62	47
Neoenegia SA	Brésil	Services publics	35 200	156	141
Neopost SA	France	Technologie de l'information	2 118	68	52
New Residential Investment Corp.	États-Unis	Services financiers	4 200	58	45
New York REIT Inc.	États-Unis	Biens immobiliers	1 050	23	18
Newborn Town Inc.	Chine	Technologie de l'information	126 000	63	37
News Corp., cat. A	États-Unis	Services de communication	111	3	3
Nexans SA	France	Produits industriels	193	25	26
Nippon Building Fund Inc.	Japon	Biens immobiliers	9	62	51
Nitto Denko Corp.	Japon	Matériaux	600	51	52
Northern Oil and Gas Inc.	États-Unis	Énergie	14 500	161	595
Novatek Microelectronics Corp.	Taïwan	Technologie de l'information	1 000	19	19
Novo Nordisk AS, B	Danemark	Soins de santé	253	36	54
Nutanix Inc., cat. A	États-Unis	Technologie de l'information	1 367	41	48
Occidental Petroleum Corp., bons de souscription éch. 03-08-2027	États-Unis	Énergie	540	–	30
OCI NV	Pays-Bas	Matériaux	179	6	8
Ocular Therapeutix Inc.	États-Unis	Soins de santé	30 300	254	216
Office Properties Income Trust	États-Unis	Biens immobiliers	1 400	25	23
Offshore Oil Engineering Co. Ltd.	Chine	Énergie	86 500	87	104
OJI Paper Co. Ltd.	Japon	Matériaux	700	4	4
Okamura Corp.	Japon	Produits industriels	3 400	44	47
Okta Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	243	28	28
OneMain Holdings Inc.	États-Unis	Services financiers	538	35	27
OneSpaWorld Holdings Ltd.	Bahamas	Consommation discrétionnaire	700	10	11
oOh!media Ltd.	Australie	Services de communication	1 868	2	3
O'Reilly Automotive Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	13	11	15
Origin Energy Ltd.	Australie	Services publics	3 714	22	28
Orion Office REIT Inc.	États-Unis	Biens immobiliers	4 100	51	37
ORIX Corp.	Japon	Services financiers	600	14	13
Oscar Health Inc.	États-Unis	Services financiers	300	2	3
Ovintiv Inc.	États-Unis	Énergie	5 000	209	244
OX2 AB	Suède	Produits industriels	860	8	9
Palo Alto Networks Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	151	33	41
Paragon Banking Group PLC	Royaume-Uni	Services financiers	509	5	4
Paramount Resources Ltd., cat. A	Canada	Énergie	660	20	20
Parex Resources Inc.	Canada	Énergie	30 800	588	774
Parker Hannifin Corp.	États-Unis	Produits industriels	85	34	39
Corporation Pétroles Parkland	Canada	Énergie	24 800	863	804
Partners Group Holding AG	Suisse	Services financiers	2	3	3
Pason Systems Inc.	Canada	Énergie	100	2	1
PayPal Holdings Inc.	États-Unis	Services financiers	19	2	2
PDC Energy Inc.	États-Unis	Énergie	9 900	541	859
Pebblebrook Hotel Trust	États-Unis	Biens immobiliers	100	2	2
PetroChina Co. Ltd., H	Chine	Énergie	46 000	30	37

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
POSITIONS ACHETEUR (suite)					
ACTIONS (suite)					
Petróleo Brasileiro SA – Petrobras, CAAE	Brésil	Énergie	30 000	552	423
Peyto Exploration & Development Corp.	Canada	Énergie	12 400	99	150
Philip Morris International Inc.	États-Unis	Consommation de base	284	32	37
Phreesia Inc.	États-Unis	Soins de santé	100	4	4
PICC Property & Casualty Co. Ltd., H	Chine	Services financiers	94 000	113	130
Pilbara Minerals Ltd.	Australie	Matériaux	14 882	59	54
Ping An Bank Co. Ltd.	Chine	Services financiers	16 700	44	41
Pinterest Inc.	États-Unis	Services de communication	7 800	283	288
Pipestone Energy Corp.	Canada	Énergie	25 000	83	69
Plains GP Holdings LP	États-Unis	Énergie	35 000	517	621
Polaris Infrastructure Inc.	Canada	Services publics	20 000	300	266
Popular Inc.	Porto Rico	Services financiers	410	41	32
PORR AG	Autriche	Produits industriels	216	4	4
Post Holdings Inc.	États-Unis	Consommation de base	269	35	33
PotlatchDeltic Corp.	États-Unis	Biens immobiliers	800	59	54
Premier Investments Ltd.	Australie	Consommation discrétionnaire	2 014	48	48
Prime US Real Estate Investment Trust	Singapour	Biens immobiliers	17 300	17	7
Pro Medicus Ltd.	Australie	Soins de santé	201	12	12
Protagonist Therapeutics Inc.	États-Unis	Soins de santé	11 380	229	354
PTC Therapeutics Inc.	États-Unis	Soins de santé	3 900	247	256
Pure Storage Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	969	38	33
Qantas Airways Ltd.	Australie	Produits industriels	13 562	72	82
Qualtrics International Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	10 500	250	253
Quectel Wireless Solutions Co. Ltd.	Chine	Technologie de l'information	320	9	8
QuidelOrtho Corp.	États-Unis	Soins de santé	100	13	12
Raiffeisen International Bank-Holding AG	Autriche	Services financiers	3 438	67	71
Rayonier Advanced Materials Inc.	États-Unis	Matériaux	21 500	235	182
Republic Services Inc.	États-Unis	Produits industriels	208	36	38
Restar Holdings Corp.	Japon	Technologie de l'information	2 200	46	49
Retail Value Inc.	États-Unis	Biens immobiliers	102 300	86	37
Rexel SA	France	Produits industriels	1 241	27	40
Ricoh Co. Ltd.	Japon	Technologie de l'information	2 400	27	24
Rightmove PLC	Royaume-Uni	Services de communication	5 233	52	49
RingCentral Inc., cat. A	États-Unis	Technologie de l'information	700	40	29
Roivant Sciences Ltd.	États-Unis	Soins de santé	21 819	194	218
ROK Resources Inc., bons de souscription éch. 04-03-2025	Canada	Énergie	1 347 200	–	283
Rorze Corp.	Japon	Technologie de l'information	300	24	36
Ryman Hospitality Properties Inc.	États-Unis	Biens immobiliers	285	34	35
S&P Global Inc.	États-Unis	Services financiers	74	43	35
Saab AB, cat. B	Suède	Produits industriels	141	11	12
Saputo inc.	Canada	Consommation de base	1 105	39	39
Sarepta Therapeutics Inc.	États-Unis	Soins de santé	99	17	18
Saturn Oil & Gas Inc.	Canada	Énergie	135 000	285	339
Saturn Oil & Gas Inc., bons de souscription éch. 10-03-2025	Canada	Énergie	175 000	–	81
SBI Holdings Inc.	Japon	Services financiers	400	11	11
Scandic Hotels Group AB	Suède	Consommation discrétionnaire	9 672	48	44
Schlumberger Ltd.	États-Unis	Énergie	6 017	432	400
Secure Energy Services Inc.	Canada	Énergie	75 000	286	473
Service Properties Trust	États-Unis	Biens immobiliers	3 400	30	46
Seven Group Holdings Ltd.	Australie	Produits industriels	1 020	23	21
Shanghai International Airport Co. Ltd., cat. A	Chine	Produits industriels	10 100	104	111
Shanghai Jinjiang International Hotels Development Co. Ltd., cat. B	Chine	Consommation discrétionnaire	3 900	10	11
Shanghai Jinqiao Export Processing Zone Development Co. Ltd.	Chine	Biens immobiliers	10 400	13	13
ShawCor Ltd.	Canada	Énergie	30 000	359	373
Shell PLC-W/I, CAAE	Pays-Bas	Énergie	11 500	593	895
Shenzhen Salubris Pharmaceuticals Co. Ltd.	Chine	Soins de santé	13 409	65	93
Shougang Concord International Enterprises Co. Ltd.	Chine	Biens immobiliers	40 000	8	14
Shougang Fushan Resources Group Ltd.	Chine	Matériaux	2 000	1	1
Siemens Energy AG	Allemagne	Produits industriels	63	2	2
Siltronic AG	Allemagne	Technologie de l'information	362	34	36
Similarweb Ltd.	Israël	Technologie de l'information	500	4	5

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
POSITIONS ACHETEUR (suite)					
ACTIONS (suite)					
Sinch AB	Suède	Technologie de l'information	808	4	3
Singapore Airlines Ltd.	Singapour	Produits industriels	6 000	31	35
Sinofert Holdings Ltd.	Chine	Matériaux	64 000	11	11
Sinopec Oilfield Service Corp.	Chine	Énergie	8 300	3	3
Sinopec Shanghai Petrochemical Co. Ltd., cat. H	Chine	Matériaux	36 000	9	9
Smartsheet Inc., cat. A	États-Unis	Technologie de l'information	200	10	13
SMCP SA	France	Consommation discrétionnaire	1 825	21	22
SolarWinds Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	3 700	43	43
Solvay SA	Belgique	Matériaux	19	2	3
Spark New Zealand Ltd.	Nouvelle-Zélande	Services de communication	839	4	4
Splunk Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	277	41	36
Squarespace Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	7 500	268	322
SSAB AB	Suède	Matériaux	4 750	29	46
SSP Group PLC	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	530	2	2
SSY Group Ltd.	Hong Kong	Soins de santé	21 302	17	17
Stantec Inc.	Canada	Produits industriels	544	38	43
State Street Corp.	États-Unis	Services financiers	324	32	33
Stelco Holdings Inc.	Canada	Matériaux	100	4	5
Storskogen Group AB	Suède	Produits industriels	2 128	2	2
Strabag SE-BR	Autriche	Produits industriels	49	3	3
SUMCO Corp.	Japon	Technologie de l'information	500	10	10
Summit Hotel Properties Inc.	États-Unis	Biens immobiliers	2 200	24	21
Suncorp Group Ltd.	Australie	Services financiers	4 118	44	45
Suzhou Zelgen Biopharmaceutical Co. Ltd.	Chine	Soins de santé	2 000	20	19
Suzuki Motor Corp.	Japon	Consommation discrétionnaire	300	15	15
Swedish Orphan Biovitrum AB	Suède	Soins de santé	432	12	14
SYNLAB AG	Allemagne	Soins de santé	692	14	10
T&D Holdings Inc.	Japon	Services financiers	800	13	13
T. Rowe Price Group Inc.	États-Unis	Services financiers	144	37	22
TaiDoc Technology Corp.	Taiwan	Soins de santé	2 000	16	16
Taiwan Hon Chuan Enterprise Co. Ltd	Taiwan	Matériaux	4 000	16	17
Takara Leben Real Estate Investment Corp.	Japon	Biens immobiliers	51	60	47
Tanger Factory Outlet Centers Inc.	États-Unis	Biens immobiliers	400	10	11
TE Connectivity Ltd.	États-Unis	Technologie de l'information	124	21	22
TechnipFMC PLC	Royaume-Uni	Énergie	653	9	12
Technology One Ltd.	Australie	Technologie de l'information	1 626	16	22
Teekay Corp.	États-Unis	Énergie	28 000	237	234
Telenet Group Holding NV	Belgique	Services de communication	259	5	8
Tencent Holdings Ltd.	Chine	Services de communication	7 200	456	476
Textron Inc.	États-Unis	Produits industriels	401	38	38
TFI International Inc.	Canada	Produits industriels	280	43	45
The AES Corp.	États-Unis	Services publics	289	8	9
The Allstate Corp.	États-Unis	Services financiers	183	25	27
The Blackstone Group Inc., cat. A	États-Unis	Services financiers	94	15	11
The Descartes Systems Group Inc.	Canada	Technologie de l'information	100	10	11
The GEO Group Inc.	États-Unis	Produits industriels	1 800	13	19
The Hershey Co.	États-Unis	Consommation de base	117	27	40
The Macerich Co.	États-Unis	Biens immobiliers	100	1	1
The Manitowoc Co. Inc.	États-Unis	Produits industriels	300	8	7
The Progressive Corp.	États-Unis	Services financiers	114	15	22
The Williams Companies Inc.	États-Unis	Énergie	16 500	461	666
Thungela Resources Ltd.	Afrique du Sud	Matériaux	839	21	13
ThyssenKrupp AG	Allemagne	Matériaux	4 221	43	41
Tilray Inc.	États-Unis	Soins de santé	300	1	1
Tingyi (Cayman Islands) Holding Corp.	Chine	Consommation de base	15 543	37	35
Titan Cement International SA	Grèce	Matériaux	60	1	1
Tod's SPA	Italie	Consommation discrétionnaire	12	1	1
Tokyo Century Corp.	Japon	Services financiers	200	9	9
Tokyo Gas Co. Ltd.	Japon	Services publics	500	12	13
Tokyu REIT Inc.	Japon	Biens immobiliers	26	50	48
Topaz Energy Corp.	Canada	Énergie	25 000	510	478

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
POSITIONS ACHETEUR (suite)					
ACTIONS (suite)					
Torex Gold Resources Inc.	Canada	Matériaux	1 100	19	25
Toromont Industries Ltd.	Canada	Produits industriels	61	7	7
Tosoh Corp.	Japon	Matériaux	300	6	6
Total SA, CAAE	France	Énergie	10 700	548	855
Tourmaline Oil Corp.	Canada	Énergie	9 743	126	549
Toyo Ink Manufacturing Co. Ltd.	Japon	Produits industriels	2 700	52	57
TransAlta Corp.	Canada	Services publics	4 200	57	50
TransAlta Corp. 4,60 %, perpétuelles, priv., série C	Canada	Services publics	782	15	15
TransAlta Corp., priv., Série A	Canada	Services publics	343	5	4
TransAlta Renewables Inc.	Canada	Services publics	400	6	5
Travelsky Technology Ltd.	Chine	Consommation discrétionnaire	19 491	44	49
Trican Well Service Ltd.	Canada	Énergie	6 200	22	19
Trina Solar Co. Ltd.	Chine	Technologie de l'information	8 554	107	88
Trip.com Group Ltd., CAAE	Chine	Consommation discrétionnaire	361	18	18
Truist Financial Corp.	États-Unis	Services financiers	771	34	36
Truly International Holdings Ltd.	Chine	Technologie de l'information	132 000	26	25
TUI AG	Allemagne	Consommation discrétionnaire	465	13	5
TUI AG, droits éch. 24-04-2023	Allemagne	Consommation discrétionnaire	1 240	–	2
Tyro Payments Ltd.	Australie	Services financiers	935	1	1
U.S. Bancorp	États-Unis	Services financiers	224	11	11
Uber Technologies Inc.	États-Unis	Produits industriels	632	29	27
Ubisoft Entertainment SA	France	Services de communication	612	49	22
UGI Corp.	États-Unis	Services publics	672	35	32
Unimicron Technology Corp.	Taiwan	Technologie de l'information	4 000	26	26
Uni-President China Holdings Ltd.	Chine	Consommation de base	25 530	37	35
United Rentals Inc.	États-Unis	Produits industriels	65	29	35
Universal Medical Financial & Technical Advisory Services Co. Ltd.	Hong Kong	Services financiers	16 000	13	13
UTour Group Co. Ltd.	Chine	Consommation discrétionnaire	5 200	10	10
UTour Group Co. Ltd. (Bourse [Northbound] de Shenzhen/Hong Kong)	Chine	Consommation discrétionnaire	16 500	30	31
Verallia SA	France	Matériaux	287	15	17
Vermilion Energy Inc.	Canada	Énergie	22 500	646	394
Vesuvius PLC	Royaume-Uni	Produits industriels	4 069	22	28
Vimian Group AB	Suède	Soins de santé	751	3	3
Virgin Money UK PLC	Royaume-Uni	Services financiers	3 962	9	10
Visional Inc.	Japon	Produits industriels	100	10	8
Visionox Technology Inc.	Chine	Technologie de l'information	55 500	74	81
Vornado Realty Trust	États-Unis	Biens immobiliers	500	13	10
Wabash National Corp.	États-Unis	Produits industriels	200	8	7
Warrior Met Coal Inc.	États-Unis	Matériaux	100	5	5
Waters Corp.	États-Unis	Soins de santé	85	37	36
Webjet Ltd.	Australie	Consommation discrétionnaire	2 173	13	14
Wells Fargo & Co.	États-Unis	Services financiers	188	10	10
Wereldhave NV	Pays-Bas	Biens immobiliers	2 260	42	47
West Fraser Timber Co. Ltd.	Canada	Matériaux	393	46	38
Western Digital Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	306	22	16
Whitbread PLC	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	447	18	22
Whitecap Resources Inc.	Canada	Énergie	74 400	765	777
Whitehaven Coal Ltd.	Australie	Énergie	7 235	54	44
Willis Towers Watson PLC	États-Unis	Services financiers	17	5	5
Wintrust Financial Corp.	États-Unis	Services financiers	301	36	30
Workday Inc., cat. A	États-Unis	Technologie de l'information	155	30	43
WPP PLC	Royaume-Uni	Services de communication	694	11	11
Wuchan Zhongda Group Co. Ltd., cat. A	Chine	Consommation discrétionnaire	66 200	53	63
Wynn Resorts Ltd.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	94	11	14
Xero Ltd.	Australie	Technologie de l'information	47	4	4
Xinxiang Richful Lube Additive Co. Ltd.	Chine	Matériaux	300	6	7
Yankershop Food Co. Ltd.	Chine	Consommation de base	3 700	80	98
Yext Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	20 460	171	266
Yokogawa Electric Corp.	Japon	Technologie de l'information	300	7	7
Yonghui Superstores Co. Ltd., cat. A	Chine	Consommation de base	24 199	21	16

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
POSITIONS ACHETEUR (suite)					
ACTIONS (suite)					
Youngor Group Co. Ltd.	Chine	Biens immobiliers	17 400	23	22
Yuexiu Services Group Ltd.	Chine	Biens immobiliers	10 500	8	7
Yum China Holdings Inc. (actions en \$ US)	Chine	Consommation discrétionnaire	387	30	33
Yunnan Copper Co. Ltd.	Chine	Matériaux	3 900	10	10
Zeon Corp.	Japon	Matériaux	1 200	16	18
Zeta Global Holdings Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	200	2	3
Zhejiang Qianjiang Motorcycle Co. Ltd.	Chine	Consommation discrétionnaire	21 000	110	98
Zhuzhou CRRC Times Electric Co. Ltd.	Chine	Produits industriels	3 200	20	19
ZOZO Inc.	Japon	Consommation discrétionnaire	200	6	6
Total des actions				33 608	37 977
OPTIONS					
Options achetées (se reporter au tableau des options achetées)				1 020	505
Total des options				1 020	505
FONDS/BILLETS NÉGOCIÉS EN BOURSE					
iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	730	135	108
SPDR S&P Oil & Gas Exploration & Production ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	5 700	976	984
Total des fonds/billets négociés en bourse				1 111	1 092
FONDS COMMUNS DE PLACEMENT					
¹ Fonds toutes actions Chine Mackenzie ChinaAMC, série R	Canada	Fonds communs de placement	891 952	9 000	7 125
Total des fonds communs de placement				9 000	7 125
FONDS PRIVÉS					
² Sagard Credit Partners II LP	Canada	Services financiers	40	185	185
Total des fonds privés				185	185
Total des positions acheteur				71 293	71 551
POSITIONS VENDEUR					
OBLIGATIONS					
Avis Budget Car Rental LLC 4,75 % 01-04-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(20 000) USD	(23)	(25)
Bombardier Inc. 6,00 % 15-02-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	(65 000) USD	(81)	(86)
Bombardier Inc. 7,50 % 15-03-2025 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	(10 000) USD	(13)	(14)
Bombardier Inc. 7,88 % 15-04-2027 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	(64 000) USD	(77)	(88)
Bread Financial Holdings Inc. 7,00 % 15-01-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(40 000) USD	(49)	(48)
Coty Inc. 4,75 % 15-01-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(40 000) USD	(52)	(51)
Credit Acceptance Corp. 6,63 % 15-03-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(200 000) USD	(264)	(253)
Eco Material Technologies Inc. 7,88 % 31-01-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(40 000) USD	(49)	(52)
Griffon Corp. 5,75 % 01-03-2028, rachetables 2023	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(44 000) USD	(53)	(55)
Murphy Oil Corp. 5,88 % 01-12-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(15 000) USD	(19)	(20)
Paramount Global 4,20 % 19-05-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(20 000) USD	(22)	(23)
The Hertz Corp. 5,00 % 01-12-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(20 000) USD	(22)	(22)
TRI Pointe Group Inc. 5,70 % 15-06-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(200 000) USD	(274)	(262)
W. R. Grace Holdings LLC 5,63 % 15-08-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	(40 000) USD	(44)	(46)
Total des obligations				(1 042)	(1 045)
ACTIONS					
21Vianet Group Inc., CAAE	Chine	Technologie de l'information	(800)	(7)	(4)
AAK AB	Suède	Consommation de base	(176)	(4)	(4)
Les Laboratoires Abbott	États-Unis	Soins de santé	(31)	(4)	(4)
Accolade Inc.	États-Unis	Soins de santé	(200)	(2)	(4)
Adevinta ASA	Norvège	Services de communication	(1 051)	(12)	(10)
Admiral Group PLC	Royaume-Uni	Services financiers	(668)	(24)	(23)
Advanced Drainage Systems Inc.	États-Unis	Produits industriels	(74)	(13)	(8)
Adyen NV	Pays-Bas	Services financiers	(15)	(48)	(32)

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
POSITIONS VENDEUR (suite)					
ACTIONS (suite)					
Aedifica SA	Belgique	Biens immobiliers	(207)	(22)	(23)
Aeva Technologies Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(600)	(4)	(1)
AEye Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(400)	(2)	–
Mines Agrico Eagle Ltée	Canada	Matériaux	(31)	(2)	(2)
AIFUL Corp.	Japon	Services financiers	(3 900)	(14)	(14)
Aker ASA	Norvège	Produits industriels	(70)	(6)	(6)
Algonquin Power & Utilities Corp.	Canada	Services publics	(851)	(8)	(10)
Allegion PLC	États-Unis	Produits industriels	(97)	(12)	(14)
Alliant Energy Corp.	États-Unis	Services publics	(359)	(27)	(26)
Allianz SE, nom.	Allemagne	Services financiers	(24)	(7)	(7)
Alpha Metallurgical Resources Inc.	États-Unis	Matériaux	(970)	(172)	(205)
Ambarella Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(300)	(27)	(31)
Amcort PLC (actions américaines)	Jersey	Matériaux	(986)	(15)	(15)
Ameresco Inc.	États-Unis	Produits industriels	(100)	(7)	(7)
American Water Works Co. Inc.	États-Unis	Services publics	(123)	(26)	(24)
Americold Realty Trust	États-Unis	Biens immobiliers	(601)	(24)	(23)
Amkor Technology Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(519)	(15)	(18)
Antero Midstream Corp.	États-Unis	Énergie	(1 629)	(20)	(23)
Antin Infrastructure Partners SA	France	Services financiers	(146)	(4)	(4)
Aozora Bank Ltd.	Japon	Services financiers	(1 200)	(32)	(29)
Apollo Global Management Inc.	États-Unis	Services financiers	(164)	(11)	(14)
Apple Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(30)	(7)	(7)
Archer Aviation Inc.	États-Unis	Produits industriels	(4 600)	(19)	(18)
Archer Daniels Midland Co.	États-Unis	Consommation de base	(215)	(25)	(23)
Arena REIT	Australie	Biens immobiliers	(2 116)	(7)	(7)
Ares Management Corp.	États-Unis	Services financiers	(231)	(20)	(26)
Aritzia Inc.	Canada	Consommation discrétionnaire	(300)	(14)	(13)
ARMOUR Residential REIT Inc.	États-Unis	Services financiers	(3 600)	(34)	(26)
Arrow Electronics Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(17)	(2)	(3)
Asahi Kasei Corp.	Japon	Matériaux	(400)	(4)	(4)
Ascendas Real Estate Investment Trust	Singapour	Biens immobiliers	(6 400)	(18)	(19)
Ascendis Pharma AS, CAAE	Danemark	Soins de santé	(106)	(14)	(15)
AsialInfo Technologies Ltd.	Chine	Technologie de l'information	(12 400)	(22)	(31)
Aspen Aerogels Inc.	États-Unis	Matériaux	(18 400)	(259)	(185)
Aspen Technology Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(84)	(24)	(26)
Assura PLC	Royaume-Uni	Biens immobiliers	(27 506)	(36)	(22)
Assurant Inc.	États-Unis	Services financiers	(68)	(15)	(11)
ASX Ltd.	Australie	Services financiers	(438)	(28)	(26)
AutoStore Holdings Ltd.	Bermudes	Produits industriels	(3 136)	(9)	(9)
Avangrid Inc.	États-Unis	Services publics	(359)	(22)	(19)
Avantor Inc.	États-Unis	Soins de santé	(818)	(31)	(23)
Avis Budget Group Inc.	États-Unis	Produits industriels	(92)	(23)	(24)
Bachem Holding AG	Suisse	Soins de santé	(121)	(10)	(16)
Balchem Corp.	États-Unis	Matériaux	(96)	(17)	(16)
Ballard Power Systems Inc.	Canada	Produits industriels	(1 300)	(9)	(10)
Bâloise Holding AG	Suisse	Services financiers	(109)	(21)	(23)
Banca Farmafactoring SPA	Italie	Services financiers	(153)	(1)	(2)
Banque Cantonale Vaudoise	Suisse	Services financiers	(165)	(20)	(21)
Baozun Inc.	Chine	Consommation discrétionnaire	(1 900)	(28)	(15)
Société aurifère Barrick	Canada	Matériaux	(690)	(16)	(17)
Baxter International Inc.	États-Unis	Soins de santé	(56)	(4)	(3)
Baytex Energy Corp.	Canada	Énergie	(80 700)	(365)	(409)
BCE Inc.	Canada	Services de communication	(93)	(6)	(6)
BE Semiconductor Industries NV	Pays-Bas	Technologie de l'information	(9)	(1)	(1)
Bed Bath & Beyond Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(600)	(12)	–
Beijer Ref AB	Suède	Produits industriels	(696)	(14)	(17)
Beijing Enterprises Water Group Ltd.	Chine	Services publics	(50 000)	(22)	(17)
Beyond Meat Inc.	États-Unis	Consommation de base	(400)	(36)	(9)
Bill.com Holdings Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(2 165)	(318)	(238)
Bio-Techne Corp.	États-Unis	Soins de santé	(39)	(6)	(4)
BioXcel Therapeutics Inc.	États-Unis	Soins de santé	(700)	(19)	(18)

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
POSITIONS VENDEUR (suite)					
ACTIONS (suite)					
Birchcliff Energy Ltd.	Canada	Énergie	(65 000)	(289)	(498)
BJ's Wholesale Club Holdings Inc.	États-Unis	Consommation de base	(255)	(19)	(26)
Black Knight Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(100)	(8)	(8)
BlackBerry Ltd.	Canada	Technologie de l'information	(5 500)	(28)	(34)
Block Inc.	États-Unis	Services financiers	(2 200)	(238)	(204)
BMO Commercial Property Trust Ltd.	Royaume-Uni	Biens immobiliers	(9 272)	(11)	(13)
BNP Paribas SA	France	Services financiers	(2)	–	–
Bolloré SA	France	Services de communication	(1 339)	(11)	(11)
BONESUPPORT Holding AB	Suède	Soins de santé	(420)	(4)	(5)
Bonterra Energy Corp.	Canada	Énergie	(35 000)	(107)	(231)
Brookfield Infrastructure Corp., cat. A	Canada	Services publics	(97)	(5)	(6)
Brown & Brown Inc.	États-Unis	Services financiers	(321)	(25)	(25)
Bunge Ltd.	États-Unis	Consommation de base	(175)	(21)	(23)
Burford Capital Ltd. (Bourse de Londres)	États-Unis	Services financiers	(2 697)	(30)	(34)
Burlington Stores Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(28)	(8)	(8)
BWP Trust	Australie	Biens immobiliers	(8 913)	(32)	(31)
CA Immobilien Anlagen AG	Autriche	Biens immobiliers	(46)	(2)	(2)
Fonds de placement immobilier d'immeubles résidentiels canadien	Canada	Biens immobiliers	(600)	(29)	(28)
Banque Canadienne Impériale de Commerce	Canada	Services financiers	(574)	(40)	(33)
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée	Canada	Produits industriels	(230)	(21)	(24)
Canfor Corp.	Canada	Matériaux	(1 400)	(35)	(30)
Canvest Environmental Protection Group Co. Ltd.	Hong Kong	Services publics	(43 000)	(30)	(27)
Capcom Co. Ltd.	Japon	Services de communication	(200)	(7)	(10)
CapitaLand Mall Integrated Commercial Trust	Singapour	Biens immobiliers	(12 000)	(24)	(24)
CarMax Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(249)	(37)	(22)
Carnival PLC	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(1 665)	(20)	(20)
Carter's Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(300)	(30)	(29)
CCC Intelligent Solutions Holdings Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(1 189)	(15)	(14)
CDW Corp. of Delaware	États-Unis	Technologie de l'information	(97)	(22)	(26)
Celldex Therapeutics Inc.	États-Unis	Soins de santé	(300)	(11)	(15)
Celsius Holdings Inc.	États-Unis	Consommation de base	(2 107)	(253)	(265)
Ceres Power Holdings PLC	Royaume-Uni	Produits industriels	(2 367)	(12)	(15)
Cerevel Therapeutics Holdings Inc.	États-Unis	Soins de santé	(245)	(9)	(8)
Ceridian HCM Holding Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(87)	(8)	(9)
Change Inc.	Japon	Technologie de l'information	(1 200)	(20)	(29)
Charter Hall Long WALE REIT	Australie	Biens immobiliers	(7 060)	(32)	(27)
Charter Hall Social Infrastructure REIT	Australie	Biens immobiliers	(9 447)	(32)	(26)
Chevron Corp.	États-Unis	Énergie	(1 800)	(196)	(397)
China Everbright International Ltd.	Chine	Produits industriels	(53 000)	(34)	(31)
China Power International Development Ltd.	Chine	Services publics	(4 000)	(2)	(2)
Chinasoft International Ltd.	Chine	Technologie de l'information	(6 000)	(7)	(5)
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix	Canada	Biens immobiliers	(1 144)	(15)	(17)
Chugoku Electric Power Co. Inc.	Japon	Services publics	(4 500)	(33)	(31)
Church & Dwight Co. Inc.	États-Unis	Consommation de base	(85)	(10)	(10)
Cinemark Holdings Inc.	États-Unis	Services de communication	(13 020)	(223)	(260)
Civitas Resources Inc.	États-Unis	Énergie	(272)	(20)	(25)
Clarivate Analytics PLC	Royaume-Uni	Produits industriels	(868)	(11)	(11)
Cloudflare Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(73)	(5)	(6)
CNX Resources Corp.	États-Unis	Énergie	(12 100)	(261)	(262)
COFCO Meat Holdings Ltd.	Chine	Consommation de base	(46 000)	(16)	(16)
Columbia Sportswear Co.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(192)	(23)	(23)
Commerce Bancshares Inc.	États-Unis	Services financiers	(93)	(7)	(7)
Commercial Metals Co.	États-Unis	Matériaux	(294)	(17)	(19)
Commonwealth Bank of Australia	Australie	Services financiers	(349)	(31)	(31)
COMSYS Holdings Corp.	Japon	Produits industriels	(1 200)	(28)	(30)
Confluent Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(84)	(3)	(3)
ConocoPhillips	États-Unis	Énergie	(2 000)	(189)	(268)
Consensus Cloud Solutions Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(100)	(5)	(5)
Constellation Energy	États-Unis	Services publics	(36)	(4)	(4)
ContextLogic Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(5 000)	(10)	(3)
Costamare Inc.	États-Unis	Produits industriels	(1 600)	(20)	(20)

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
POSITIONS VENDEUR (suite)					
ACTIONS (suite)					
CoStar Group Inc.	États-Unis	Produits industriels	(238)	(24)	(22)
Coterra Energy Inc.	États-Unis	Énergie	(697)	(23)	(23)
Covestro AG	Allemagne	Matériaux	(245)	(14)	(14)
Crédit Agricole SA	France	Services financiers	(2 179)	(40)	(33)
Crescent Point Energy Corp.	Canada	Énergie	(16 000)	(144)	(153)
CSW Industrials Inc.	États-Unis	Produits industriels	(200)	(30)	(38)
Cutera Inc.	États-Unis	Soins de santé	(100)	(7)	(3)
Dai Nippon Printing Co. Ltd.	Japon	Produits industriels	(700)	(19)	(26)
Daio Paper Corp.	Japon	Matériaux	(2 900)	(30)	(31)
Darling Ingredients Inc.	États-Unis	Consommation de base	(36)	(3)	(3)
DaVita Inc.	États-Unis	Soins de santé	(72)	(7)	(8)
DBS Group Holdings Ltd.	Singapour	Services financiers	(1 000)	(30)	(34)
DCM Holdings Co. Ltd.	Japon	Consommation discrétionnaire	(700)	(8)	(8)
Deliveroo PLC	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	(5 237)	(7)	(8)
Delivery Hero AG	Corée du Sud	Consommation discrétionnaire	(245)	(12)	(11)
Denbury Inc.	États-Unis	Énergie	(22)	(3)	(3)
Denison Mines Corp.	Canada	Énergie	(1 100)	(2)	(2)
Desktop Metal Inc.	États-Unis	Produits industriels	(4 400)	(36)	(14)
Deutsche Börse AG	Allemagne	Services financiers	(133)	(26)	(35)
Dexus Industria REIT	Australie	Biens immobiliers	(10 383)	(29)	(25)
Docebo Inc.	Canada	Technologie de l'information	(400)	(17)	(22)
Dollar General Corp.	États-Unis	Consommation de base	(81)	(23)	(23)
Dollar Tree Inc.	États-Unis	Consommation de base	(116)	(21)	(23)
Dominion Resources Inc.	États-Unis	Services publics	(88)	(7)	(7)
Dr. Martens PLC	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	(3 248)	(8)	(8)
DraftKings Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(295)	(7)	(8)
Draper Esprit PLC	Royaume-Uni	Services financiers	(1 730)	(23)	(8)
Eagle Materials Inc.	États-Unis	Matériaux	(66)	(10)	(13)
ECN Capital Corp.	Canada	Services financiers	(7 100)	(25)	(20)
Element Solutions Inc.	États-Unis	Matériaux	(760)	(23)	(20)
Elior Participations SCA	France	Consommation discrétionnaire	(2 357)	(13)	(11)
Elisa OYJ	Finlande	Services de communication	(77)	(6)	(6)
Embracer Group AB	Suède	Services de communication	(4 565)	(36)	(29)
EMS-CHEMIE HOLDING AG	Suisse	Matériaux	(21)	(27)	(23)
Enbridge Inc.	Canada	Énergie	(8 000)	(351)	(412)
Ence Energía y Celulosa SA	Espagne	Matériaux	(1 424)	(6)	(7)
Endava PLC	Royaume-Uni	Technologie de l'information	(75)	(8)	(7)
Endeavour Group Ltd.	Australie	Consommation de base	(3 736)	(23)	(23)
Energiean PLC	Égypte	Énergie	(1 105)	(18)	(24)
Enerplus Corp.	Canada	Énergie	(30 000)	(467)	(584)
Enviva Partners LP	États-Unis	Énergie	(600)	(48)	(23)
EOG Resources Inc.	États-Unis	Énergie	(3 300)	(384)	(512)
ePlus Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(400)	(24)	(27)
EQT AB	Suède	Services financiers	(845)	(27)	(23)
Equinor ASA	Norvège	Énergie	(10 900)	(257)	(419)
Equity Lifestyle Properties Inc.	États-Unis	Biens immobiliers	(281)	(29)	(26)
ERAMET	France	Matériaux	(57)	(5)	(8)
Erie Indemnity Co., cat. A	États-Unis	Services financiers	(61)	(15)	(19)
Essential Utilities Inc.	États-Unis	Services publics	(223)	(14)	(13)
Établissements Maurel et Prom	France	Énergie	(5 889)	(30)	(30)
Euronext NV	Pays-Bas	Services financiers	(360)	(45)	(37)
Expeditors International of Washington Inc.	États-Unis	Produits industriels	(90)	(12)	(13)
Exxon Mobil Corp.	États-Unis	Énergie	(2 895)	(202)	(429)
FactSet Research Systems Inc.	États-Unis	Services financiers	(41)	(23)	(23)
Far East Horizon Ltd.	Chine	Services financiers	(15 000)	(16)	(18)
Far East Hospitality Trust	Singapour	Biens immobiliers	(37 600)	(23)	(22)
Farmland Partners Inc.	États-Unis	Biens immobiliers	(1 800)	(28)	(26)
Fastenal Co.	États-Unis	Produits industriels	(358)	(27)	(26)
Filo Mining Corp.	Canada	Matériaux	(400)	(6)	(9)
First Financial Bankshares Inc.	États-Unis	Services financiers	(397)	(22)	(17)
First Foundation Inc.	États-Unis	Services financiers	(300)	(6)	(3)

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
POSITIONS VENDEUR (suite)					
ACTIONS (suite)					
First Quantum Minerals Ltd.	Zambie	Matériaux	(118)	(4)	(4)
First Solar Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(96)	(16)	(28)
Five Below Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(11)	(3)	(3)
FLEX LNG Ltd. (actions en \$ US)	Norvège	Énergie	(300)	(12)	(14)
Fortescue Metals Group Ltd.	Australie	Matériaux	(1 669)	(28)	(34)
Foxconn International Holdings Ltd.	Chine	Technologie de l'information	(200 000)	(34)	(29)
Franco-Nevada Corp.	Canada	Matériaux	(95)	(16)	(19)
Frasers Hospitality Trust	Singapour	Biens immobiliers	(64 800)	(40)	(30)
Fu Shou Yuan International Group Ltd.	Chine	Consommation discrétionnaire	(14 000)	(14)	(15)
FuelCell Energy Inc.	États-Unis	Produits industriels	(1 300)	(5)	(5)
Garmin Ltd.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(180)	(31)	(25)
GB Group PLC	Royaume-Uni	Technologie de l'information	(1 738)	(10)	(9)
Gecina SA	France	Biens immobiliers	(198)	(31)	(28)
Gen Digital Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(305)	(10)	(7)
Generac Holdings Inc.	États-Unis	Produits industriels	(1 468)	(187)	(214)
GEO Corp.	Japon	Consommation discrétionnaire	(500)	(9)	(8)
Gevo Inc.	États-Unis	Énergie	(6 400)	(22)	(13)
Goodman Group	Australie	Biens immobiliers	(1 878)	(39)	(32)
Goodman Property Trust	Nouvelle-Zélande	Biens immobiliers	(16 993)	(34)	(31)
Grab Holdings Ltd.	Singapour	Produits industriels	(900)	(6)	(4)
Gran Tierra Energy Inc.	Canada	Énergie	(120 000)	(206)	(144)
Granges AB	Suède	Matériaux	(1 680)	(17)	(22)
Fiducie de placement immobilier Granite	Canada	Biens immobiliers	(400)	(32)	(33)
Great Lakes Dredge & Dock Corp.	États-Unis	Produits industriels	(1 800)	(16)	(13)
Great Portland Estates PLC	Royaume-Uni	Biens immobiliers	(3 369)	(38)	(29)
Guardant Health Inc.	États-Unis	Soins de santé	(100)	(4)	(3)
Gulfport Energy Corp.	États-Unis	Énergie	(2 200)	(180)	(238)
Haitian International Holdings Ltd.	Chine	Produits industriels	(1 000)	(3)	(4)
Haitong International Securities Group Ltd.	Hong Kong	Services financiers	(193 500)	(34)	(22)
Hanesbrands Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(600)	(5)	(4)
Hasbro Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(251)	(23)	(18)
Helios Towers PLC	Tanzanie	Services de communication	(16 146)	(28)	(28)
Helmerich & Payne Inc.	États-Unis	Énergie	(4 000)	(167)	(193)
Hera SPA	Italie	Services publics	(4 197)	(17)	(16)
Hertz Global Holdings Inc.	États-Unis	Produits industriels	(859)	(19)	(19)
Hess Corp.	États-Unis	Énergie	(3 400)	(237)	(609)
Hexagon AB, B	Suède	Technologie de l'information	(815)	(13)	(13)
Hexagon Composites ASA	Norvège	Produits industriels	(6 041)	(27)	(26)
Hiscox Ltd.	Royaume-Uni	Services financiers	(1 700)	(29)	(32)
Hitachi Ltd.	Japon	Produits industriels	(400)	(29)	(30)
Hokkoku Financial Holdings Inc.	Japon	Services financiers	(300)	(14)	(13)
Home BancShares Inc.	États-Unis	Services financiers	(667)	(22)	(20)
Home REIT PLC	Royaume-Uni	Biens immobiliers	(27 939)	(49)	(12)
Hormel Foods Corp.	États-Unis	Consommation de base	(426)	(24)	(23)
HP Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(284)	(11)	(11)
HubSpot Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(460)	(178)	(267)
Husqvarna AB, B	Suède	Produits industriels	(2 314)	(26)	(27)
ICON PLC	États-Unis	Soins de santé	(40)	(11)	(12)
IDACORP Inc.	États-Unis	Services publics	(151)	(21)	(22)
IDEXX Laboratories Inc.	États-Unis	Soins de santé	(10)	(5)	(7)
IDP Education Ltd.	Australie	Consommation discrétionnaire	(648)	(19)	(16)
Iida Group Holdings Co. Ltd.	Japon	Consommation discrétionnaire	(1 200)	(25)	(26)
Compagnie Pétrolière Impériale Ltée	Canada	Énergie	(8 000)	(508)	(550)
indie Semiconductor Inc.	Chine	Technologie de l'information	(1 400)	(16)	(20)
InPost SA	Pologne	Produits industriels	(782)	(9)	(10)
Insight Enterprises Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(84)	(16)	(16)
Integra LifeSciences Holdings Corp.	États-Unis	Soins de santé	(144)	(12)	(11)
International Paper Co.	États-Unis	Matériaux	(72)	(4)	(4)
Intrepid Potash Inc.	États-Unis	Matériaux	(5 320)	(304)	(199)
Investment AB Latour	Suède	Produits industriels	(75)	(3)	(2)
InvoCare Ltd.	Australie	Consommation discrétionnaire	(3 810)	(41)	(41)

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
POSITIONS VENDEUR (suite)					
ACTIONS (suite)					
iRhythm Technologies Inc.	États-Unis	Soins de santé	(1 650)	(200)	(277)
iRobot Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(100)	(8)	(6)
ITOCHU Corp.	Japon	Produits industriels	(800)	(31)	(35)
Itron Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(400)	(35)	(30)
Jack Henry & Associates Inc.	États-Unis	Services financiers	(110)	(23)	(22)
Japan Hotel REIT Investment Corp.	Japon	Biens immobiliers	(34)	(26)	(26)
Japan Material Co. Ltd.	Japon	Technologie de l'information	(400)	(7)	(10)
Joby Aviation Inc.	États-Unis	Produits industriels	(2 000)	(10)	(12)
Just Eat Takeaway (Bourse d'Amsterdam)	Pays-Bas	Consommation discrétionnaire	(543)	(15)	(14)
Just Group PLC	Royaume-Uni	Services financiers	(610)	(1)	(1)
Karuna Therapeutics Inc.	États-Unis	Soins de santé	(948)	(257)	(233)
Kaufman & Broad SA	France	Consommation discrétionnaire	(475)	(19)	(19)
Kawasaki Kisen Kaisha Ltd.	Japon	Produits industriels	(1 050)	(25)	(33)
KeePer Technical Laboratory Co. Ltd.	Japon	Matériaux	(700)	(19)	(35)
Keio Corp.	Japon	Produits industriels	(100)	(6)	(5)
Kelt Exploration Ltd.	Canada	Énergie	(40 000)	(241)	(184)
Kesko OYJ, cat. B	Finlande	Consommation de base	(553)	(22)	(16)
Kikkoman Corp.	Japon	Consommation de base	(200)	(20)	(14)
Kilroy Realty Corp.	États-Unis	Biens immobiliers	(269)	(23)	(12)
Kinetik Holdings Inc.	États-Unis	Énergie	(200)	(8)	(8)
Kingsoft Cloud Holdings, CAAE	Chine	Technologie de l'information	(300)	(1)	(4)
Kinsale Capital Group Inc.	États-Unis	Services financiers	(58)	(17)	(24)
Kintetsu Corp.	Japon	Produits industriels	(600)	(27)	(26)
KKR & Co. LP	États-Unis	Services financiers	(350)	(22)	(25)
Kobayashi Pharmaceutical Co. Ltd.	Japon	Consommation de base	(200)	(21)	(17)
Kobe Bussan Co. Ltd.	Japon	Consommation de base	(800)	(35)	(30)
KOEI TECMO HOLDINGS Co. Ltd.	Japon	Services de communication	(1 400)	(31)	(34)
Koito Manufacturing Co. Ltd.	Japon	Consommation discrétionnaire	(1 300)	(30)	(33)
Konami Corp.	Japon	Services de communication	(100)	(6)	(6)
Kornit Digital Ltd.	Israël	Produits industriels	(100)	(3)	(3)
Krystal Biotech Inc.	États-Unis	Soins de santé	(2 520)	(201)	(273)
K's Holdings Corp.	Japon	Consommation discrétionnaire	(2 600)	(31)	(31)
Kubota Corp.	Japon	Produits industriels	(900)	(25)	(18)
Kura Sushi USA Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(2 670)	(187)	(238)
Kusuri No Aoki Holdings Co. Ltd.	Japon	Consommation de base	(100)	(9)	(7)
L E Lundbergföretagen AB, cat. B	Suède	Services financiers	(150)	(10)	(9)
Lancaster Colony Corp.	États-Unis	Consommation de base	(23)	(6)	(6)
Lantheus Holdings Inc.	États-Unis	Soins de santé	(237)	(21)	(26)
Laredo Petroleum Holdings Inc.	États-Unis	Énergie	(3 250)	(346)	(200)
Legend Biotech Corp., CAAE	Chine	Soins de santé	(100)	(6)	(7)
Liberty Broadband Corp.	États-Unis	Services de communication	(205)	(35)	(23)
Lithium Americas Corp.	Canada	Matériaux	(100)	(2)	(3)
Logitech International SA, nom.	Suisse	Technologie de l'information	(302)	(32)	(24)
LXI REIT PLC	Royaume-Uni	Biens immobiliers	(17 432)	(41)	(29)
M&G PLC	Royaume-Uni	Services financiers	(8 748)	(28)	(29)
Macquarie Group Ltd.	Australie	Services financiers	(196)	(31)	(31)
Madrigal Pharmaceuticals Inc.	États-Unis	Soins de santé	(29)	(9)	(10)
Magna International Inc.	Canada	Consommation discrétionnaire	(21)	(2)	(2)
Makita Corp.	Japon	Produits industriels	(1 300)	(43)	(44)
Les Aliments Maple Leaf Inc.	Canada	Consommation de base	(100)	(2)	(3)
Marathon Oil Corp.	États-Unis	Énergie	(15 200)	(209)	(493)
Matador Resources Co.	États-Unis	Énergie	(6 100)	(219)	(393)
Match Group Inc.	États-Unis	Services de communication	(370)	(40)	(19)
Mattel Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(100)	(3)	(2)
Maxeon Solar Technologies Ltd.	États-Unis	Technologie de l'information	(500)	(10)	(18)
MBIA Inc.	États-Unis	Services financiers	(100)	(2)	(1)
McCormick & Co. Inc., sans droit de vote	États-Unis	Consommation de base	(134)	(14)	(15)
Mediobanca SPA	Italie	Services financiers	(494)	(6)	(7)
Medpace Holdings Inc.	États-Unis	Soins de santé	(83)	(20)	(21)
Meiji Holdings Co. Ltd.	Japon	Consommation de base	(600)	(21)	(19)
Melco International Development Ltd.	Hong Kong	Consommation discrétionnaire	(13 000)	(21)	(20)

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
POSITIONS VENDEUR (suite)					
ACTIONS (suite)					
Meyer Burger Technology AG	Suisse	Technologie de l'information	(105)	–	–
Mitsui O.S.K. Lines Ltd.	Japon	Produits industriels	(900)	(30)	(30)
Mizuho Leasing Co. Ltd.	Japon	Services financiers	(800)	(26)	(29)
Moderna Inc.	États-Unis	Soins de santé	(27)	(7)	(6)
MONEXgroup Inc.	Japon	Services financiers	(6 600)	(32)	(32)
Morgan Stanley	États-Unis	Services financiers	(204)	(25)	(24)
MP Materials Corp.	États-Unis	Matériaux	(46)	(2)	(2)
Nabors Industries Ltd.	États-Unis	Énergie	(1 100)	(225)	(181)
Nachi-Fujikoshi Corp.	Japon	Produits industriels	(100)	(4)	(4)
National Australia Bank Ltd.	Australie	Services financiers	(464)	(12)	(12)
Banque Nationale du Canada	Canada	Services financiers	(350)	(34)	(34)
National Beverage Corp.	États-Unis	Consommation de base	(194)	(11)	(14)
Navitas Semiconductor Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	(2 400)	(17)	(24)
Neoen SA	France	Services publics	(265)	(11)	(11)
Neste Oil OYJ	Finlande	Énergie	(491)	(27)	(33)
New Fortress Energy Inc.	États-Unis	Énergie	(223)	(13)	(9)
New York Community Bancorp Inc.	États-Unis	Services financiers	(1 903)	(23)	(23)
Newell Brands Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(690)	(17)	(12)
NexGen Energy Ltd.	Canada	Énergie	(100)	(1)	(1)
Nexi SPA	Italie	Services financiers	(2 492)	(34)	(27)
NextDecade Corp.	États-Unis	Énergie	(600)	(4)	(4)
Nidec Corp.	Japon	Produits industriels	(200)	(30)	(14)
Nintendo Co. Ltd.	Japon	Services de communication	(100)	(6)	(5)
Nippon Light Metal Holdings Co. Ltd.	Japon	Matériaux	(2 100)	(30)	(31)
Nippon Paper Industries Co. Ltd.	Japon	Matériaux	(2 900)	(26)	(30)
nLight Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(2 000)	(43)	(28)
Nordic Semiconductor ASA	Norvège	Technologie de l'information	(1 476)	(31)	(31)
Northland Power Inc.	Canada	Services publics	(475)	(18)	(16)
NorthWestern Corp.	États-Unis	Services publics	(400)	(31)	(31)
Norwegian Cruise Line Holdings Ltd.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(12 170)	(271)	(221)
NOV Inc.	États-Unis	Énergie	(16 900)	(267)	(423)
Novanta Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(15)	(3)	(3)
Novocure Ltd.	États-Unis	Soins de santé	(20)	(2)	(2)
NOW Inc.	États-Unis	Produits industriels	(26 600)	(357)	(401)
Nutrien Ltd.	Canada	Matériaux	(325)	(34)	(32)
Corporation Nuvei	Canada	Services financiers	(230)	(14)	(14)
Obsidian Energy Ltd.	Canada	Énergie	(25 000)	(206)	(216)
Ocado Group PLC	Royaume-Uni	Consommation de base	(5 312)	(70)	(48)
Occidental Petroleum Corp.	États-Unis	Énergie	(8 865)	(344)	(749)
Odakyu Electric Railway Co. Ltd.	Japon	Produits industriels	(1 200)	(29)	(21)
Omega Healthcare Investors Inc.	États-Unis	Biens immobiliers	(614)	(23)	(23)
Omni Bridgeway Ltd.	Australie	Services financiers	(8 577)	(33)	(21)
On Holding AG	Suisse	Consommation discrétionnaire	(473)	(11)	(20)
ON Semiconductor Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	(241)	(16)	(27)
ONEOK Inc.	États-Unis	Énergie	(5 891)	(378)	(506)
Oracle Corp. Japan	Japon	Technologie de l'information	(200)	(15)	(20)
Orica Ltd.	Australie	Matériaux	(2 088)	(37)	(29)
Ouster Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(3 000)	(11)	(3)
Overstock.com Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(200)	(5)	(5)
Packaging Corp. of America	États-Unis	Matériaux	(136)	(22)	(26)
Palantir Technologies Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(201)	(2)	(2)
Palomar Holdings Inc.	États-Unis	Services financiers	(3 000)	(241)	(224)
Pan Pacific International Holdings Corp.	Japon	Consommation discrétionnaire	(1 300)	(29)	(34)
Papa John's International Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(300)	(35)	(30)
Parkway Life Real Estate Investment Trust	Singapour	Biens immobiliers	(7 400)	(31)	(30)
PATRIZIA Immobilien AG	Allemagne	Biens immobiliers	(1 992)	(31)	(28)
Paycor HCM Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(443)	(15)	(16)
PBF Energy Inc.	États-Unis	Énergie	(7 492)	(74)	(439)
Peab AB	Suède	Produits industriels	(4 200)	(33)	(28)
Peabody Energy Corp.	États-Unis	Énergie	(312)	(12)	(11)
Penta-Ocean Construction Co. Ltd.	Japon	Produits industriels	(4 700)	(29)	(30)

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
POSITIONS VENDEUR (suite)					
ACTIONS (suite)					
Perimeter Solutions SA	États-Unis	Matériaux	(2 600)	(29)	(28)
Phoenix Group Holdings	Royaume-Uni	Services financiers	(2 725)	(28)	(25)
Picton Property Income Ltd.	Royaume-Uni	Biens immobiliers	(1 413)	(2)	(2)
Piedmont Lithium Inc.	États-Unis	Matériaux	(2 950)	(240)	(240)
Pioneer Natural Resources Co.	États-Unis	Énergie	(1 400)	(361)	(387)
Plug Power Inc.	États-Unis	Produits industriels	(1 494)	(33)	(24)
PointsBet Holdings Ltd., bons de souscription éch. 08-07-2024	Australie	Consommation discrétionnaire	(516)	–	–
Pool Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(46)	(24)	(21)
Power Integrations Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(300)	(34)	(34)
PowerCell Sweden AB	Suède	Produits industriels	(1 679)	(39)	(26)
PowerSchool Holdings Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(378)	(12)	(10)
Precinct Properties New Zealand Ltd.	Nouvelle-Zélande	Biens immobiliers	(28 639)	(42)	(31)
Primoris Services Corp.	États-Unis	Produits industriels	(300)	(7)	(10)
Prometheus Biosciences Inc.	États-Unis	Soins de santé	(54)	(9)	(8)
Prosus NV	Pays-Bas	Consommation discrétionnaire	(297)	(27)	(31)
Protector Forsikring ASA	Norvège	Services financiers	(76)	(1)	(1)
Proterra Inc.	États-Unis	Produits industriels	(500)	(2)	(1)
Pulse Biosciences Inc.	États-Unis	Soins de santé	(300)	(13)	(1)
Purple Innovation Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(200)	(2)	(1)
QT Group OYJ	Finlande	Technologie de l'information	(301)	(43)	(30)
RAKUS Co. Ltd.	Japon	Technologie de l'information	(1 600)	(23)	(31)
Rakuten Inc.	Japon	Consommation discrétionnaire	(4 500)	(30)	(28)
Range Resources Corp.	États-Unis	Énergie	(8 100)	(144)	(290)
Ranpak Holdings Corp.	États-Unis	Matériaux	(1 600)	(17)	(11)
RBC Bearings Inc.	États-Unis	Produits industriels	(76)	(19)	(24)
REA Group Ltd.	Australie	Services de communication	(228)	(26)	(29)
Recticel SA	Belgique	Matériaux	(926)	(23)	(23)
Reece Ltd.	Australie	Produits industriels	(972)	(14)	(15)
Regal Rexnord Corp.	États-Unis	Produits industriels	(126)	(26)	(24)
Rémy Cointreau SA	France	Consommation de base	(15)	(4)	(4)
RenaissanceRe Holdings Ltd.	Bermudes	Services financiers	(16)	(3)	(4)
Revolve Group Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(6 400)	(240)	(228)
RH	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(67)	(29)	(22)
Rheinmetall AG	Allemagne	Produits industriels	(38)	(8)	(15)
Rio Tinto Ltd.	Australie	Matériaux	(88)	(8)	(10)
Riot Blockchain Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(200)	(1)	(3)
Rivian Automotive Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(1 007)	(31)	(21)
RLI Corp.	États-Unis	Services financiers	(113)	(16)	(20)
RLX Technology Inc.	Chine	Consommation de base	(400)	(1)	(2)
Robert Half International Inc.	États-Unis	Produits industriels	(26)	(3)	(3)
Rocket Lab USA Inc.	États-Unis	Produits industriels	(2 200)	(13)	(12)
Roland Corp.	Japon	Consommation discrétionnaire	(800)	(31)	(33)
Rollins Inc.	États-Unis	Produits industriels	(249)	(11)	(13)
Banque Royale du Canada	Canada	Services financiers	(94)	(11)	(12)
Royal Gold Inc.	États-Unis	Matériaux	(78)	(12)	(14)
Royalty Pharma PLC	États-Unis	Soins de santé	(448)	(22)	(22)
Ryan Specialty Holdings Inc.	États-Unis	Services financiers	(144)	(8)	(8)
Saia Inc.	États-Unis	Produits industriels	(25)	(9)	(9)
Salmar ASA	Norvège	Consommation de base	(294)	(14)	(17)
Samsara Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(313)	(4)	(8)
Samty Co. Ltd.	Japon	Biens immobiliers	(1 400)	(33)	(31)
Santos Ltd.	Australie	Énergie	(1 807)	(12)	(11)
Sartorius Stedim Biotech SA	France	Soins de santé	(26)	(11)	(11)
Scatec Solar ASA	Norvège	Services publics	(734)	(21)	(7)
Schibsted ASA, cat. B	Norvège	Services de communication	(276)	(7)	(6)
Schroders PLC	Royaume-Uni	Services financiers	(1 339)	(10)	(10)
Sea Ltd.	Singapour	Services de communication	(130)	(20)	(15)
SEGR0 PLC	Royaume-Uni	Biens immobiliers	(2 183)	(34)	(28)
Senseonics Holdings Inc.	États-Unis	Soins de santé	(5 800)	(23)	(6)
Sensiron Holding AG	Suisse	Technologie de l'information	(152)	(22)	(23)
SES-imagotag SA	France	Technologie de l'information	(60)	(8)	(10)

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
POSITIONS VENDEUR (suite)					
ACTIONS (suite)					
Severn Trent PLC	Royaume-Uni	Services publics	(568)	(21)	(27)
SFS Group AG	Suisse	Produits industriels	(194)	(28)	(34)
SG Holdings Co. Ltd.	Japon	Produits industriels	(500)	(14)	(10)
Shaftesbury Capital PLC	Royaume-Uni	Biens immobiliers	(30 869)	(72)	(59)
Sharp Corp.	Japon	Consommation discrétionnaire	(3 200)	(31)	(31)
Shenzhen International Holdings Ltd.	Chine	Produits industriels	(10 000)	(10)	(12)
Shinsei Bank Ltd.	Japon	Services financiers	(700)	(15)	(17)
Shockwave Medical Inc.	États-Unis	Soins de santé	(1 080)	(250)	(317)
SHOP APOTHEKE EUROPE NV	Pays-Bas	Consommation de base	(24)	(5)	(3)
Shopify Inc., cat. A	Canada	Technologie de l'information	(495)	(27)	(32)
SI-BONE Inc.	États-Unis	Soins de santé	(200)	(7)	(5)
Signify Health Inc.	États-Unis	Soins de santé	(100)	(4)	(4)
SilverBow Resources Inc.	États-Unis	Énergie	(6 080)	(270)	(188)
SiTime Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	(1 300)	(227)	(250)
Sitio Royalties Corp., cat. A	États-Unis	Énergie	(7 200)	(239)	(220)
Skechers USA Inc., cat. A	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(65)	(3)	(4)
Skeena Resources Ltd.	Canada	Matériaux	(3 800)	(34)	(31)
SKF AB, B	Suède	Produits industriels	(1 128)	(24)	(30)
SM Energy Co.	États-Unis	Énergie	(6 700)	(339)	(255)
Snowflake Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(97)	(18)	(20)
SoFi Technologies Inc.	États-Unis	Services financiers	(2 538)	(21)	(21)
Sofina SA	Belgique	Services financiers	(59)	(22)	(18)
Software AG	Allemagne	Technologie de l'information	(184)	(10)	(5)
Solaris Resources Inc.	Canada	Matériaux	(1 100)	(11)	(7)
Southwestern Energy Co.	États-Unis	Énergie	(40 300)	(221)	(273)
Spartan Delta Corp.	Canada	Énergie	(40 300)	(393)	(568)
Spirit Airlines Inc.	États-Unis	Produits industriels	(300)	(8)	(7)
SPS Commerce Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(63)	(13)	(13)
SS&C Technologies Holdings Inc.	États-Unis	Produits industriels	(177)	(17)	(14)
St. James's Place PLC	Royaume-Uni	Services financiers	(1 477)	(28)	(30)
STERIS PLC	États-Unis	Soins de santé	(93)	(26)	(24)
Suncor Énergie Inc.	Canada	Énergie	(11 000)	(460)	(462)
Sunnova Energy International Inc.	États-Unis	Services publics	(10 200)	(254)	(216)
Sunrun Inc.	États-Unis	Produits industriels	(100)	(6)	(3)
Super Micro Computer Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(174)	(21)	(25)
Surge Energy Inc.	Canada	Énergie	(35 700)	(339)	(314)
Svenska Cellulosa AB (SCA), B	Suède	Matériaux	(1 365)	(25)	(24)
Svenska Handelsbanken AB, A	Suède	Services financiers	(2 077)	(24)	(24)
Sweetgreen Inc., cat. A	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(20 900)	(235)	(222)
Swisscom AG, nom.	Suisse	Services de communication	(40)	(27)	(35)
Synnex Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	(131)	(17)	(17)
Syrah Resources Ltd.	Australie	Matériaux	(9 458)	(16)	(16)
Takamatsu Construction Group Co. Ltd.	Japon	Produits industriels	(600)	(13)	(12)
TAL Education Group	Chine	Consommation discrétionnaire	(1 100)	(8)	(10)
Tapestry Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(236)	(11)	(14)
Corporation TC Énergie	Canada	Énergie	(600)	(35)	(32)
Technoprobe SPA	Italie	Technologie de l'information	(3 524)	(32)	(34)
TeliaSonera AB	Suède	Services de communication	(1 959)	(7)	(7)
TELUS International (Cda) Inc.	Philippines	Produits industriels	(452)	(13)	(12)
Tesla Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(992)	(255)	(278)
Texas Pacific Land Trust	États-Unis	Énergie	(9)	(23)	(21)
La Banque de Nouvelle-Écosse	Canada	Services financiers	(125)	(9)	(9)
The Berkeley Group Holdings PLC	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	(350)	(18)	(25)
The Buckle Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(200)	(11)	(10)
The Chiba Bank Ltd.	Japon	Services financiers	(600)	(5)	(5)
The Cooper Companies Inc.	États-Unis	Soins de santé	(49)	(25)	(25)
The Home Depot Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(27)	(11)	(11)
The New York Times Co., cat. A	États-Unis	Services de communication	(458)	(23)	(24)
The PRS REIT PLC	Royaume-Uni	Biens immobiliers	(11 424)	(16)	(15)
The Scotts Miracle-Gro Co., cat. A	États-Unis	Matériaux	(100)	(7)	(9)
THG Holdings Ltd.	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	(4 270)	(5)	(5)

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
POSITIONS VENDEUR (suite)					
ACTIONS (suite)					
Thule Group AB	Suède	Consommation discrétionnaire	(1 024)	(29)	(34)
Tohoku Electric Power Co. Inc.	Japon	Services publics	(4 500)	(31)	(30)
Tokyo Electric Power Co. Holdings Inc.	Japon	Services publics	(6 700)	(31)	(32)
TOMRA Systems ASA	Norvège	Produits industriels	(795)	(16)	(18)
Topdanmark AS	Danemark	Services financiers	(426)	(24)	(31)
Topicus.com Inc.	Canada	Technologie de l'information	(138)	(13)	(13)
Topsports International Holdings Ltd.	Chine	Consommation discrétionnaire	(25 000)	(29)	(31)
TORM PLC	Royaume-Uni	Énergie	(30)	(1)	(1)
Total SA	France	Énergie	(413)	(26)	(33)
Toto Ltd.	Japon	Produits industriels	(400)	(19)	(18)
TPI Composites Inc.	États-Unis	Produits industriels	(100)	(2)	(2)
Tractor Supply Co.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(45)	(14)	(14)
TransMedics Group Inc.	États-Unis	Soins de santé	(100)	(6)	(10)
Traton SE	Allemagne	Produits industriels	(116)	(4)	(3)
Trex Co. Inc.	États-Unis	Produits industriels	(239)	(15)	(16)
Trifork Holding AG	Danemark	Technologie de l'information	(327)	(16)	(10)
Tritax Big Box REIT PLC	Royaume-Uni	Biens immobiliers	(4 557)	(12)	(11)
Triumph Group Inc., bons de souscription éch. 05-12-2023	États-Unis	Produits industriels	(360)	(1)	-
Trustmark Corp.	États-Unis	Services financiers	(800)	(31)	(27)
Twilio Inc., cat. A	États-Unis	Technologie de l'information	(2 430)	(259)	(219)
Tyler Technologies Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(52)	(32)	(25)
UACJ Corp.	Japon	Matériaux	(300)	(8)	(8)
UBS Group AG	Suisse	Services financiers	(1 227)	(27)	(35)
UK Commercial Property REIT Ltd.	Royaume-Uni	Biens immobiliers	(15 862)	(14)	(14)
UMH Properties Inc.	États-Unis	Biens immobiliers	(700)	(16)	(14)
United Bankshares Inc.	États-Unis	Services financiers	(423)	(20)	(20)
United Overseas Bank Ltd.	Singapour	Services financiers	(1 100)	(29)	(33)
United Parcel Service Inc. (UPS), cat. B	États-Unis	Produits industriels	(16)	(4)	(4)
United Utilities Group PLC	Royaume-Uni	Services publics	(1 588)	(21)	(28)
Unity Software Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(392)	(15)	(17)
Universal Music Group BV	Pays-Bas	Services de communication	(144)	(5)	(5)
UPM-Kymmene OYJ	Finlande	Matériaux	(96)	(5)	(4)
VeriSign Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(17)	(5)	(5)
VF Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(167)	(6)	(5)
Victoria's Secret & Co.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(300)	(13)	(14)
Virgin Galactic Holdings Inc.	États-Unis	Produits industriels	(3 300)	(40)	(18)
Vuzix Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(1 400)	(18)	(8)
Warehouse Real Estate Investment Trust PLC	Royaume-Uni	Biens immobiliers	(13 576)	(30)	(23)
Warner Bros Discovery Inc.	États-Unis	Services de communication	(1 111)	(16)	(23)
Wayfair Inc., cat. A	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(84)	(7)	(4)
WD-40 Co.	États-Unis	Consommation de base	(100)	(29)	(24)
WESCO International Inc.	États-Unis	Produits industriels	(121)	(18)	(25)
Wheaton Precious Metals Corp.	Bésil	Matériaux	(281)	(15)	(18)
Williams-Sonoma Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	(138)	(27)	(23)
Wolfspeed Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(2 716)	(300)	(239)
Woodside Petroleum Ltd.	Australie	Énergie	(1 040)	(31)	(32)
Woolworths Ltd.	Australie	Consommation de base	(401)	(12)	(14)
Xior Student Housing NV	Belgique	Biens immobiliers	(596)	(42)	(27)
Yamada Denki Co. Ltd.	Japon	Consommation discrétionnaire	(6 400)	(30)	(30)
Yamaguchi Financial Group Inc.	Japon	Services financiers	(3 400)	(24)	(28)
Yara International ASA	Norvège	Matériaux	(440)	(27)	(26)
Yaskawa Electric Corp.	Japon	Produits industriels	(200)	(10)	(12)
Yatsen Holding Ltd.	Chine	Consommation de base	(1 900)	(2)	(4)
Zai Lab Ltd., CAAE	Chine	Soins de santé	(100)	(5)	(4)
Zalando SE	Allemagne	Consommation discrétionnaire	(108)	(4)	(6)
Zhongsheng Group Holdings Ltd.	Chine	Consommation discrétionnaire	(1 500)	(9)	(10)
Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co. Ltd.	Chine	Produits industriels	(37 200)	(21)	(26)
Zscaler Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	(1 500)	(209)	(237)
Total des actions				(24 978)	(27 851)

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
FONDS/BILLETS NÉGOCIÉS EN BOURSE					
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	(183)	(20)	(19)
SPDR Bloomberg Barclays Convertible Securities ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	(1 826)	(130)	(166)
Total des fonds/billets négociés en bourse				(150)	(185)
Total des positions vendeur				(26 170)	(29 081)
Coûts de transaction				(17)	–
Total des placements				45 106	42 470
Instruments dérivés					
(se reporter au tableau des instruments dérivés)					
Obligation pour options vendues (se reporter au tableau des options vendues)					
					504
					(73)
³ Trésorerie et équivalents de trésorerie					49 656
Autres éléments d'actif moins le passif					3 139
Actif net attribuable aux porteurs de titres					95 696

¹ Ce fonds est géré par Mackenzie.

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

³ Comprend 15 490 \$ détenus dans le Fonds du marché monétaire canadien Mackenzie, série R, un fonds géré par Mackenzie.

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

APERÇU DU PORTEFEUILLE

31 MARS 2023

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Trésorerie et placements à court terme*	39,5	–	39,5
Autres éléments d'actif (de passif)	3,4	24,3	27,7
Actions	49,8	(33,9)	15,9
<i>Actions</i>	46,5	(29,0)	17,5
<i>Contrats à terme standardisés</i>	2,9	(4,8)	(1,9)
<i>Options achetées</i>	0,4	–	0,4
<i>Options vendues</i>	–	(0,1)	(0,1)
Obligations	35,3	(21,0)	14,3
<i>Obligations</i>	31,0	(1,1)	29,9
<i>Contrats à terme standardisés</i>	4,2	(19,9)	(15,7)
<i>Options achetées</i>	0,1	–	0,1
<i>Options vendues</i>	–	–	–
Contrats à terme standardisés sur marchandises	1,8	(0,3)	1,5
Fonds/billets négociés en bourse	1,1	(0,2)	0,9
Swaps	–	–	–
Fonds privés	0,2	–	0,2

31 MARS 2022

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Obligations	74,0	(11,9)	62,1
<i>Obligations</i>	19,3	(1,5)	17,8
<i>Contrats à terme standardisés</i>	54,6	(10,4)	44,2
<i>Options achetées</i>	0,1	–	0,1
<i>Options vendues</i>	–	(0,0)	(0,0)
Actions	68,8	(39,9)	28,9
<i>Actions</i>	60,1	(36,6)	23,5
<i>Contrats à terme standardisés</i>	8,1	(2,8)	5,3
<i>Options achetées</i>	0,6	–	0,6
<i>Options vendues</i>	–	(0,5)	(0,5)
Autres éléments d'actif (de passif)	(7,7)	14,3	6,6
Marchandises	3,3	(1,0)	2,3
<i>Marchandises</i>	0,0	0,0	0,0
<i>Contrats à terme standardisés</i>	3,3	(1,0)	2,3
Swaps	0,1	–	0,1
Trésorerie et placements à court terme*	0,0	0,0	0,0

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Trésorerie et placements à court terme*	39,5	–	39,5
Autres éléments d'actif (de passif)	3,4	24,3	27,7
Canada	26,1	(8,1)	18,0
Chine	12,4	(0,4)	12,0
États-Unis	31,9	(22,4)	9,5
Australie	3,5	–	3,5
France	1,7	(0,2)	1,5
Brésil	1,1	–	1,1
Pays-Bas	1,2	(0,1)	1,1
Espagne	0,7	–	0,7
Royaume-Uni	1,8	(1,3)	0,5
Afrique du Sud	0,5	–	0,5
Italie	0,4	–	0,4
Luxembourg	0,4	–	0,4
Mexique	–	(0,4)	(0,4)
Autre	5,0	(5,5)	(0,5)
Norvège	–	(0,6)	(0,6)
Allemagne	0,3	(3,0)	(2,7)
Japon	1,2	(13,4)	(12,2)

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
États-Unis	70,5	(29,3)	41,2
Canada	28,4	(8,3)	20,1
Australie	13,3	(0,6)	12,7
Chine	10,9	(0,3)	10,6
Autre	8,6	(1,9)	6,7
Autres éléments d'actif (de passif)	(7,7)	14,3	6,6
Royaume-Uni	4,1	(0,8)	3,3
Allemagne	2,8	(0,2)	2,6
Pays-Bas	2,1	(0,2)	1,9
France	1,8	(1,6)	0,2
Trésorerie et placements à court terme*	0,0	0,0	0,0
Norvège	0,9	(1,1)	(0,2)
Mexique	–	(0,3)	(0,3)
Suisse	0,4	(0,9)	(0,5)
Japon	1,5	(3,5)	(2,0)
Italie	0,9	(3,8)	(2,9)

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Trésorerie et placements à court terme*	39,5	–	39,5
Autres éléments d'actif (de passif)	3,4	24,3	27,7
Obligations de sociétés	28,7	(1,1)	27,6
Énergie	18,9	(13,9)	5,0
Technologie de l'information	5,4	(2,6)	2,8
Consommation discrétionnaire	4,8	(2,3)	2,5
Soins de santé	4,0	(1,5)	2,5
Obligations d'État étrangères	1,7	–	1,7
Services de communication	2,3	(0,6)	1,7
Contrats à terme standardisés sur marchandises	1,8	(0,3)	1,5
Consommation de base	2,0	(0,8)	1,2
Produits industriels	3,0	(2,0)	1,0
Autre	1,0	–	1,0
Fonds/billets négociés en bourse	1,1	(0,2)	0,9
Services financiers	2,5	(2,0)	0,5
Biens immobiliers	1,4	(1,0)	0,4
Services publics	0,9	(0,7)	0,2
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,2	–	0,2
Énergie	–	(0,1)	(0,1)
Matériaux	1,4	(1,6)	(0,2)
Contrats à terme standardisés sur actions	2,9	(4,8)	(1,9)
Contrats à terme standardisés sur obligations	4,2	(19,9)	(15,7)

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Obligations – Contrats à terme standardisés	54,6	(10,4)	44,2
Obligations de sociétés	18,7	(1,5)	17,2
Énergie	32,3	(21,8)	10,5
Autres éléments d'actif (de passif)	(7,7)	14,3	6,6
Contrats à terme standardisés sur actions	8,1	(2,8)	5,3
Contrats à terme standardisés sur marchandises	3,3	(1,0)	2,3
Services financiers	3,7	(1,8)	1,9
Consommation de base	2,5	(0,6)	1,9
Technologie de l'information	4,6	(2,8)	1,8
Consommation discrétionnaire	4,1	(2,4)	1,7
Soins de santé	3,1	(1,5)	1,6
Autre	3,2	(1,7)	1,5
Produits industriels	3,7	(2,5)	1,2
Matériaux	2,0	(1,0)	1,0
Services de communication	1,9	(1,0)	0,9
Obligations d'État étrangères	0,4	–	0,4
Trésorerie et placements à court terme*	0,0	0,0	0,0

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

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

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES OPTIONS ACHETÉES

au 31 mars 2023

Élément sous-jacent	Nombre de contrats	Type d'option	Date d'échéance	Prix d'exercice \$	Prime payée (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
SPDR S&P 500 ETF Trust	70	Vente	21 avril 2023	USD 365,00	69	3
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF	1 500	Vente	16 juin 2023	USD 72,00	206	84
Indice S&P 500	15	Vente	15 décembre 2023	USD 3 550,00	384	191
Indice S&P 500	15	Vente	15 mars 2024	USD 3 500,00	361	227
Total des options					1 020	505

TABLEAU DES OPTIONS VENDUES

au 31 mars 2023

Élément sous-jacent	Nombre de contrats	Type d'option	Date d'échéance	Prix d'exercice \$	Prime reçue (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
PDC Energy Inc.	(40)	Option d'achat vendue	21 avril 2023	USD 74,35	(24)	(1)
Devon Energy Corp.	(30)	Option d'achat vendue	16 juin 2023	USD 70,00	(12)	(1)
Devon Energy Corp.	(30)	Option d'achat vendue	16 juin 2023	USD 75,00	(15)	–
Diamondback Energy Inc.	(32)	Option d'achat vendue	16 juin 2023	USD 153,49	(44)	(13)
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF	(1 500)	Option de vente vendue	16 juin 2023	USD 64,00	(29)	(17)
MEG Energy Corp.	(150)	Option d'achat vendue	16 juin 2023	CAD 22,00	(18)	(27)
The Williams Companies Inc.	(80)	Option d'achat vendue	16 juin 2023	USD 35,00	(12)	(1)
PDC Energy Inc.	(40)	Option d'achat vendue	21 juillet 2023	USD 79,35	(25)	(13)
Total des options					(179)	(73)

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS

au 31 mars 2023

Tableau des contrats de swap

Note de crédit de la contrepartie	Nombre de contrats	Échéance	Rendement payé par le Fonds, en fonction de	Rendement reçu par le Fonds, en fonction de	Montant notionnel (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
AA	(5 492)	10 avril 2023	Taux de financement à un jour de la Banque (\$ US) taux de financement à 1 jour minoré de 2,75 %	iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF	555	–	(5)
AA	5 016	13 avril 2023	Taux de financement à un jour de la Banque (\$ US) taux de financement à 1 jour minoré de 0,85 %	iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF	517	3	–
AA	(23 798)	5 mai 2023	Taux de financement à un jour de la Banque (\$ US) taux de financement à 1 jour majoré de 0,35 %	Xtrackers USD High Yield Corporate Bond ETF	1 126	–	(11)
Total des contrats de swap					2 198	3	(16)

Tableau des contrats à terme standardisés

Type de contrat	Nombre de contrats	Date d'échéance	Prix moyen des contrats (\$)	Montant notionnel* (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
Contrats à terme standardisés sur l'indice IBEX 35, avril 2023	2	21 avril 2023	9 098,00 EUR	270	3	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice OMXS30, avril 2023	(3)	21 avril 2023	2 163,75 SEK	(87)	–	(2)
Contrats à terme standardisés sur le gaz naturel, mai 2023	(1)	26 avril 2023	2,15 USD	(30)	–	(1)
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE China A50, avril 2023	(6)	27 avril 2023	13 085,28 USD	(108)	–	(2)
Contrats à terme standardisés sur le sucre n° 11 (monde), mai 2023	(1)	28 avril 2023	21,32 USD	(34)	–	(1)
Contrats à terme standardisés sur le maïs, mai 2023	2	12 mai 2023	660,89 USD	89	–	–
Contrats à terme standardisés sur le blé RVH de KC, mai 2023	(1)	12 mai 2023	856,82 USD	(59)	–	(1)
Contrats à terme standardisés sur le blé (CBT), mai 2023	2	12 mai 2023	750,63 USD	94	–	(8)
Contrats à terme standardisés sur euro-obligations, juin 2023	(14)	8 juin 2023	133,43 EUR	(2 790)	–	(92)
Contrats à terme standardisés libellés en yens sur l'indice Nikkei 225, juin 2023	(4)	8 juin 2023	27 333,46 JPY	(575)	–	(18)
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans de moindre valeur, juin 2023	(2)	12 juin 2023	145,12 JPY	(301)	–	(6)
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans, juin 2023	(7)	13 juin 2023	145,55 JPY	(10 566)	–	(187)
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor australien à 10 ans, juin 2023	28	15 juin 2023	120,23 AUD	3 112	76	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE/JSE Top 40, juin 2023	8	15 juin 2023	70 466,05 ZAR	433	7	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice S&P/TSX 60, juin 2023	(1)	15 juin 2023	1 178,81 CAD	(242)	–	(6)
Contrats à terme standardisés sur l'indice SPI 200, juin 2023	1	15 juin 2023	7 052,00 AUD	163	3	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-Mini NASDAQ 100, juin 2023	(2)	16 juin 2023	12 062,80 USD	(720)	–	(67)
Contrats à terme standardisés sur l'indice Euro STOXX 50, juin 2023	(31)	16 juin 2023	4 097,75 EUR	(1 942)	–	(80)
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE/MIB 100, juin 2023	2	16 juin 2023	26 140,00 EUR	391	8	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice Bolsa Mexicana, juin 2023	(10)	16 juin 2023	53 655,00 MXN	(407)	–	(4)
Contrats à terme standardisés sur l'indice Swiss Market, juin 2023	(2)	16 juin 2023	10 517,00 CHF	(325)	–	(14)
Contrats à terme standardisés sur l'aluminium LME, juin 2023	(1)	19 juin 2023	2 356,50 USD	(82)	–	(2)
Contrats à terme standardisés sur le zinc LME, juin 2023	1	19 juin 2023	2 951,75 USD	99	–	(1)
Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 10 ans, juin 2023	(15)	21 juin 2023	121,36 CAD	(1 892)	–	(75)

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 31 mars 2023

Tableau des contrats à terme standardisés (suite)

Type de contrat	Nombre de contrats	Date d'échéance	Prix moyen des contrats (\$)	Montant notionnel* (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor américain à 10 ans, juin 2023	(15)	21 juin 2023	111,70 USD	(2 332)	–	(63)
Contrats à terme standardisés sur l'indice CME E-Mini Standard & Poor's 500, juin 2023	5	21 juin 2023	3 890,60 USD	1 399	84	–
Contrats à terme standardisés à très long terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans, juin 2023	3	21 juin 2023	115,84 USD	492	22	–
Contrats à terme standardisés sur l'or, 100 oz, juin 2023	5	28 juin 2023	1 876,81 USD	1 343	109	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du Royaume-Uni, juin 2023	(4)	28 juin 2023	101,08 GBP	(690)	–	(15)
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor américain à 5 ans, juin 2023	2	30 juin 2023	106,63 USD	296	8	–
Contrats à terme standardisés sur l'huile de soja, juin 2023	(2)	14 juillet 2023	61,22 USD	(90)	9	–
Total des contrats à terme standardisés				(15 091)	329	(645)

* Le montant notionnel représente l'exposition aux instruments sous-jacents au 31 mars 2023.

Tableau des contrats de change à terme de gré à gré

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	120 AUD	(60) USD	4 avril 2023	81	80	–	(1)
A	59 USD	(120) AUD	4 avril 2023	(80)	(80)	–	–
A	92 CAD	(50) USD	4 avril 2023	(68)	(67)	1	–
A	50 USD	(92) CAD	4 avril 2023	68	68	–	–
A	51 USD	(64) CHF	4 avril 2023	(69)	(71)	–	(2)
A	64 CHF	(52) USD	4 avril 2023	70	70	–	–
A	71 EUR	(55) USD	4 avril 2023	75	77	2	–
A	57 USD	(71) EUR	4 avril 2023	(77)	(77)	–	–
A	122 GBP	(109) USD	4 avril 2023	148	152	4	–
A	112 USD	(122) GBP	4 avril 2023	(151)	(151)	–	–
A	1 USD	(300) JPY	4 avril 2023	(2)	(2)	–	–
A	300 JPY	(1) USD	4 avril 2023	2	2	–	–
A	146 USD	(2 030) NOK	4 avril 2023	(197)	(193)	4	–
A	2 030 NOK	(143) USD	4 avril 2023	194	194	–	–
A	198 NZD	(91) USD	4 avril 2023	123	125	2	–
A	92 USD	(198) NZD	4 avril 2023	(124)	(124)	–	–
A	54 USD	(760) SEK	4 avril 2023	(73)	(73)	–	–
A	760 SEK	(54) USD	4 avril 2023	73	73	–	–
A	18 AUD	(10) USD	20 avril 2023	13	12	–	(1)
A	118 BRL	(16) USD	20 avril 2023	22	24	2	–
A	25 BRL	(4) USD	20 avril 2023	5	5	–	–
A	27 BRL	(4) USD	20 avril 2023	5	5	–	–
A	24 BRL	(4) USD	20 avril 2023	5	5	–	–
A	36 BRL	(5) USD	20 avril 2023	7	7	–	–
A	27 USD	(47) CAD	20 avril 2023	35	36	1	–
A	5 USD	(10) CAD	20 avril 2023	7	7	–	–
A	5 USD	(9) CAD	20 avril 2023	7	7	–	–
A	13 USD	(23) CAD	20 avril 2023	17	17	–	–
A	4 USD	(6) CAD	20 avril 2023	5	5	–	–
A	4 USD	(7) CAD	20 avril 2023	5	5	–	–
A	467 CLP	(1) USD	20 avril 2023	1	1	–	–

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 31 mars 2023

Tableau des contrats de change à terme de gré à gré (suite)

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	12 023 CLP	(10) USD	20 avril 2023	14	15	1	–
A	3 USD	(3 325) CLP	20 avril 2023	(4)	(4)	–	–
A	3 USD	(3 152) CLP	20 avril 2023	(4)	(4)	–	–
A	3 USD	(2 971) CLP	20 avril 2023	(4)	(4)	–	–
A	4 557 CLP	(4) USD	20 avril 2023	6	6	–	–
A	4 USD	(43) CNY	20 avril 2023	(6)	(6)	–	–
A	35 USD	(329) CNY	20 avril 2023	(47)	(48)	–	(1)
A	59 CNY	(7) USD	20 avril 2023	9	9	–	–
A	26 164 COP	(4) USD	20 avril 2023	5	6	1	–
A	128 126 COP	(19) USD	20 avril 2023	26	28	2	–
A	32 532 COP	(5) USD	20 avril 2023	7	8	1	–
A	43 339 COP	(7) USD	20 avril 2023	9	9	–	–
A	32 350 COP	(5) USD	20 avril 2023	7	7	–	–
A	4 USD	(117) CZK	20 avril 2023	(5)	(5)	–	–
A	3 USD	(99) CZK	20 avril 2023	(4)	(4)	–	–
A	3 USD	(99) CZK	20 avril 2023	(4)	(4)	–	–
A	4 USD	(117) CZK	20 avril 2023	(5)	(5)	–	–
A	10 EUR	(8) USD	20 avril 2023	11	11	–	–
A	1 EUR	(1) USD	20 avril 2023	1	1	–	–
A	5 EUR	(4) USD	20 avril 2023	6	6	–	–
A	5 EUR	(4) USD	20 avril 2023	6	6	–	–
A	12 EUR	(10) USD	20 avril 2023	14	14	–	–
A	4 EUR	(3) USD	20 avril 2023	4	4	–	–
A	15 EUR	(12) USD	20 avril 2023	16	16	–	–
A	4 EUR	(3) USD	20 avril 2023	4	4	–	–
A	13 USD	(14) GBP	20 avril 2023	(18)	(18)	–	–
A	12 USD	(14) GBP	20 avril 2023	(16)	(16)	–	–
A	10 USD	(11) GBP	20 avril 2023	(14)	(14)	–	–
A	3 GBP	(3) USD	20 avril 2023	4	4	–	–
A	10 GBP	(9) USD	20 avril 2023	12	12	–	–
A	119 631 IDR	(6) USD	20 avril 2023	8	8	–	–
A	233 810 IDR	(11) USD	20 avril 2023	15	16	1	–
A	75 069 IDR	(4) USD	20 avril 2023	5	5	–	–
A	149 901 IDR	(7) USD	20 avril 2023	10	10	–	–
A	105 862 IDR	(5) USD	20 avril 2023	7	7	–	–
A	4 USD	(88 771) IDR	20 avril 2023	(6)	(6)	–	–
A	3 USD	(14) ILS	20 avril 2023	(4)	(4)	–	–
A	66 ILS	(14) USD	20 avril 2023	19	18	–	(1)
A	37 USD	(172) ILS	20 avril 2023	(50)	(47)	3	–
A	21 ILS	(4) USD	20 avril 2023	6	5	–	(1)
A	4 USD	(21) ILS	20 avril 2023	(6)	(6)	–	–
A	18 ILS	(4) USD	20 avril 2023	5	5	–	–
A	30 ILS	(6) USD	20 avril 2023	8	8	–	–
A	5 USD	(25) ILS	20 avril 2023	(7)	(7)	–	–
A	14 USD	(1 583) INR	20 avril 2023	(19)	(19)	–	–
A	2 749 INR	(24) USD	20 avril 2023	33	33	–	–
A	408 INR	(4) USD	20 avril 2023	5	5	–	–
A	503 INR	(4) USD	20 avril 2023	6	6	–	–
A	722 INR	(7) USD	20 avril 2023	9	9	–	–
A	5 USD	(594) INR	20 avril 2023	(7)	(7)	–	–
A	3 USD	(361) INR	20 avril 2023	(4)	(4)	–	–

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 31 mars 2023

Tableau des contrats de change à terme de gré à gré (suite)

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	7 USD	(767) INR	20 avril 2023	(9)	(9)	–	–
A	67 JPY	(1) USD	20 avril 2023	1	1	–	–
A	4 USD	(839) JPY	20 avril 2023	(6)	(6)	–	–
A	4 USD	(593) JPY	20 avril 2023	(5)	(5)	–	–
A	3 USD	(551) JPY	20 avril 2023	(4)	(4)	–	–
A	818 JPY	(4) USD	20 avril 2023	6	6	–	–
A	3 USD	(601) JPY	20 avril 2023	(4)	(4)	–	–
A	3 USD	(599) JPY	20 avril 2023	(4)	(4)	–	–
A	1 174 JPY	(7) USD	20 avril 2023	9	9	–	–
A	2 USD	(3 717) KOR	20 avril 2023	(3)	(3)	–	–
A	10 USD	(15 592) KOR	20 avril 2023	(13)	(12)	1	–
A	3 USD	(5 577) KOR	20 avril 2023	(4)	(4)	–	–
A	325 MXN	(13) USD	20 avril 2023	17	19	2	–
A	332 MXN	(13) USD	20 avril 2023	17	19	2	–
A	100 MXN	(4) USD	20 avril 2023	5	6	1	–
A	4 USD	(119) MXN	20 avril 2023	(6)	(6)	–	–
A	148 MXN	(6) USD	20 avril 2023	8	9	1	–
A	7 USD	(184) MXN	20 avril 2023	(10)	(11)	–	(1)
A	370 NOK	(28) USD	20 avril 2023	38	35	–	(3)
A	9 USD	(121) NOK	20 avril 2023	(12)	(11)	1	–
A	93 NOK	(7) USD	20 avril 2023	9	8	–	(1)
A	107 NOK	(8) USD	20 avril 2023	11	10	–	(1)
A	3 USD	(42) NOK	20 avril 2023	(4)	(4)	–	–
A	82 NOK	(6) USD	20 avril 2023	8	7	–	(1)
A	5 USD	(70) NOK	20 avril 2023	(7)	(7)	–	–
A	71 NOK	(5) USD	20 avril 2023	7	7	–	–
A	13 USD	(174) NOK	20 avril 2023	(17)	(17)	–	–
A	22 NZD	(10) USD	20 avril 2023	14	14	–	–
A	21 USD	(44) NZD	20 avril 2023	(28)	(27)	1	–
A	4 USD	(9) NZD	20 avril 2023	(6)	(6)	–	–
A	4 USD	(10) NZD	20 avril 2023	(6)	(6)	–	–
A	8 NZD	(4) USD	20 avril 2023	5	5	–	–
A	3 USD	(6) NZD	20 avril 2023	(4)	(4)	–	–
A	16 NZD	(7) USD	20 avril 2023	10	10	–	–
A	7 USD	(528) PHP	20 avril 2023	(10)	(10)	–	–
A	24 USD	(1 784) PHP	20 avril 2023	(33)	(33)	–	–
A	8 USD	(591) PHP	20 avril 2023	(11)	(11)	–	–
A	304 PHP	(4) USD	20 avril 2023	6	6	–	–
A	3 USD	(208) PHP	20 avril 2023	(4)	(4)	–	–
A	17 PLN	(3) USD	20 avril 2023	4	4	–	–
A	123 PLN	(21) USD	20 avril 2023	28	29	1	–
A	23 PLN	(4) USD	20 avril 2023	5	5	–	–
A	32 PLN	(5) USD	20 avril 2023	7	7	–	–
A	29 PLN	(5) USD	20 avril 2023	7	7	–	–
A	367 SEK	(26) USD	20 avril 2023	35	35	–	–
A	20 USD	(279) SEK	20 avril 2023	(27)	(27)	–	–
A	77 SEK	(5) USD	20 avril 2023	7	7	–	–
A	90 SEK	(7) USD	20 avril 2023	9	9	–	–
A	90 SEK	(6) USD	20 avril 2023	8	8	–	–
A	21 USD	(931) THB	20 avril 2023	(28)	(27)	1	–
A	11 USD	(485) THB	20 avril 2023	(15)	(14)	1	–

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 31 mars 2023

Tableau des contrats de change à terme de gré à gré (suite)

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	3 USD	(129) THB	20 avril 2023	(4)	(4)	–	–
A	6 USD	(266) THB	20 avril 2023	(8)	(8)	–	–
A	257 THB	(6) USD	20 avril 2023	8	8	–	–
A	3 USD	(130) THB	20 avril 2023	(4)	(4)	–	–
A	177 THB	(4) USD	20 avril 2023	5	5	–	–
A	1 USD	(21) ZAR	20 avril 2023	(1)	(1)	–	–
A	471 ZAR	(21) USD	20 avril 2023	28	26	–	(2)
A	143 ZAR	(6) USD	20 avril 2023	8	8	–	–
A	89 ZAR	(4) USD	20 avril 2023	5	5	–	–
A	75 ZAR	(3) USD	20 avril 2023	4	4	–	–
A	538 AUD	(277) USD	20 avril 2023	375	354	–	(21)
A	58 USD	(113) AUD	20 avril 2023	(78)	(75)	3	–
A	27 USD	(51) AUD	20 avril 2023	(36)	(34)	2	–
A	132 AUD	(69) USD	20 avril 2023	93	86	–	(7)
A	41 AUD	(21) USD	20 avril 2023	29	27	–	(2)
A	50 USD	(97) AUD	20 avril 2023	(67)	(64)	3	–
A	18 USD	(35) AUD	20 avril 2023	(24)	(23)	1	–
A	36 AUD	(18) USD	20 avril 2023	25	24	–	(1)
A	42 AUD	(21) USD	20 avril 2023	28	28	–	–
A	12 AUD	(6) USD	20 avril 2023	8	8	–	–
A	325 USD	(2 371) BRL	20 avril 2023	(440)	(477)	–	(37)
A	4 575 BRL	(628) USD	20 avril 2023	849	916	67	–
A	16 USD	(118) BRL	20 avril 2023	(22)	(23)	–	(1)
A	2 015 BRL	(285) USD	20 avril 2023	386	400	14	–
A	11 USD	(78) BRL	20 avril 2023	(15)	(15)	–	–
A	1 238 BRL	(174) USD	20 avril 2023	236	246	10	–
A	45 USD	(318) BRL	20 avril 2023	(61)	(62)	–	(1)
A	49 BRL	(7) USD	20 avril 2023	9	9	–	–
A	27 USD	(194) BRL	20 avril 2023	(37)	(38)	–	(1)
A	820 BRL	(117) USD	20 avril 2023	158	162	4	–
A	1 091 BRL	(154) USD	20 avril 2023	208	217	9	–
A	8 318 BRL	(1 192) USD	20 avril 2023	1 612	1 643	31	–
A	788 USD	(1 424) CAD	20 avril 2023	1 054	1 071	17	–
A	702 USD	(1 267) CAD	20 avril 2023	937	952	15	–
A	103 CAD	(57) USD	20 avril 2023	(76)	(77)	–	(1)
A	32 USD	(57) CAD	20 avril 2023	42	43	1	–
A	444 USD	(801) CAD	20 avril 2023	593	603	10	–
A	573 CAD	(317) USD	20 avril 2023	(424)	(432)	–	(8)
A	115 CAD	(64) USD	20 avril 2023	(85)	(86)	–	(1)
A	404 USD	(739) CAD	20 avril 2023	547	546	–	(1)
A	129 USD	(238) CAD	20 avril 2023	176	174	–	(2)
A	80 USD	(148) CAD	20 avril 2023	110	108	–	(2)
A	64 USD	(117) CAD	20 avril 2023	87	86	–	(1)
A	47 USD	(54 618) CLP	20 avril 2023	(64)	(70)	–	(6)
A	203 684 CLP	(177) USD	20 avril 2023	240	262	22	–
A	407 383 CLP	(356) USD	20 avril 2023	481	524	43	–
A	40 USD	(45 686) CLP	20 avril 2023	(54)	(58)	–	(4)
A	73 USD	(81 630) CLP	20 avril 2023	(99)	(105)	–	(6)
A	106 027 CLP	(97) USD	20 avril 2023	131	134	3	–
A	81 USD	(89 103) CLP	20 avril 2023	(110)	(113)	–	(3)
A	50 USD	(54 613) CLP	20 avril 2023	(68)	(70)	–	(2)

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 31 mars 2023

Tableau des contrats de change à terme de gré à gré (suite)

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)		Devise à remettre (en milliers de \$)		Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	33	USD	(36 053)	CLP	20 avril 2023	(45)	(45)	–	–
A	8 439	CLP	(7)	USD	20 avril 2023	10	10	–	–
A	18 591	CLP	(16)	USD	20 avril 2023	22	24	2	–
A	93	USD	(101 722)	CLP	20 avril 2023	(126)	(128)	–	(2)
A	131 587	CLP	(121)	USD	20 avril 2023	164	165	1	–
A	133	USD	(1 240)	CNY	20 avril 2023	(180)	(181)	–	(1)
A	22	USD	(205)	CNY	20 avril 2023	(30)	(30)	–	–
A	998	USD	(9 388)	CNY	20 avril 2023	(1 350)	(1 376)	–	(26)
A	1 705	CNY	(183)	USD	20 avril 2023	248	248	–	–
A	210	USD	(1 449 876)	COP	20 avril 2023	(284)	(319)	–	(35)
A	6 174 243	COP	(920)	USD	20 avril 2023	1 245	1 347	102	–
A	1 869 694	COP	(279)	USD	20 avril 2023	378	407	29	–
A	60	USD	(397 757)	COP	20 avril 2023	(81)	(86)	–	(5)
A	172 572	COP	(27)	USD	20 avril 2023	36	37	1	–
A	1 837 858	COP	(293)	USD	20 avril 2023	397	391	–	(6)
A	89	USD	(572 061)	COP	20 avril 2023	(121)	(122)	–	(1)
A	37	USD	(245 147)	COP	20 avril 2023	(50)	(53)	–	(3)
A	10	USD	(66 284)	COP	20 avril 2023	(14)	(15)	–	(1)
A	1 436 569	COP	(217)	USD	20 avril 2023	293	312	19	–
A	34	USD	(223 296)	COP	20 avril 2023	(46)	(49)	–	(3)
A	205 425	COP	(32)	USD	20 avril 2023	43	45	2	–
A	62 394	COP	(10)	USD	20 avril 2023	13	13	–	–
A	131	USD	(3 978)	CZK	20 avril 2023	(177)	(186)	–	(9)
A	67	USD	(2 014)	CZK	20 avril 2023	(90)	(94)	–	(4)
A	47	USD	(1 431)	CZK	20 avril 2023	(64)	(67)	–	(3)
A	678	CZK	(22)	USD	20 avril 2023	30	31	1	–
A	38	USD	(1 118)	CZK	20 avril 2023	(51)	(52)	–	(1)
A	396	CZK	(13)	USD	20 avril 2023	18	18	–	–
A	55	USD	(1 679)	CZK	20 avril 2023	(75)	(78)	–	(3)
A	62	USD	(1 862)	CZK	20 avril 2023	(84)	(87)	–	(3)
A	47	USD	(1 446)	CZK	20 avril 2023	(64)	(67)	–	(3)
A	18	USD	(558)	CZK	20 avril 2023	(25)	(26)	–	(1)
A	1 822	CZK	(61)	USD	20 avril 2023	82	85	3	–
A	47	USD	(1 402)	CZK	20 avril 2023	(64)	(65)	–	(1)
A	234	EUR	(183)	USD	20 avril 2023	248	256	8	–
A	36	EUR	(29)	USD	20 avril 2023	39	39	–	–
A	229	EUR	(183)	USD	20 avril 2023	248	249	1	–
A	44	USD	(54)	EUR	20 avril 2023	(59)	(59)	–	–
A	184	EUR	(149)	USD	20 avril 2023	201	200	–	(1)
A	313	EUR	(253)	USD	20 avril 2023	342	339	–	(3)
A	53	EUR	(43)	USD	20 avril 2023	58	58	–	–
A	99	EUR	(78)	USD	20 avril 2023	106	108	2	–
A	12	USD	(15)	EUR	20 avril 2023	(16)	(16)	–	–
A	442	EUR	(347)	USD	20 avril 2023	470	484	14	–
A	109	EUR	(86)	USD	20 avril 2023	116	119	3	–
A	106	EUR	(83)	USD	20 avril 2023	112	115	3	–
A	25	USD	(32)	EUR	20 avril 2023	(34)	(34)	–	–
A	203	USD	(224)	GBP	20 avril 2023	(274)	(278)	–	(4)
A	557	USD	(616)	GBP	20 avril 2023	(753)	(763)	–	(10)
A	4	USD	(5)	GBP	20 avril 2023	(6)	(6)	–	–
A	19	USD	(21)	GBP	20 avril 2023	(26)	(26)	–	–

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 31 mars 2023

Tableau des contrats de change à terme de gré à gré (suite)

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	279 USD	(305) GBP	20 avril 2023	(377)	(377)	–	–
A	25 GBP	(22) USD	20 avril 2023	30	30	–	–
A	63 USD	(71) GBP	20 avril 2023	(85)	(88)	–	(3)
A	106 GBP	(95) USD	20 avril 2023	128	130	2	–
A	68 USD	(76) GBP	20 avril 2023	(92)	(95)	–	(3)
A	13 GBP	(11) USD	20 avril 2023	15	15	–	–
A	126 GBP	(111) USD	20 avril 2023	150	158	8	–
A	282 GBP	(257) USD	20 avril 2023	348	348	–	–
A	36 USD	(755 095) IDR	20 avril 2023	(49)	(52)	–	(3)
A	12 334 515 IDR	(586) USD	20 avril 2023	792	836	44	–
A	4 USD	(94 464) IDR	20 avril 2023	(6)	(6)	–	–
A	28 USD	(573 296) IDR	20 avril 2023	(38)	(38)	–	–
A	3 085 572 IDR	(153) USD	20 avril 2023	207	206	–	(1)
A	76 USD	(1 546 036) IDR	20 avril 2023	(103)	(104)	–	(1)
A	917 418 IDR	(44) USD	20 avril 2023	60	61	1	–
A	3 365 663 IDR	(163) USD	20 avril 2023	221	226	5	–
A	266 845 IDR	(13) USD	20 avril 2023	18	18	–	–
A	2 913 284 IDR	(140) USD	20 avril 2023	189	197	8	–
A	126 USD	(2 585 306) IDR	20 avril 2023	(171)	(173)	–	(2)
A	737 ILS	(155) USD	20 avril 2023	209	204	–	(5)
A	733 USD	(3 423) ILS	20 avril 2023	(991)	(937)	54	–
A	196 USD	(916) ILS	20 avril 2023	(265)	(251)	14	–
A	208 ILS	(44) USD	20 avril 2023	60	57	–	(3)
A	254 ILS	(55) USD	20 avril 2023	75	68	–	(7)
A	140 USD	(636) ILS	20 avril 2023	(190)	(173)	17	–
A	283 ILS	(61) USD	20 avril 2023	82	77	–	(5)
A	528 ILS	(112) USD	20 avril 2023	152	145	–	(7)
A	192 ILS	(41) USD	20 avril 2023	55	53	–	(2)
A	112 USD	(551) ILS	20 avril 2023	(152)	(154)	–	(2)
A	359 ILS	(72) USD	20 avril 2023	98	100	2	–
A	872 ILS	(178) USD	20 avril 2023	241	243	2	–
A	150 USD	(720) ILS	20 avril 2023	(203)	(199)	4	–
A	888 USD	(99 364) INR	20 avril 2023	(1 201)	(1 211)	–	(10)
A	38 USD	(4 232) INR	20 avril 2023	(51)	(51)	–	–
A	13 557 INR	(122) USD	20 avril 2023	165	165	–	–
A	586 USD	(64 850) INR	20 avril 2023	(793)	(788)	5	–
A	11 220 INR	(101) USD	20 avril 2023	137	136	–	(1)
A	393 USD	(43 589) INR	20 avril 2023	(531)	(530)	1	–
A	64 394 INR	(579) USD	20 avril 2023	783	783	–	–
A	38 USD	(4 302) INR	20 avril 2023	(52)	(53)	–	(1)
A	136 USD	(15 313) INR	20 avril 2023	(184)	(187)	–	(3)
A	405 USD	(45 438) INR	20 avril 2023	(548)	(555)	–	(7)
A	52 USD	(5 777) INR	20 avril 2023	(70)	(71)	–	(1)
A	5 700 INR	(51) USD	20 avril 2023	69	69	–	–
A	231 USD	(25 655) INR	20 avril 2023	(312)	(312)	–	–
A	11 239 JPY	(64) USD	20 avril 2023	86	84	–	(2)
A	194 USD	(34 229) JPY	20 avril 2023	(263)	(257)	6	–
A	6 USD	(1 004) JPY	20 avril 2023	(8)	(8)	–	–
A	31 USD	(5 316) JPY	20 avril 2023	(42)	(40)	2	–
A	130 USD	(22 652) JPY	20 avril 2023	(176)	(169)	7	–
A	21 USD	(3 762) JPY	20 avril 2023	(29)	(28)	1	–

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 31 mars 2023

Tableau des contrats de change à terme de gré à gré (suite)

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	23 697 JPY	(135) USD	20 avril 2023	182	178	–	(4)
A	1 800 JPY	(10) USD	20 avril 2023	14	14	–	–
A	67 USD	(12 209) JPY	20 avril 2023	(91)	(92)	–	(1)
A	38 USD	(6 934) JPY	20 avril 2023	(51)	(53)	–	(2)
A	96 USD	(17 685) JPY	20 avril 2023	(130)	(135)	–	(5)
A	34 358 JPY	(194) USD	20 avril 2023	263	258	–	(5)
A	391 USD	(652 665) KOR	20 avril 2023	(529)	(488)	41	–
A	1 205 USD	(2 008 956) KOR	20 avril 2023	(1 630)	(1 505)	125	–
A	82 534 KOR	(50) USD	20 avril 2023	67	62	–	(5)
A	992 452 KOR	(594) USD	20 avril 2023	803	746	–	(57)
A	295 USD	(491 079) KOR	20 avril 2023	(399)	(368)	31	–
A	406 132 KOR	(244) USD	20 avril 2023	330	305	–	(25)
A	19 USD	(32 756) KOR	20 avril 2023	(26)	(25)	1	–
A	16 USD	(26 013) KOR	20 avril 2023	(21)	(20)	1	–
A	157 USD	(276 084) KOR	20 avril 2023	(213)	(211)	2	–
A	14 USD	(25 482) KOR	20 avril 2023	(19)	(19)	–	–
A	141 814 KOR	(80) USD	20 avril 2023	108	109	1	–
A	59 USD	(103 350) KOR	20 avril 2023	(80)	(79)	1	–
A	7 644 MXN	(290) USD	20 avril 2023	392	433	41	–
A	88 803 MXN	(3 364) USD	20 avril 2023	4 551	5 040	489	–
A	1 726 MXN	(65) USD	20 avril 2023	88	97	9	–
A	75 USD	(1 990) MXN	20 avril 2023	(102)	(113)	–	(11)
A	97 USD	(2 498) MXN	20 avril 2023	(131)	(140)	–	(9)
A	29 138 MXN	(1 126) USD	20 avril 2023	1 523	1 644	121	–
A	955 USD	(24 643) MXN	20 avril 2023	(1 292)	(1 386)	–	(94)
A	55 USD	(1 447) MXN	20 avril 2023	(75)	(82)	–	(7)
A	195 USD	(4 962) MXN	20 avril 2023	(264)	(278)	–	(14)
A	12 154 MXN	(483) USD	20 avril 2023	654	678	24	–
A	13 USD	(318) MXN	20 avril 2023	(17)	(18)	–	(1)
A	14 USD	(348) MXN	20 avril 2023	(19)	(19)	–	–
A	1 184 USD	(28 955) MXN	20 avril 2023	(1 601)	(1 601)	–	–
A	1 512 MXN	(61) USD	20 avril 2023	82	84	2	–
A	381 USD	(5 069) NOK	20 avril 2023	(516)	(474)	42	–
A	10 263 NOK	(772) USD	20 avril 2023	1 044	958	–	(86)
A	7 168 NOK	(540) USD	20 avril 2023	730	670	–	(60)
A	2 477 NOK	(184) USD	20 avril 2023	249	233	–	(16)
A	50 USD	(656) NOK	20 avril 2023	(67)	(61)	6	–
A	3 926 NOK	(295) USD	20 avril 2023	399	366	–	(33)
A	142 USD	(1 907) NOK	20 avril 2023	(192)	(179)	13	–
A	23 USD	(326) NOK	20 avril 2023	(31)	(31)	–	–
A	125 USD	(1 715) NOK	20 avril 2023	(169)	(162)	7	–
A	2 443 NOK	(176) USD	20 avril 2023	238	232	–	(6)
A	19 USD	(267) NOK	20 avril 2023	(26)	(26)	–	–
A	41 USD	(579) NOK	20 avril 2023	(55)	(56)	–	(1)
A	291 USD	(4 088) NOK	20 avril 2023	(394)	(390)	4	–
A	1 263 USD	(51 198) NTD	20 avril 2023	(1 708)	(1 672)	36	–
A	730 NTD	(18) USD	20 avril 2023	24	24	–	–
A	192 NTD	(4) USD	20 avril 2023	6	6	–	–
A	851 NTD	(21) USD	20 avril 2023	29	28	–	(1)
A	23 USD	(935) NTD	20 avril 2023	(31)	(30)	1	–
A	243 USD	(9 937) NTD	20 avril 2023	(329)	(326)	3	–

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 31 mars 2023

Tableau des contrats de change à terme de gré à gré (suite)

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	16 USD	(648) NTD	20 avril 2023	(21)	(21)	–	–
A	6 USD	(259) NTD	20 avril 2023	(8)	(8)	–	–
A	933 NTD	(23) USD	20 avril 2023	31	31	–	–
A	68 NZD	(31) USD	20 avril 2023	42	42	–	–
A	307 NZD	(146) USD	20 avril 2023	197	191	–	(6)
A	356 USD	(754) NZD	20 avril 2023	(482)	(467)	15	–
A	93 USD	(199) NZD	20 avril 2023	(126)	(123)	3	–
A	47 USD	(99) NZD	20 avril 2023	(64)	(61)	3	–
A	94 USD	(195) NZD	20 avril 2023	(127)	(120)	7	–
A	15 NZD	(7) USD	20 avril 2023	10	10	–	–
A	28 USD	(60) NZD	20 avril 2023	(38)	(38)	–	–
A	287 NZD	(135) USD	20 avril 2023	182	179	–	(3)
A	52 USD	(114) NZD	20 avril 2023	(71)	(72)	–	(1)
A	5 USD	(12) NZD	20 avril 2023	(7)	(7)	–	–
A	25 USD	(56) NZD	20 avril 2023	(34)	(35)	–	(1)
A	515 NZD	(238) USD	20 avril 2023	322	323	1	–
A	387 USD	(28 707) PHP	20 avril 2023	(523)	(530)	–	(7)
A	549 USD	(40 702) PHP	20 avril 2023	(742)	(752)	–	(10)
A	4 905 PHP	(66) USD	20 avril 2023	89	91	2	–
A	3 350 PHP	(46) USD	20 avril 2023	62	62	–	–
A	288 USD	(21 374) PHP	20 avril 2023	(390)	(396)	–	(6)
A	27 USD	(1 947) PHP	20 avril 2023	(36)	(36)	–	–
A	5 512 PHP	(74) USD	20 avril 2023	100	102	2	–
A	3 500 PHP	(47) USD	20 avril 2023	64	65	1	–
A	76 USD	(5 687) PHP	20 avril 2023	(103)	(105)	–	(2)
A	18 USD	(1 408) PHP	20 avril 2023	(25)	(26)	–	(1)
A	3 022 PHP	(41) USD	20 avril 2023	55	56	1	–
A	95 USD	(6 977) PHP	20 avril 2023	(128)	(128)	–	–
A	1 718 PLN	(288) USD	20 avril 2023	390	400	10	–
A	712 PLN	(120) USD	20 avril 2023	162	166	4	–
A	1 763 PLN	(296) USD	20 avril 2023	400	410	10	–
A	55 USD	(325) PLN	20 avril 2023	(74)	(76)	–	(2)
A	25 USD	(150) PLN	20 avril 2023	(34)	(35)	–	(1)
A	1 281 PLN	(217) USD	20 avril 2023	294	298	4	–
A	47 USD	(276) PLN	20 avril 2023	(63)	(64)	–	(1)
A	14 USD	(83) PLN	20 avril 2023	(19)	(20)	–	(1)
A	992 PLN	(164) USD	20 avril 2023	222	233	11	–
A	136 PLN	(22) USD	20 avril 2023	30	31	1	–
A	763 PLN	(127) USD	20 avril 2023	172	179	7	–
A	181 PLN	(31) USD	20 avril 2023	42	42	–	–
A	13 USD	(188) SEK	20 avril 2023	(18)	(19)	–	(1)
A	13 020 SEK	(931) USD	20 avril 2023	1 260	1 254	–	(6)
A	716 USD	(10 004) SEK	20 avril 2023	(969)	(964)	5	–
A	7 USD	(102) SEK	20 avril 2023	(10)	(10)	–	–
A	585 SEK	(42) USD	20 avril 2023	57	56	–	(1)
A	1 364 SEK	(99) USD	20 avril 2023	134	131	–	(3)
A	95 SEK	(7) USD	20 avril 2023	9	9	–	–
A	234 SEK	(16) USD	20 avril 2023	22	23	1	–
A	323 SEK	(23) USD	20 avril 2023	31	31	–	–
A	2 019 SEK	(143) USD	20 avril 2023	194	195	1	–
A	1 084 SEK	(77) USD	20 avril 2023	104	104	–	–

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 31 mars 2023

Tableau des contrats de change à terme de gré à gré (suite)

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	1 590 SEK	(110) USD	20 avril 2023	149	155	6	–
A	64 USD	(896) SEK	20 avril 2023	(87)	(87)	–	–
A	319 USD	(14 247) THB	20 avril 2023	(431)	(413)	18	–
A	672 USD	(30 047) THB	20 avril 2023	(909)	(871)	38	–
A	462 THB	(10) USD	20 avril 2023	14	13	–	(1)
A	21 USD	(932) THB	20 avril 2023	(29)	(27)	2	–
A	286 USD	(12 574) THB	20 avril 2023	(387)	(362)	25	–
A	4 734 THB	(107) USD	20 avril 2023	145	137	–	(8)
A	1 121 THB	(25) USD	20 avril 2023	34	33	–	(1)
A	6 357 THB	(140) USD	20 avril 2023	189	185	–	(4)
A	77 USD	(3 584) THB	20 avril 2023	(104)	(106)	–	(2)
A	18 USD	(892) THB	20 avril 2023	(25)	(26)	–	(1)
A	1 790 THB	(38) USD	20 avril 2023	51	52	1	–
A	3 898 THB	(84) USD	20 avril 2023	114	114	–	–
A	11 389 ZAR	(494) USD	20 avril 2023	668	629	–	(39)
A	3 486 ZAR	(151) USD	20 avril 2023	204	192	–	(12)
A	35 USD	(813) ZAR	20 avril 2023	(47)	(45)	2	–
A	132 ZAR	(6) USD	20 avril 2023	8	8	–	–
A	4 196 ZAR	(179) USD	20 avril 2023	242	233	–	(9)
A	48 USD	(1 135) ZAR	20 avril 2023	(65)	(64)	1	–
A	10 USD	(240) ZAR	20 avril 2023	(14)	(14)	–	–
A	3 USD	(68) ZAR	20 avril 2023	(4)	(4)	–	–
A	2 780 ZAR	(112) USD	20 avril 2023	152	158	6	–
A	265 ZAR	(10) USD	20 avril 2023	14	15	1	–
A	2 082 ZAR	(83) USD	20 avril 2023	112	118	6	–
A	1 482 ZAR	(60) USD	20 avril 2023	81	83	2	–
A	338 CAD	(253) USD	21 avril 2023	(338)	(342)	–	(4)
A	12 393 CAD	(9 275) USD	21 avril 2023	(12 393)	(12 537)	–	(144)
A	120 CAD	(82) EUR	28 avril 2023	(120)	(121)	–	(1)
A	5 EUR	(7) CAD	28 avril 2023	7	7	–	–
A	109 AUD	(54) USD	2 mai 2023	73	73	–	–
A	206 CAD	(112) USD	2 mai 2023	(152)	(152)	–	–
A	238 USD	(293) CHF	2 mai 2023	(322)	(322)	–	–
A	29 USD	(36) EUR	2 mai 2023	(39)	(39)	–	–
A	98 GBP	(89) USD	2 mai 2023	121	121	–	–
A	115 USD	(20 700) JPY	2 mai 2023	(156)	(157)	–	(1)
A	410 NOK	(29) USD	2 mai 2023	39	39	–	–
A	195 NZD	(90) USD	2 mai 2023	122	122	–	–
A	110 USD	(1 540) SEK	2 mai 2023	(149)	(149)	–	–
A	1 USD	(10) BRL	12 mai 2023	(2)	(2)	–	–
A	1 USD	(10 000) COP	12 mai 2023	(2)	(2)	–	–
A	2 USD	(1 000) HUF	12 mai 2023	(3)	(3)	–	–
A	7 USD	(150 000) IDR	12 mai 2023	(10)	(10)	–	–
A	1 100 INR	(10) USD	12 mai 2023	13	13	–	–
A	4 USD	(7 000) KOR	12 mai 2023	(6)	(6)	–	–
A	15 USD	(590) NTD	12 mai 2023	(20)	(19)	1	–
A	4 USD	(20) PEN	12 mai 2023	(5)	(5)	–	–
A	13 USD	(22) SGD	12 mai 2023	(17)	(17)	–	–
A	90 ZAR	(4) USD	12 mai 2023	5	5	–	–
AA	140 USD	(187) CAD	19 mai 2023	187	189	2	–
A	138 CAD	(96) EUR	19 mai 2023	(138)	(141)	–	(3)

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 31 mars 2023

Tableau des contrats de change à terme de gré à gré (suite)

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)		Devise à remettre (en milliers de \$)		Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
AA	140	USD	(192)	CAD	19 mai 2023	192	189	–	(3)
AA	358	CAD	(260)	USD	26 mai 2023	(358)	(351)	7	–
A	298	CAD	(324)	AUD	26 mai 2023	(298)	(293)	5	–
A	179	CAD	(122)	CHF	26 mai 2023	(179)	(182)	–	(3)
A	377	CAD	(260)	EUR	26 mai 2023	(377)	(382)	–	(5)
A	148	CAD	(90)	GBP	26 mai 2023	(148)	(150)	–	(2)
A	513	CAD	(50 788)	JPY	26 mai 2023	(513)	(521)	–	(8)
A	153	CAD	(1 167)	SEK	26 mai 2023	(153)	(152)	1	–
A	1 801	CAD	(979)	USD	26 mai 2023	(1 334)	(1 321)	13	–
A	110	USD	(148)	CAD	2 juin 2023	148	149	1	–
AA	129	CAD	(90)	EUR	2 juin 2023	(129)	(132)	–	(3)
A	95	CAD	(70)	USD	9 juin 2023	(95)	(94)	1	–
A	40	USD	(55)	CAD	9 juin 2023	55	54	–	(1)
A	387	CAD	(285)	USD	9 juin 2023	(387)	(385)	2	–
A	1 291	CAD	(950)	USD	9 juin 2023	(1 291)	(1 283)	8	–
AA	96	CAD	(70)	USD	23 juin 2023	(96)	(95)	1	–
AA	27	CAD	(20)	USD	23 juin 2023	(27)	(27)	–	–
Total des contrats de change à terme de gré à gré								1 906	(1 073)
Total des actifs dérivés									2 238
Total des passifs dérivés									(1 734)

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

NOTES ANNEXES

1. Périodes comptables et renseignements généraux

L'information fournie dans les présents états financiers et dans les notes annexes se rapporte aux périodes closes les 31 mars 2023 et 2022, ou est présentée à ces dates, selon le cas. Pour l'exercice au cours duquel un fonds ou une série est établi(e) ou rétabli(e), l'information fournie se rapporte à la période commençant à la date d'établissement ou de rétablissement. Lorsqu'une série d'un fonds a été dissoute au cours de l'une ou l'autre des périodes, l'information concernant la série est fournie jusqu'à la fermeture des bureaux à la date de dissolution. Se reporter à la note 10 pour la date de constitution du Fonds et la date d'établissement de chacune des séries.

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

Corporation Financière Mackenzie (« Mackenzie ») est le gestionnaire du Fonds et appartient à cent pour cent à Société financière IGM Inc., filiale de Power Corporation du Canada. Gestion de placements Canada Vie limitée (« GPCV ») appartient à cent pour cent à La Compagnie d'Assurance du Canada sur la Vie (« Canada Vie »), filiale de Power Corporation du Canada. Les placements du Fonds dans des sociétés du groupe de sociétés Power sont identifiés dans le tableau des placements.

2. Base d'établissement et mode de présentation

Les présents états financiers annuels audités (les « états financiers ») ont été établis conformément aux Normes internationales d'information financière (les « IFRS ») telles qu'elles ont été publiées par l'International Accounting Standards Board (l'« IASB »). La note 3 présente un résumé des principales méthodes comptables du Fonds en vertu des IFRS.

Sauf indication contraire, tous les montants présentés dans ces états financiers sont en dollars canadiens, soit la monnaie fonctionnelle et la monnaie de présentation du Fonds, et sont arrondis au millier près. Les états financiers ont été établis sur la base de la continuité d'exploitation au moyen de la méthode du coût historique, sauf dans le cas des instruments financiers qui ont été évalués à la juste valeur.

Les présents états financiers ont été approuvés aux fins de publication par le conseil d'administration de Corporation Financière Mackenzie le 5 juin 2023.

3. Principales méthodes comptables

a) Instruments financiers

Les instruments financiers comprennent des actifs financiers et des passifs financiers tels que des titres de créance, des titres de capitaux propres, des fonds de placement à capital variable et des dérivés. Le Fonds classe et évalue ses instruments financiers conformément à l'IFRS 9, *Instruments financiers* (« IFRS 9 »). Au moment de la comptabilisation initiale, les instruments financiers sont classés comme étant à la juste valeur par le biais du résultat net (la « JVRN »). Tous les instruments financiers sont comptabilisés dans l'état de la situation financière lorsque le Fonds devient partie aux exigences contractuelles de l'instrument. Les actifs financiers sont décomptabilisés lorsque le droit de percevoir les flux de trésorerie liés aux instruments est échu ou que le Fonds a transféré la quasi-totalité des risques et avantages inhérents à la propriété de ceux-ci. Les passifs financiers sont décomptabilisés lorsque l'obligation est acquittée, est annulée ou expire. Les opérations d'achat et de vente de placements sont comptabilisées à la date de l'opération.

Les instruments financiers sont par la suite évalués à la juste valeur par le biais du résultat net, et les variations de la juste valeur sont comptabilisées à l'état du résultat global au poste Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets – Profit (perte) net(te) latent(e).

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

Les profits et les pertes réalisé(e)s et latent(e)s sur les placements sont calculé(e)s en fonction du coût moyen pondéré des placements, mais excluent les commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille, qui sont présentés de manière distincte dans l'état du résultat global au poste Commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille.

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

Le Fonds comptabilise ses placements dans des fonds de placement à capital variable non cotés, des fonds privés et des fonds négociés en bourse, le cas échéant, à la juste valeur par le biais du résultat net. Pour les fonds privés, Mackenzie aura recours aux évaluations fournies par les gestionnaires des fonds privés, ce qui représente la quote-part du Fonds de l'actif net de ces fonds privés.

Les titres rachetables du Fonds confèrent aux porteurs le droit de faire racheter leur participation dans le Fonds contre un montant de trésorerie égal à leur part proportionnelle de la valeur liquidative du Fonds, entre autres droits contractuels. Les titres rachetables du Fonds satisfont aux critères de classement à titre de passifs financiers conformément à l'IAS 32, *Instruments financiers : Présentation*. L'obligation du Fonds à l'égard de l'actif net attribuable aux porteurs de titres est présentée au prix de rachat.

L'IAS 7, *Tableau des flux de trésorerie*, exige la présentation d'information relative aux changements dans les passifs et les actifs, comme les titres du Fonds, découlant d'activités de financement. Les changements relatifs aux titres du Fonds, y compris les changements découlant des flux de trésorerie et les changements sans effet de trésorerie, sont inclus à l'état de l'évolution de la situation financière. Tout changement relatif aux titres non réglé en espèces à la fin de la période est présenté à titre de Sommes à recevoir pour titres émis ou de Sommes à payer pour titres rachetés à l'état de la situation financière. Ces sommes à recevoir et à payer sont normalement réglées peu après la fin de la période.

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.

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

NOTES ANNEXES

3. Principales méthodes comptables (suite)

b) Évaluation de la juste valeur (suite)

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

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

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

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

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

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

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

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

Se reporter au tableau des instruments dérivés et au tableau des options achetées/vendues, le cas échéant, compris dans le tableau des placements pour la liste des instruments dérivés et des options au 31 mars 2023.

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

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

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

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

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

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

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

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

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

NOTES ANNEXES

3. Principales méthodes comptables (suite)

c) Comptabilisation des revenus et des charges

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

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

d) Commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille

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

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

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

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

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

f) Compensation

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

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

g) Devise

Le dollar canadien est la monnaie fonctionnelle et la monnaie de présentation du Fonds. Les achats et les ventes de placements en devises ainsi que les dividendes, le revenu d'intérêts et les charges d'intérêts en devises sont convertis en dollars canadiens au taux de change en vigueur au moment de l'opération.

Les profits (pertes) de change à l'achat ou à la vente de devises sont comptabilisé(e)s dans l'état du résultat global au poste Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets – Profit (perte) net(te) réalisé(e).

La juste valeur des placements ainsi que des autres actifs et passifs libellés en devises est convertie en dollars canadiens au taux de change en vigueur chaque jour ouvrable.

h) Actif net attribuable aux porteurs de titres, par titre

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

i) Valeur liquidative par titre

La valeur liquidative quotidienne d'un fonds de placement peut être calculée sans tenir compte des IFRS conformément aux règlements des Autorités canadiennes en valeurs mobilières (les « ACVM »). La différence entre la valeur liquidative et l'actif net attribuable aux porteurs de titres (tel qu'il est présenté dans les états financiers), le cas échéant, tient principalement aux différences liées à la juste valeur des placements et des autres actifs financiers et passifs financiers, et est présentée à la note 10.

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

NOTES ANNEXES

3. Principales méthodes comptables (suite)

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

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

l) Frais de vente à découvert et d'emprunt

Le Fonds peut effectuer des ventes à découvert d'actions et d'obligations dans le cadre de sa stratégie de placement globale. Lorsque le 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 profit 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 dénoue sa position vendeur, en rachetant le titre à un cours inférieur et en le remettant au courtier. Une perte surviendra si le cours du titre augmente. Les restrictions prévues par la stratégie de placement du Fonds en matière de ventes à découvert et d'emprunt 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 20 % de l'actif net total du Fonds; iii) le Fonds peut emprunter des liquidités correspondant à un maximum de 50 % de sa valeur liquidative; et iv) 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 profits et les pertes réalisé(e)s sur la vente à découvert d'actions et d'obligations sont comptabilisé(e)s à l'état du résultat global au poste Profit (perte) net(te) réalisé(e).

m) Modifications comptables futures

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

4. Estimations et jugements comptables critiques

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

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

Utilisation d'estimations

Juste valeur des titres non cotés sur un marché actif

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

Utilisation de jugements

Classement et évaluation des placements

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

Monnaie fonctionnelle

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

Intérêts dans des entités structurées non consolidées

Afin de déterminer si un fonds de placement à capital variable non coté ou un fonds négocié en bourse dans lequel le Fonds investit (« Fonds sous-jacents »), mais qu'il ne consolide pas, respecte la définition d'une entité structurée, Mackenzie doit exercer des jugements importants visant à établir si ces fonds sous-jacents possèdent les caractéristiques typiques d'une entité structurée. Ces Fonds sous-jacents respectent la définition d'une entité structurée, car :

I. les droits de vote dans les Fonds sous-jacents ne sont pas des facteurs dominants pour décider qui les contrôle;

II. les activités des Fonds sous-jacents sont assujétiées à des restrictions aux termes de leurs documents de placement;

III. les Fonds sous-jacents ont un objectif de placement précis et bien défini visant à offrir des occasions de placement aux investisseurs tout en leur transmettant les risques et avantages connexes.

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

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

NOTES ANNEXES

5. Impôts sur le résultat

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

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

6. Frais de gestion et frais d'exploitation

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

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

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

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

7. Capital du Fonds

Le capital du Fonds, qui comprend l'actif net attribuable aux porteurs de titres, est réparti entre les différentes séries, lesquelles comportent chacune un nombre illimité de titres. Les titres en circulation du Fonds aux 31 mars 2023 et 2022 ainsi que les titres qui ont été émis, réinvestis et rachetés au cours de ces périodes sont présentés dans l'état de l'évolution de la situation financière. Mackenzie gère le capital du Fonds conformément aux objectifs de placement décrits à la note 10.

8. Risques découlant des instruments financiers

i. Exposition au risque et gestion du risque

Les activités de placement du Fonds l'exposent à divers risques financiers, tels qu'ils sont définis dans l'IFRS 7, *Instruments financiers : Informations à fournir* (« IFRS 7 »). L'exposition du Fonds aux risques financiers est concentrée dans ses placements, lesquels sont présentés dans le tableau des placements au 31 mars 2023, regroupés par type d'actif, région géographique et secteur.

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

ii. Risque de liquidité

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

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

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

NOTES ANNEXES

8. Risques découlant des instruments financiers (suite)

iii. Risque de change

Le risque de change est le risque que les instruments financiers libellés ou échangés dans une monnaie autre que le dollar canadien, qui est la monnaie fonctionnelle du Fonds, fluctuent en raison de variations des taux de change. En règle générale, la valeur des placements libellés dans une devise augmente lorsque la valeur du dollar canadien baisse (par rapport aux devises). À l'inverse, lorsque la valeur du dollar canadien augmente par rapport aux devises, la valeur des placements libellés dans une devise baisse.

La note 10 indique les devises, le cas échéant, auxquelles le Fonds avait une exposition importante, tant pour les instruments financiers monétaires que non monétaires, et illustre l'incidence potentielle, en dollars canadiens, sur l'actif net du Fonds d'une hausse ou d'une baisse de 5 % du dollar canadien relativement à toutes les devises, toute autre variable demeurant constante. En pratique, les résultats réels de négociation peuvent différer et l'écart pourrait être important.

La sensibilité du Fonds au risque de change présentée à la note 10 comprend l'incidence indirecte potentielle des fonds sous-jacents et des fonds négociés en bourse (« FNB ») dans lesquels investit le Fonds, et/ou des contrats d'instruments dérivés, y compris les contrats de change à terme de gré à gré. Les autres actifs financiers et passifs financiers (y compris les dividendes et les intérêts à recevoir, ainsi que les sommes à recevoir ou à payer pour les placements vendus ou achetés) libellés en devises n'exposent pas le Fonds à un risque de change important.

iv. Risque de taux d'intérêt

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

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

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

v. Autre risque de prix

L'autre risque de prix est le risque que la valeur des instruments financiers fluctue en fonction des variations des cours du marché (autres que celles découlant du risque de taux d'intérêt ou du risque de change), que ces variations découlent de facteurs propres à un placement individuel ou à son émetteur, ou d'autres facteurs ayant une incidence sur tous les instruments négociés sur un marché ou un segment du marché. Tous les placements présentent un risque de perte en capital. Ce risque est géré grâce à une sélection minutieuse de placements et d'autres instruments financiers conformes aux stratégies de placement. À l'exception de certains contrats dérivés 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 de gré à gré, des swaps ou des contrats à terme standardisés équivaut à leurs montants notionnels. Dans le cas d'options d'achat (de vente) et de positions vendeur sur contrats à terme standardisés, la perte pour le Fonds continue d'augmenter, théoriquement sans limite, au fur et à mesure que la juste valeur de l'élément sous-jacent augmente (diminue). Toutefois, ces instruments sont généralement utilisés dans le cadre du processus global de gestion des placements afin de gérer le risque provenant des placements sous-jacents et n'augmentent généralement pas le risque de perte global du Fonds. Pour atténuer ce risque, le Fonds s'assure de détenir à la fois l'élément sous-jacent, la couverture en espèces ou la marge, dont la valeur équivaut à celle du contrat dérivé ou lui est supérieure. Dans le cas de titres vendus à découvert, la perte pour le Fonds continue d'augmenter, sans limite, 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 3 I).

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

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

vi. Risque de crédit

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

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

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

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

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

NOTES ANNEXES

8. Risques découlant des instruments financiers (suite)

vii. Fonds sous-jacents

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

9. Autres renseignements

Abréviations

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

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

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

NOTES ANNEXES

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

a) Constitution du Fonds et renseignements sur les séries

Date de constitution : 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 les états de l'évolution de la situation financière.

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

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

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

Les titres de série 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, à certains investisseurs d'un régime collectif admissible 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 gérés par Mackenzie et non visés par un prospectus relativement à des ententes de fonds de fonds.

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

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
Série A	23 mai 2018	2,10 %	0,28 %
Série CL	11 janvier 2021	s.o.	s.o.
Série F	23 mai 2018	1,00 %	0,15 %
Série FB	23 mai 2018	1,10 %	0,28 %
Série O	23 mai 2018	— ¹⁾	s.o.
Série PW	23 mai 2018	2,00 %	0,15 %
Série PWFB	23 mai 2018	1,00 %	0,15 %
Série PWX	23 mai 2018	— ²⁾	— ²⁾
Série R	23 mai 2018	s.o.	s.o.
Série S	4 novembre 2020	— ¹⁾	0,03 %

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 ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

NOTES ANNEXES

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

b) Reports prospectifs de pertes

Total de la perte en capital \$	Total de la perte autre qu'en capital \$	Date d'échéance des pertes autres qu'en capital														
		2029 \$	2030 \$	2031 \$	2032 \$	2033 \$	2034 \$	2035 \$	2036 \$	2037 \$	2038 \$	2039 \$	2040 \$	2041 \$	2042 \$	
11 091	9 723	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	3 112	2 280	4 331

c) Prêt de titres

Aux 31 mars 2023 et 2022, aucune opération de prêt, de mise en pension ou de prise en pension de titres n'était en cours.

d) Commissions

	(\$)
31 mars 2023	34
31 mars 2022	30

e) 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 alternative de crédit, une stratégie macroéconomique 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 dans des devises et/ou des marchandises. Le Fonds peut également effectuer des ventes à découvert et/ou des emprunts aux fins de placement.

L'exposition globale du Fonds à ses sources de levier correspond à la somme des sources de levier suivantes et ne doit pas dépasser 300 % de sa valeur liquidative :

i) la valeur de marché globale des titres vendus à découvert; ii) l'encours total des emprunts aux termes des conventions d'emprunt aux fins de placement; et iii) la valeur notionnelle globale des positions sur dérivés visés du Fonds, à l'exception des dérivés visés utilisés aux fins de couverture.

L'effet cumulatif du recours au levier financier dans un marché qui évolue au détriment d'un placement avec effet de levier pourrait se solder par une perte importante plus lourde qu'en l'absence de recours au levier financier. Par conséquent, toute incidence défavorable découlant d'un événement sur la valeur d'un placement du Fonds sera amplifiée dans la mesure selon laquelle est employé le levier financier.

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

NOTES ANNEXES

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

e) Risques découlant des instruments financiers (suite)

ii. Risque de change

Les tableaux ci-après résument l'exposition du Fonds au risque de change.

Devise	31 mars 2023				Incidence sur l'actif net			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Renforcement de 5 %		Affaiblissement de 5 %	
					(\$)	%	(\$)	%
USD	18 619	4 001	(17 671)	4 949				
MXN	–	(2)	4 371	4 369				
BRL	141	38	3 022	3 201				
EUR	835	634	951	2 420				
HKD	2 071	11	–	2 082				
COP	–	–	1 964	1 964				
PLN	–	–	1 616	1 616				
ZAR	60	(24)	1 363	1 399				
IDR	–	–	1 201	1 201				
NOK	(147)	90	1 148	1 091				
CNY	2 298	45	(1 384)	959				
SEK	(140)	209	607	676				
CLP	–	–	540	540				
AUD	19	200	202	421				
DKK	65	1	–	66				
SGD	(30)	81	(17)	34				
HUF	–	–	(3)	(3)				
PEN	–	–	(5)	(5)				
NZD	(26)	(7)	(69)	(102)				
CHF	(124)	157	(519)	(486)				
CZK	–	–	(606)	(606)				
JPY	(160)	661	(1 144)	(643)				
ILS	79	1	(795)	(715)				
GBP	(130)	184	(1 027)	(973)				
THB	–	–	(1 315)	(1 315)				
KOR	101	–	(1 518)	(1 417)				
PHP	–	–	(1 649)	(1 649)				
NTD	78	8	(1 987)	(1 901)				
INR	–	–	(2 578)	(2 578)				
Total	23 609	6 288	(15 302)	14 595				
% de l'actif net	24,7	6,6	(16,0)	15,3				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					(1 083)	(1,1)	1 083	1,1

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

NOTES ANNEXES

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

e) Risques découlant des instruments financiers (suite)

ii. Risque de change (suite)

Devise	31 mars 2022				Incidence sur l'actif net			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Renforcement de 5 %		Affaiblissement de 5 %	
					(\$)	%	(\$)	%
USD	18 825	9 804	(13 389)	15 240				
NOK	883	5	2 904	3 792				
EUR	258	501	2 404	3 163				
GBP	(104)	13	2 900	2 809				
BRL	–	–	2 377	2 377				
ZAR	54	–	2 141	2 195				
CNY	2 304	(124)	–	2 180				
PLN	–	–	2 086	2 086				
HKD	1 895	31	–	1 926				
INR	–	–	1 862	1 862				
SEK	71	134	1 491	1 696				
IDR	–	–	983	983				
MXN	–	–	204	204				
NTD	100	2	–	102				
THB	–	–	26	26				
COP	–	–	(6)	(6)				
PEN	–	–	(6)	(6)				
RUB	–	–	(9)	(9)				
DKK	(7)	(3)	–	(10)				
SGD	(92)	42	16	(34)				
CHF	(232)	275	(441)	(398)				
JPY	(154)	671	(2 196)	(1 679)				
AUD	71	608	(2 863)	(2 184)				
KOR	112	–	(3 617)	(3 505)				
ILS	–	83	(4 203)	(4 120)				
NZD	(51)	–	(5 979)	(6 030)				
Total	23 933	12 042	(13 315)	22 660				
% de l'actif net	22,1	11,1	(12,3)	20,9				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					(1 471)	(1,4)	1 471	1,4

* Comprend les instruments financiers monétaires et non monétaires.

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

NOTES ANNEXES

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

e) Risques découlant des instruments financiers (suite)

iii. Risque de taux d'intérêt

Les tableaux ci-après résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt découlant de ses placements dans des obligations selon la durée jusqu'à l'échéance et des dérivés.

31 mars 2023 (\$)				
Durée jusqu'à l'échéance	Obligations		Instruments dérivés	
	Positions acheteur	Positions vendeur	Positions acheteur	Positions vendeur
Moins de 1 an	878	–	6 098	(18 571)
1 an à 5 ans	8 434	(616)	–	–
5 ans à 10 ans	10 937	(429)	–	–
Plus de 10 ans	4 418	–	–	–
Total	24 667	(1 045)	6 098	(18 571)

31 mars 2022 (\$)				
Durée jusqu'à l'échéance	Obligations		Instruments dérivés	
	Positions acheteur	Positions vendeur	Positions acheteur	Positions vendeur
Moins de 1 an	379	–	72 699	(11 575)
1 an à 5 ans	5 047	(502)	–	–
5 ans à 10 ans	10 225	(1 091)	–	–
Plus de 10 ans	3 573	–	–	–
Total	19 224	(1 593)	72 699	(11 575)

Au 31 mars 2023, si les taux d'intérêt en vigueur avaient connu une hausse de 1 %, la courbe des taux évoluant en parallèle et toute autre variable demeurant constante, l'actif net aurait augmenté d'environ 83 \$ ou 0,1 % du total de l'actif net (diminution d'environ 4 774 \$ ou 4,4 % en 2022). De même, si les taux d'intérêt en vigueur avaient connu une baisse de 1 %, toute autre variable demeurant constante, l'actif net aurait augmenté d'environ 16 \$ ou 0,0 % du total de l'actif net (augmentation d'environ 4 839 \$ ou 4,5 % en 2022). En pratique, les résultats réels de négociation peuvent différer et l'écart pourrait être important.

iv. Autre risque de prix

Le tableau ci-après résume l'exposition du Fonds à l'autre risque de prix.

Incidence sur l'actif net	Augmentation de 10 %		Diminution de 10 %	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
31 mars 2023	1 440	1,5	(1 208)	(1,3)
31 mars 2022	2 758	2,6	(2 570)	(2,4)

v. Risque de crédit

Pour ce Fonds, la plus forte concentration du risque de crédit se trouve dans les titres de créance, tels que les obligations. La juste valeur des titres de créance tient compte de la solvabilité de l'émetteur de ces titres. L'exposition maximale à tout émetteur de titres de créance au 31 mars 2023 était de 1,7 % de l'actif net du Fonds (0,5 % en 2022).

Aux 31 mars 2023 et 2022, les titres de créance par note de crédit étaient les suivants :

Note des obligations*	31 mars 2023	31 mars 2022
	% de l'actif net	% de l'actif net
AA	1,9	–
A	1,2	0,1
BBB	2,4	1,8
Inférieure à BBB	17,0	12,8
Sans note	2,2	1,6
Total	24,7	16,3

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

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

NOTES ANNEXES

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

f) Classement de la juste valeur

Le tableau ci-après résume la juste valeur des instruments financiers du Fonds selon la hiérarchie de la juste valeur décrite à la note 3.

	31 mars 2023				31 mars 2022			
	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations – Positions acheteur	–	24 667	–	24 667	140	19 084	–	19 224
Obligations – Positions vendeur	–	(1 045)	–	(1 045)	–	(1 593)	–	(1 593)
Actions – Positions acheteur	28 787	9 172	18	37 977	44 951	9 858	16	54 825
Actions – Positions vendeur	(23 208)	(4 631)	(12)	(27 851)	(33 949)	(5 740)	–	(39 689)
Options	–	505	–	505	–	752	–	752
Fonds/billets négociés en bourse – Positions acheteur	1 092	–	–	1 092	5 525	–	–	5 525
Fonds/billets négociés en bourse – Positions vendeur	(185)	–	–	(185)	(195)	–	–	(195)
Fonds communs de placement	7 125	–	–	7 125	7 083	–	–	7 083
Fonds privés	–	–	185	185	–	–	38	38
Actifs dérivés	329	1 909	–	2 238	1 122	1 985	–	3 107
Passifs dérivés	(645)	(1 162)	–	(1 807)	(2 072)	(2 185)	–	(4 257)
Placements à court terme	15 490	9 061	–	24 551	15 490	7 830	–	23 320
Total	28 785	38 476	191	67 452	38 095	29 991	54	68 140

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

Au cours de la période close le 31 mars 2023, les actions autres que nord-américaines étaient fréquemment transférées entre le niveau 1 (prix non rajustés cotés) et le niveau 2 (prix rajustés). Au 31 mars 2023, ces titres étaient classés dans le niveau 2 (niveau 2 en 2022).

Au cours de la période close le 31 mars 2023, des obligations d'une juste valeur de 133 \$ (néant en 2022) ont été transférées du niveau 1 au niveau 2 en raison de changements en matière de données utilisées pour l'évaluation.

Le tableau ci-après présente un rapprochement des instruments financiers évalués à la juste valeur à l'aide de données non observables (niveau 3) pour les périodes closes les 31 mars 2023 et 2022 :

	31 mars 2023			31 mars 2022		
	Actions (\$)	Fonds privés (\$)	Total (\$)	Actions (\$)	Fonds privés (\$)	Total (\$)
Solde, à l'ouverture	16	38	54	17	–	17
Achats	8	146	154	–	39	39
Ventes	(10)	–	(10)	–	–	–
Transferts entrants	(14)	–	(14)	–	–	–
Transferts sortants	–	–	–	–	–	–
Profits (pertes) au cours de la période :						
Réalisé(e)s	–	–	–	–	–	–
Latent(e)s	6	1	7	(1)	(1)	(1)
Solde, à la clôture	6	185	191	16	38	54
Variation des profits (pertes) latent(e)s au cours de la période attribuables aux titres détenus à la clôture de la période	4	1	5	(1)	(1)	(1)

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

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

NOTES ANNEXES

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

g) Placements détenus par le gestionnaire et des sociétés affiliées

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

	31 mars 2023	31 mars 2022
	(\$)	(\$)
Gestionnaire	–	–
Autres fonds gérés par le gestionnaire	69 116	84 593
Fonds gérés par des sociétés affiliées au gestionnaire	17 512	15 817

h) Compensation d'actifs et de passifs financiers

Les tableaux ci-après présentent les actifs et passifs financiers qui font l'objet d'une convention-cadre de compensation ou d'autres conventions semblables et l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds si la totalité des droits à compensation était exercée dans le cadre d'événements futurs comme une faillite ou la résiliation de contrats. Aucun montant n'a été compensé dans les états financiers.

	31 mars 2023			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	796	(610)	–	186
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(942)	610	2 111	1 779
Obligation pour options vendues	(73)	–	–	(73)
Total	(219)	–	2 111	1 892

	31 mars 2022			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	1 150	(1 133)	–	17
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(2 083)	1 133	4 050	3 100
Obligation pour options vendues	(562)	–	–	(562)
Total	(1 495)	–	4 050	2 555

i) Intérêts dans une entité structurée non consolidée

Les détails des placements du Fonds dans des fonds sous-jacents aux 31 mars 2023 et 2022 sont les suivants :

31 mars 2023	% de l'actif net du Fonds sous-jacent	Juste valeur des placements du Fonds (\$)
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF	0,0	(19)
iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF	0,0	108
Fonds toutes actions Chine Mackenzie ChinaAMC, série R	4,7	7 125
Sagard Credit Partners II LP	0,1	185
SPDR Bloomberg Barclays Convertible Securities ETF	0,0	(166)
SPDR S&P Oil & Gas Exploration & Production ETF	0,0	984

FONDS MULTISTRATÉGIE À RENDEMENT ABSOLU MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2023

NOTES ANNEXES

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

i) Intérêts dans une entité structurée non consolidée (suite)

31 mars 2022	% de l'actif net du Fonds sous-jacent	Juste valeur des placements du Fonds (\$)
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF	0,0	(19)
iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF	0,0	110
iShares TIPS Bond ETF	0,0	47
Fonds toutes actions Chine Mackenzie ChinaAMC, série R	3,7	7 083
FINB Obligations de marchés émergents Mackenzie (couvert en \$ CA)	0,1	684
FINB Obligations américaines à rendement élevé Mackenzie (couvert en \$ CA)	0,6	283
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	0,3	846
Sagard Credit Partners II LP	0,0	38
SPDR Bloomberg Barclays Convertible Securities ETF	0,0	(176)
SPDR S&P Oil & Gas Exploration & Production ETF	0,0	303
Vanguard Value ETF	0,0	3 252

j) Dividendes et revenu d'intérêts

Des dividendes et des intérêts versés découlant de la vente à découvert de titres de 1 058 \$ et de 80 \$ (759 \$ et 171 \$ en 2022), respectivement, sont inclus dans les dividendes et le revenu d'intérêts pour la période close le 31 mars 2023.

k) Effet de levier

L'effet de levier survient lorsqu'un Fonds emprunte de l'argent ou des titres, ou a recours à des produits dérivés, pour effectuer des placements qui n'auraient autrement pas été possibles. L'exposition globale du Fonds à ses sources de levier est calculée comme étant la somme des éléments suivants : i) la valeur marchande des titres vendeur; ii) le montant en espèces emprunté aux fins de placement; et iii) la valeur notionnelle des positions sur dérivés du Fonds, à l'exception des dérivés utilisés aux fins de couverture. Cette exposition ne peut dépasser 300 % de la valeur liquidative du Fonds.

Au cours de l'exercice clos le 31 mars 2023, l'exposition globale du Fonds aux sources de levier a varié entre 37 % et 104 % de la valeur liquidative du Fonds. Le haut de la fourchette a été atteint en avril 2022, lorsque les positions actives du Fonds ont nécessité un levier accru pour atteindre les objectifs en matière de profil risque/rendement. Le bas de la fourchette a été atteint en juillet 2022, lorsque les expositions dans l'ensemble du portefeuille étaient généralement plus basses en réaction à la volatilité élevée des marchés. Les sources de levier ont été les positions vendeur physiques sur actions et titres à revenu fixe de sociétés, et les placements dans les produits dérivés. Incluant la valeur notionnelle des dérivés utilisés aux fins de couverture, les montants de levier minimaux et maximaux ont varié entre 150 % et 229 %.

Au cours de l'exercice clos le 31 mars 2022, l'exposition globale du Fonds aux sources de levier a varié entre 101 % et 165 % de la valeur liquidative du Fonds. Le haut de la fourchette a été atteint en juillet 2021 lorsque l'exposition aux positions acheteur sur actions et titres à revenu fixe était près de son plus haut niveau de l'année et que la stratégie de titres de créance utilisait l'effet de levier pour des prêts à taux variable. Le bas de la fourchette a été atteint en mars 2022, lorsque l'équipe de gestion de portefeuille a réduit les expositions aux positions acheteur, notamment celle aux prêts à taux variable. Les sources de levier ont été les positions vendeur physiques sur actions et titres à revenu fixe de sociétés, et les placements dans les produits dérivés. Incluant la valeur notionnelle des dérivés utilisés aux fins de couverture, les montants de levier minimaux et maximaux ont varié entre 222 % et 346 %.

l) Engagement

	31 mars 2023		31 mars 2022	
	Montant appelé (\$)	Engagement d'investissement total (\$ US)	Montant appelé (\$)	Engagement d'investissement total (\$ US)
Sagard Credit Partners II LP ¹⁾	185	400	38	400

¹⁾ Ce fonds est géré par Sagard Holdings Inc., une société affiliée à Mackenzie.

m) Placements donnés en garantie

Au 31 mars 2023, des placements dans des titres d'une juste valeur de 21 325 \$ (34 450 \$ au 31 mars 2022) ont été donnés en garantie en contrepartie de titres vendus à découvert, de contrats de swap et de contrats de change à terme de gré à gré.