

États financiers intermédiaires non audités

Pour la période de six mois close le 30 septembre 2020

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

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

AVIS DE NON-AUDIT DES ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES

Corporation Financière Mackenzie, le gestionnaire du Fonds, nomme des auditeurs indépendants pour auditer les états financiers annuels du Fonds. Conformément aux lois sur les valeurs mobilières du Canada (Norme canadienne 81-106), si un auditeur n'a pas revu les états financiers intermédiaires, cela doit être divulgué dans un avis complémentaire.

Les auditeurs indépendants du Fonds n'ont pas revu les présents États financiers intermédiaires conformément aux normes établies par l'Institut Canadien des Comptables Agréés.



FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

En milliers (sauf les montants par titre)
Au

	30 sept. 2020	31 mars 2020 (Audité)
	\$	\$
ACTIF		
Actifs courants		
Placements à la juste valeur	1 583 933	1 425 995
Trésorerie et équivalents de trésorerie	144 709	43 190
Intérêts courus à recevoir	4 480	4 368
Dividendes à recevoir	1 073	1 276
Sommes à recevoir pour placements vendus	1 379	6 888
Sommes à recevoir pour titres émis	2 883	726
Sommes à recevoir du gestionnaire	27	18
Marge sur instruments dérivés	3 585	3 257
Profits latents sur les contrats dérivés	2 806	16 480
Total de l'actif	1 744 875	1 502 198

PASSIF

Passifs courants		
Sommes à payer pour placements achetés	8 894	12 001
Sommes à payer pour titres rachetés	944	959
Sommes à payer au gestionnaire	91	77
Obligation pour options vendues	3	–
Pertes latentes sur les contrats dérivés	3 794	31 386
Total du passif	13 726	44 423
Actif net attribuable aux porteurs de titres	1 731 149	1 457 775

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

Série A	559 398	501 628
Série AR	60 927	52 115
Série B	7 015	6 798
Série D	1 544	1 156
Série F	301 764	247 770
Série F8	4 450	2 754
Série FB	1 782	1 550
Série G	14	12
Série I	87	78
Série OJ	138	123
Série O	21 190	18 674
Série O5	3	3
Série PW	604 808	482 480
Série PWFB	12 196	8 994
Série PWR	9 320	6 552
Série PWT5	52 888	45 832
Série PWT8	6 116	4 217
Série PWX	20 651	14 817
Série PWX8	516	478
Série S	1	1
Série T5	65 375	60 914
Série T8	966	829

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

Série A	15,15	13,86
Série AR	13,58	12,17
Série B	22,28	19,97
Série D	16,13	14,69
Série F	14,56	13,23
Série F8	14,71	13,58
Série FB	11,26	10,25
Série G	12,05	10,79
Série I	14,49	12,97
Série OJ	12,10	10,84
Série O	15,99	14,46
Série O5	15,93	14,41
Série PW	12,82	11,72
Série PWFB	10,50	9,54
Série PWR	11,06	9,90
Série PWT5	14,94	13,66
Série PWT8	13,21	12,26
Série PWX	16,96	15,34
Série PWX8	13,75	12,63
Série S	11,31	10,09
Série T5	12,78	11,70
Série T8	15,43	14,34

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

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

	2020	2019
	\$	\$
Revenus		
Dividendes	14 829	12 625
Revenu d'intérêts	8 515	12 526
Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets		
Profit (perte) net(te) réalisé(e)	17 227	(3 143)
Profit (perte) net(te) latent(e)	156 601	30 715
Revenu tiré du prêt de titres	47	133
Revenu provenant des rabais sur les frais	143	95
Total des revenus (pertes)	197 362	52 951
Charges (note 6)		
Frais de gestion	13 858	12 523
Rabais sur les frais de gestion	(8)	(9)
Frais d'administration	1 665	1 526
Intérêts débiteurs	28	21
Commissions et autres coûts de transaction liés au portefeuille	218	260
Frais du Comité d'examen indépendant	3	2
Autre	7	1
Charges avant les montants absorbés par le gestionnaire	15 771	14 324
Charges absorbées par le gestionnaire	—	—
Charges nettes	15 771	14 324
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, avant impôt	181 591	38 627
Impôt étranger retenu à la source	1 480	1 807
Impôt étranger sur le résultat payé (recouvré)	34	—
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation	180 077	36 820
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, par série		
Série A	60 113	13 133
Série AR	6 359	1 166
Série B	803	197
Série D	166	33
Série F	32 102	7 191
Série F8	366	83
Série FB	193	47
Série G	2	—
Série I	9	2
Série OJ	15	6
Série O	2 470	667
Série O5	—	—
Série PW	59 797	10 611
Série PWFB	1 185	228
Série PWR	826	70

	2020	2019
	\$	\$
Série PWT5	5 549	1 088
Série PWT8	540	89
Série PWX	2 172	527
Série PWX8	63	18
Série S	—	—
Série T5	7 242	1 656
Série T8	105	8
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, par titre		
Série A	1,65	0,35
Série AR	1,44	0,30
Série B	2,44	0,50
Série D	1,81	0,43
Série F	1,65	0,43
Série F8	1,53	0,43
Série FB	1,29	0,32
Série G	1,32	0,29
Série I	1,60	0,36
Série OJ	1,32	0,28
Série O	1,90	0,53
Série O5	1,90	0,53
Série PW	1,37	0,31
Série PWFB	1,16	0,29
Série PWR	1,14	0,19
Série PWT5	1,63	0,36
Série PWT8	1,36	0,32
Série PWX	1,92	0,57
Série PWX8	1,67	0,48
Série S	1,33	0,36
Série T5	1,40	0,30
Série T8	1,66	0,37

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE LA SITUATION FINANCIÈRE

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

	2020	2019	2020	2019	2020	2019	2020	2019	2020	2019
	Série A		Série AR		Série B		Série D		Série F	
	\$		\$		\$		\$		\$	
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	501 628	550 590	52 115	50 239	6 798	8 397	1 156	1 133	247 770	228 389
Augmentation (diminution) de l'actif net										
liée aux activités d'exploitation	60 113	13 133	6 359	1 166	803	197	166	33	32 102	7 191
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(2 139)	(3 600)	(219)	(313)	(29)	(54)	(9)	(13)	(2 182)	(3 121)
Gains en capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	(11 441)	(9 958)	-	-	-	-	(26)	(17)	(4 737)	(2 976)
Rabais sur les frais de gestion	-	-	-	-	-	-	-	-	(2)	(2)
Total des distributions aux porteurs de titres	(13 580)	(13 558)	(219)	(313)	(29)	(54)	(35)	(30)	(6 921)	(6 099)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	84 304	73 256	5 785	4 969	20	-	548	142	40 806	30 496
Produit de l'émission de titres à la fusion	-	498	-	56	-	-	-	1	-	183
Réinvestissement des distributions	12 963	12 934	219	313	26	49	33	28	4 747	4 252
Paiements au rachat de titres	(86 030)	(96 312)	(3 332)	(5 454)	(603)	(781)	(324)	(119)	(16 740)	(25 983)
Total des opérations sur les titres	11 237	(9 624)	2 672	(116)	(557)	(732)	257	52	28 813	8 948
Augmentation (diminution) totale de l'actif net	57 770	(10 049)	8 812	737	217	(589)	388	55	53 994	10 040
À la clôture	559 398	540 541	60 927	50 976	7 015	7 808	1 544	1 188	301 764	238 429
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) :										
Titres en circulation, à l'ouverture	36 187	37 771	4 283	4 095	340	417	79	74	18 721	16 609
Émis	5 640	4 998	438	401	2	-	35	9	2 844	2 198
Émis à la fusion	-	34	-	4	-	-	-	-	-	13
Réinvestissement des distributions	869	885	17	25	1	2	2	2	332	308
Rachetés	(5 762)	(6 565)	(250)	(441)	(28)	(38)	(20)	(8)	(1 176)	(1 872)
Titres en circulation, à la clôture	36 934	37 123	4 488	4 084	315	381	96	77	20 721	17 256
	Série F8		Série FB		Série G		Série I		Série OI	
	\$		\$		\$		\$		\$	
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	2 754	2 803	1 550	1 545	12	12	78	78	123	240
Augmentation (diminution) de l'actif net										
liée aux activités d'exploitation	366	83	193	47	2	-	9	2	15	6
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(24)	(38)	(12)	(19)	-	-	-	(1)	(1)	(2)
Gains en capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	(117)	(77)	(29)	(22)	-	-	-	-	-	-
Rabais sur les frais de gestion	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de titres	(141)	(115)	(41)	(41)	-	-	-	(1)	(1)	(2)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	1 581	565	530	590	-	-	-	-	-	-
Produit de l'émission de titres à la fusion	-	2	-	1	-	-	-	-	-	-
Réinvestissement des distributions	20	25	41	41	-	-	-	1	1	2
Paiements au rachat de titres	(130)	(648)	(491)	(647)	-	-	-	-	-	-
Total des opérations sur les titres	1 471	(56)	80	(15)	-	-	-	1	1	2
Augmentation (diminution) totale de l'actif net	1 696	(88)	232	(9)	2	-	9	2	15	6
À la clôture	4 450	2 715	1 782	1 536	14	12	87	80	138	246
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) :										
Titres en circulation, à l'ouverture	203	193	151	145	1	1	6	6	11	22
Émis	107	39	47	54	-	-	-	-	-	-
Émis à la fusion	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Réinvestissement des distributions	1	2	4	4	-	-	-	-	-	-
Rachetés	(9)	(45)	(44)	(60)	-	-	-	-	-	-
Titres en circulation, à la clôture	302	189	158	143	1	1	6	6	11	22

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

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

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

	2020	2019	2020	2019	2020	2019	2020	2019	2020	2019
	Série O		Série O5		Série PW		Série PWFB		Série PWR	
	\$		\$		\$		\$		\$	
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	18 674	18 746	3	3	482 480	406 414	8 994	6 379	6 552	–
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	2 470	667	–	–	59 797	10 611	1 185	228	826	70
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(220)	(339)	–	–	(2 453)	(3 402)	(80)	(103)	(34)	(33)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(283)	(167)	–	–	(11 313)	(7 409)	(183)	(103)	–	–
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	(6)	(7)	–	–	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	(503)	(506)	–	–	(13 772)	(10 818)	(263)	(206)	(34)	(33)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	1 529	572	–	–	100 593	67 235	2 730	3 166	2 531	4 379
Produit de l'émission de titres à la fusion	–	1	–	–	–	320	–	1	–	42
Réinvestissement des distributions	364	439	–	–	13 296	10 474	263	206	34	33
Paiements au rachat de titres	(1 344)	(2 068)	–	–	(37 586)	(39 137)	(713)	(851)	(589)	(54)
Total des opérations sur les titres	549	(1 056)	–	–	76 303	38 892	2 280	2 522	1 976	4 400
Augmentation (diminution) totale de l'actif net	2 516	(895)	–	–	122 328	38 685	3 202	2 544	2 768	4 437
À la clôture	21 190	17 851	3	3	604 808	445 099	12 196	8 923	9 320	4 437
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) :	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres
Titres en circulation, à l'ouverture	1 292	1 258	–	–	41 170	33 059	943	644	662	–
Émis	98	38	–	–	7 927	5 432	263	316	232	435
Émis à la fusion	–	–	–	–	–	26	–	–	–	4
Réinvestissement des distributions	23	29	–	–	1 053	849	26	21	3	3
Rachetés	(88)	(138)	–	–	(2 983)	(3 163)	(70)	(85)	(54)	(5)
Titres en circulation, à la clôture	1 325	1 187	–	–	47 167	36 203	1 162	896	843	437
	Série PWT5	Série PWT8	Série PWX	Série PWX8	Série S					
	\$	\$	\$	\$	\$					
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	45 832	41 539	4 217	3 536	14 817	14 664	478	512	1	1
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	5 549	1 088	540	89	2 172	527	63	18	–	–
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(228)	(346)	(23)	(30)	(193)	(264)	(6)	(9)	–	–
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(1 022)	(763)	(188)	(118)	(272)	(129)	(15)	(12)	–	–
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	(1 250)	(1 109)	(211)	(148)	(465)	(393)	(21)	(21)	–	–
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	4 633	5 139	1 653	776	5 142	1 659	–	–	–	–
Produit de l'émission de titres à la fusion	–	–	–	1	–	1	–	1	–	–
Réinvestissement des distributions	788	706	71	58	456	383	10	9	–	–
Paiements au rachat de titres	(2 664)	(2 527)	(154)	(134)	(1 471)	(2 473)	(14)	(7)	–	–
Total des opérations sur les titres	2 757	3 318	1 570	701	4 127	(430)	(4)	3	–	–
Augmentation (diminution) totale de l'actif net	7 056	3 297	1 899	642	5 834	(296)	38	–	–	–
À la clôture	52 888	44 836	6 116	4 178	20 651	14 368	516	512	1	1
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) :	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres
Titres en circulation, à l'ouverture	3 356	2 899	344	267	966	927	38	38	–	–
Émis	311	356	126	59	311	105	–	–	–	–
Émis à la fusion	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	54	49	5	4	27	24	1	1	–	–
Rachetés	(182)	(175)	(12)	(10)	(87)	(155)	(1)	(1)	–	–
Titres en circulation, à la clôture	3 539	3 129	463	320	1 217	901	38	38	–	–

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

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

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

	2020	2019	2020	2019	2020	2019
	Série T5		Série T8		Total	
	\$		\$		\$	
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES						
À l'ouverture	60 914	69 943	829	122	1 457 775	1 405 285
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	7 242	1 656	105	8	180 077	36 820
Distributions aux porteurs de titres :						
Revenu de placement	(255)	(450)	(4)	(2)	(8 111)	(12 139)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(1 367)	(1 252)	(36)	(10)	(31 029)	(23 013)
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	(8)	(9)
Total des distributions aux porteurs de titres	(1 622)	(1 702)	(40)	(12)	(39 148)	(35 161)
Opérations sur les titres :						
Produit de l'émission de titres	5 185	5 003	282	771	257 852	198 718
Produit de l'émission de titres à la fusion	–	–	–	29	–	1 137
Réinvestissement des distributions	1 098	1 172	6	3	34 436	31 128
Paiements au rachat de titres	(7 442)	(9 162)	(216)	(408)	(159 843)	(186 765)
Total des opérations sur les titres	(1 159)	(2 987)	72	395	132 445	44 218
Augmentation (diminution) totale de l'actif net	4 461	(3 033)	137	391	273 374	45 877
À la clôture	65 375	66 910	966	513	1 731 149	1 451 162
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) :						
Titres en circulation, à l'ouverture	5 206	5 684	58	8		
Émis	409	405	19	50		
Émis à la fusion	–	–	–	2		
Réinvestissement des distributions	87	95	–	–		
Rachetés	(588)	(740)	(14)	(26)		
Titres en circulation, à la clôture	5 114	5 444	63	34		

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

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

	2020	2019
	\$	\$
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	180 077	36 820
Ajustements pour :		
Perte (profit) net(te) réalisé(e) sur les placements	(24 116)	(9 638)
Variation de la perte (du profit) net(te) latent(e) sur les placements	(156 601)	(45 322)
Achat de placements	(450 978)	(358 336)
Produit de la vente et de l'échéance de placements	462 378	377 955
Variation des intérêts courus à recevoir	(112)	230
Variation des dividendes à recevoir	203	384
Variation des sommes à recevoir du gestionnaire	(9)	2
Variation de la marge sur instruments dérivés	(328)	4 001
Variation des sommes à payer au gestionnaire	14	–
Trésorerie nette liée aux activités d'exploitation	10 528	6 096

Flux de trésorerie liés aux activités de financement

Produit de l'émission de titres	194 202	140 986
Paievements au rachat de titres	(98 365)	(128 263)
Distributions versées, déduction faite des réinvestissements	(4 712)	(4 033)
Trésorerie nette liée aux activités de financement	91 125	8 690

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

Trésorerie et équivalents de trésorerie, à l'ouverture	43 190	30 739
Incidence des fluctuations des taux de change sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie	(134)	14 695
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture	144 709	60 220

Trésorerie	20 495	2 824
Équivalents de trésorerie	124 214	57 396
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture	144 709	60 220

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

Dividendes reçus	15 032	13 009
Impôts étrangers payés	1 514	1 807
Intérêts reçus	8 403	12 756
Intérêts versés	28	21

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

TABLEAU DES PLACEMENTS

Au 30 septembre 2020

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
OBLIGATIONS					
407 International Inc. 1,80 % 22-05-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	540 000	540	559
407 International Inc. 2,43 % 04-05-2027, rachetables, série MTN	Canada	Sociétés – Non convertibles	490 000	507	525
407 International Inc. 3,14 % 06-03-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	300 000	303	339
407 International Inc. 2,59 % 25-05-2032, rachetables 2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	490 000	490	521
407 International Inc. 4,19 % 25-04-2042, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	130 000	163	162
407 International Inc. 3,65 % 08-09-2044, rachetables, série MTN	Canada	Sociétés – Non convertibles	380 000	382	443
407 International Inc. 3,60 % 21-05-2047, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	710 000	713	829
407 International Inc. 3,72 % 11-05-2048, rachetables 2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 430 000	1 430	1 703
407 International Inc. 3,67 % 08-03-2049, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	370 000	370	441
A&V Holdings Midco LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 28-02-2020	États-Unis	Prêts à terme	473 291 USD	553	583
Aegis Toxicology Sciences Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 09-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	156 800 USD	199	172
AES Panama Generation Holdings SRL 4,38 % 31-05-2030, rachetables 2030	Panama	Sociétés – Non convertibles	3 800 000 USD	5 074	5 202
AG Merger Sub II Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-08-2026	États-Unis	Prêts à terme	871 USD	1	1
Air Lease Corp. 2,63 % 05-12-2024, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	750 000	743	714
Albertsons Cos. Inc. 4,63 % 15-01-2027, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	750 000 USD	1 034	1 019
Albertsons Cos. Inc. 5,88 % 15-02-2028, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	50 000 USD	70	71
Alcami Carolinas Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 06-07-2025	États-Unis	Prêts à terme	343 000 USD	449	377
Alchemy US Holdco LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-10-2025	États-Unis	Prêts à terme	267 366 USD	342	331
Algonquin Power & Utilities Corp. 4,65 % 15-02-2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 730 000	2 902	2 863
Alimentation Couche-Tard inc. 2,95 % 25-01-2030, rachetables 2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	620 000 USD	815	891
AltaLink, L.P. 1,51 % 11-09-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	440 000	440	440
AltaLink, L.P. 3,72 % 03-12-2046, rachetables, série MTN	Canada	Sociétés – Non convertibles	795 000	795	967
American Tower Corp. 1,88 % 15-10-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	500 000 USD	666	657
APFS Staffing Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 10-04-2026	États-Unis	Prêts à terme	276 500 USD	362	362
Apple Inc. 3,35 % 10-01-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 810 000 AUD	1 747	1 878
Apple Inc. 2,51 % 19-08-2024, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	7 290 000	7 344	7 746
Arcos Dorados Holdings Inc. 5,88 % 04-04-2027, rachetables 2022	Brésil	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	135	139
ARD Finance SA 6,50 % 30-06-2027, rachetables 2022 144A	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	133	132
Ascend Performance Materials Operations LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 16-08-2026	États-Unis	Prêts à terme	425 700 USD	554	567
AT&T Inc. 4,00 % 25-11-2025, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	350 000	387	393
AT&T Inc. 1,65 % 01-02-2028, rachetables 2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	360 000 USD	480	481
AT&T Inc. 2,25 % 01-02-2032, rachetables 2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	830 000 USD	1 107	1 106
Athene Global Funding 2,10 % 24-09-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	840 000	839	839
Ball Metalpack Finco LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 26-07-2025	États-Unis	Prêts à terme	263 925 USD	343	339
Banco del Estado de Chile 4,13 % 07-10-2020 144A	Chili	Sociétés – Non convertibles	1 600 000 USD	2 121	2 132
Bank of America Corp., taux variable 25-04-2025, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 270 000	1 277	1 344
Bank of America Corp., taux variable 20-09-2025, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	770 000	770	832
Banque d'Israël 0 % 02-12-2020	Israël	Gouvernements étrangers	30 186 000 ILS	11 491	11 726
Banque de Montréal 2,70 % 11-09-2024, série DPNT	Canada	Sociétés – Non convertibles	230 000	236	246



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2020

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
OBLIGATIONS (suite)					
La Banque de Nouvelle-Écosse 2,98 % 17-04-2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	380 000	382	402
La Banque de Nouvelle-Écosse 2,49 % 23-09-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	230 000	231	242
bclMC Realty Corp. 1,68 % 03-03-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	410 000	410	420
bclMC Realty Corp. 1,75 % 24-07-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	470 000	470	472
BCPE Cycle Merger Sub II Inc. 10,63 % 15-07-2027, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	560 000 USD	757	795
Beacon Escrow Corp. 4,88 % 01-11-2025, rachetables 2020 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	60 000 USD	77	78
Bell Canada Inc. 1,65 % 16-08-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	820 000	820	821
Bell Canada Inc. 2,90 % 10-09-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	860 000	858	925
Bell Canada Inc. 2,50 % 14-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000	250	259
The Boeing Co. 4,88 % 01-05-2025, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	90 000 USD	125	130
The Boeing Co. 5,04 % 01-05-2027, rachetables 2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	110 000 USD	153	161
BP Capital Markets PLC 3,47 % 15-05-2025	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	110 000	114	120
Brookfield Infrastructure Finance ULC 4,20 % 11-09-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	655 000	656	755
Brookfield Infrastructure Finance ULC 3,41 % 09-10-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 660 000	1 629	1 814
Brookfield Infrastructure Finance ULC 2,86 % 01-09-2032, rachetables 2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	740 000	740	755
Brookfield Property REIT Inc. 5,75 % 15-05-2026, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	80 000 USD	84	84
Brookfield Renewable Energy Partners ULC 3,63 % 15-01-2027, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 460 000	1 452	1 628
Brookfield Renewable Partners ULC 4,25 % 15-01-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 020 000	1 019	1 193
Brookfield Renewable Partners ULC 3,38 % 15-01-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	400 000	400	443
Brookfield Renewable Partners ULC 4,29 % 05-11-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	630 000	629	743
Brookfield Renewable Partners ULC 3,33 % 13-08-2050, rachetables 2050	Canada	Sociétés – Non convertibles	430 000	430	429
Brookfield Residential Properties Inc. 6,25 % 15-09-2027, rachetables 2022 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000 USD	66	67
Bruce Power L.P. 3,00 % 21-06-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 090 000	1 104	1 158
Bruce Power L.P. 3,97 % 23-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	310 000	319	349
Builders FirstSource Inc. 5,00 % 01-03-2030, rachetables 2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000 USD	28	28
BWAY Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 03-04-2024	États-Unis	Prêts à terme	250 704 USD	298	315
BWAY Holding Co. 7,25 % 15-04-2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 068 000 USD	1 366	1 343
C&D Technologies Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 13-12-2025	États-Unis	Prêts à terme	294 553 USD	346	334
Canada Goose Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 02-12-2024	Canada	Prêts à terme	303 474 USD	380	402
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada 2,85 % 15-12-2021, rachetables 2021	Canada	Sociétés – Non convertibles	500 000 USD	547	682
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada 3,05 % 08-02-2050, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000	198	216
Canadian Natural Resources Ltd. 3,55 % 03-06-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	680 000	684	721



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2020

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
OBLIGATIONS (suite)					
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 3,15 % 13-03-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	670 000	669	744
Capital Power Corp. 4,28 % 18-09-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 040 000	2 051	2 227
Capital Power Corp. 4,99 % 23-01-2026, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	700 000	700	799
Capital Power Corp. 4,42 % 08-02-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	570 000	573	651
Capital Power Corp. 3,15 % 01-10-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	860 000	864	862
CareCentrix Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 22-03-2025	États-Unis	Prêts à terme	633 847 USD	818	809
Casablanca US Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 31-03-2024	États-Unis	Prêts à terme	760 500 USD	977	749
Cascades inc. 5,13 % 15-01-2025, rachetables 2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	90 000	90	93
Cascades inc. 5,13 % 15-01-2026, rachetables 2023 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	190 000 USD	252	267
CCS-CMGC Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 25-09-2025	États-Unis	Prêts à terme	225 975 USD	290	281
Celulosa Arauco y Constitución SA 4,20 % 29-01-2030, rachetables 2029	Chili	Sociétés – Non convertibles	2 100 000 USD	2 758	2 965
Cemex SAB de CV 7,38 % 05-06-2027, rachetables 2023	Mexique	Sociétés – Non convertibles	800 000 USD	1 083	1 150
Centrais Elétricas Brasileiras SA 3,63 % 04-02-2025	Brésil	Sociétés – Non convertibles	530 000 USD	699	704
Centrais Elétricas Brasileiras SA 4,63 % 04-02-2030	Brésil	Sociétés – Non convertibles	530 000 USD	699	710
CEVA Logistics Finance BV, prêt à terme B de premier rang, taux variable 03-08-2025	États-Unis	Prêts à terme	385 823 USD	492	472
Charter Communications Operating LLC 2,80 % 01-04-2031, rachetables 2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	520 000 USD	727	719
Chartwell résidences pour retraités 4,21 % 28-04-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	350 000	350	365
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 3,55 % 10-01-2025, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	110 000	111	119
Citadel Securities LP, prêt à terme B de premier rang, taux variable 27-02-2026	États-Unis	Prêts à terme	1 490 428 USD	1 969	1 976
Ville d'Oslo 3,65 % 08-11-2023	Norvège	Gouvernements étrangers	4 000 000 NOK	713	623
Ville d'Oslo, taux variable 06-05-2026	Norvège	Gouvernements étrangers	30 000 000 NOK	4 653	4 301
The Clorox Co. 1,80 % 15-05-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	600 000 USD	838	824
Coca-Cola FEMSA SAB de CV 2,75 % 22-01-2030, rachetables 2029	Mexique	Sociétés – Non convertibles	1 910 000 USD	2 463	2 746
Coca-Cola FEMSA SAB de CV 1,85 % 01-09-2032, rachetables 2032	Mexique	Sociétés – Non convertibles	900 000 USD	1 179	1 204
Commonwealth of Bahamas 5,75 % 16-01-2024	Bahamas	Gouvernements étrangers	3 030 000 USD	4 199	3 649
Commonwealth of Bahamas 6,95 % 20-11-2029	Bahamas	Gouvernements étrangers	1 920 000 USD	2 830	2 319
CommScope Technologies Finance LLC 8,25 % 01-03-2027, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	490 000 USD	656	679
CommScope Technologies LLC 5,00 % 15-03-2027, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	115	128
Concrete Pumping Merger Sub Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 14-11-2025	États-Unis	Prêts à terme	293 604 USD	377	375
Connect Finco SARL, prêt à terme B de premier rang, taux variable 23-09-2026	Royaume-Uni	Prêts à terme	185 070 USD	242	239
Connect Finco SARL 6,75 % 01-10-2026	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	140 000 USD	186	188
CoolSys Inc., prêt à terme à prélèvement différé de premier rang, taux variable 31-12-2049	États-Unis	Prêts à terme	15 273 USD	20	20



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2020

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
OBLIGATIONS (suite)					
CoolSys Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 31-12-2049	États-Unis	Prêts à terme	401 859 USD	524	536
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	600 937	601	679
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-09-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	589 508	590	667
Corp Nacional del Cobre de Chile 4,50 % 16-09-2025	Chili	Sociétés – Non convertibles	1 432 000 USD	1 913	2 155
Corporación Andina de Fomento 3,25 % 11-02-2022	Supranationales	s.o.	440 000 USD	593	605
CPPIB Capital Inc. 1,95 % 30-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 290 000	2 281	2 437
Credicorp Ltd. 2,75 % 17-06-2025, rachetables 2025	Pérou	Sociétés – Non convertibles	300 000 USD	399	406
Fonds de placement immobilier Crombie 3,92 % 21-06-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	230 000	230	248
Crown Subsea Communications Holding Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 02-11-2025	États-Unis	Prêts à terme	146 606 USD	189	195
CU Inc. 4,722 % 09-09-2043, rachetables 2043	Canada	Sociétés – Non convertibles	260 000	340	349
CU Inc. 3,96 % 27-07-2045, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000	54	62
Dawn Acquisition LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 25-10-2025	États-Unis	Prêts à terme	294 430 USD	382	353
Deutsche Bundesrepublik, obligations indexées sur l'inflation 0,50 % 15-04-2030	Allemagne	Gouvernements étrangers	5 610 000 EUR	10 402	10 904
Dollar General Corp. 4,13 % 01-05-2028, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 270 000 USD	1 905	1 990
Dollarama inc. 1,51 % 20-09-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	280 000	280	280
République dominicaine 7,45 % 30-04-2044	République dominicaine	Gouvernements étrangers	1 750 000 USD	2 430	2 626
DynCorp International Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 15-08-2025	États-Unis	Prêts à terme	646 000 USD	834	857
Eastern Power LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 02-10-2025	États-Unis	Prêts à terme	182 873 USD	239	242
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA 3,65 % 07-05-2030, rachetables 2030	Chili	Sociétés – Non convertibles	500 000 USD	702	737
Empresas Públicas de Medellín ESP 4,38 % 15-02-2031	Colombie	Sociétés – Non convertibles	1 020 000 USD	1 370	1 365
Enbridge Inc. 2,44 % 02-06-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	450 000	450	469
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 240 000	4 246	4 254
Enbridge Inc., taux variable 12-04-2078, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 670 000	1 676	1 805
ENC Holding Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 30-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	156 983 USD	202	190
Énergir inc. 2,10 % 16-04-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	460 000	460	485
ENMAX Corp. 3,33 % 02-06-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	400 000	410	433
Ensono LP, prêt à terme de premier rang, taux variable 30-04-2025	États-Unis	Prêts à terme	175 259 USD	223	228
EPCOR Utilities Inc. 3,55 % 27-11-2047, rachetables 2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	750 000	750	877
EPCOR Utilities Inc. 3,11 % 08-07-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	950 000	950	1 032
EPCOR Utilities Inc. 2,90 % 19-05-2050, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	370 000	370	385
Fairfax Financial Holdings Ltd. 8,30 % 15-04-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 070 000 USD	1 617	1 786
Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,23 % 14-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	370 000	370	395
Fédération des caisses Desjardins du Québec 2,09 % 17-01-2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	590 000	589	602
First American Payment Systems LP, prêt à terme B de premier rang, taux variable 21-02-2027	États-Unis	Prêts à terme	425 700 USD	560	555
First Eagle Holdings Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 17-02-2027	États-Unis	Prêts à terme	567 525 USD	741	740
First Quantum Minerals Ltd. 7,25 % 01-04-2023, rachetables 2020 144A	Zambie	Sociétés – Non convertibles	450 000 USD	573	599



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2020

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
OBLIGATIONS (suite)					
Forming Machining Industries Holdings LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 03-10-2025	États-Unis	Prêts à terme	216 150 USD	278	235
Foundation Building Materials LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 11-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	196 500 USD	250	259
Foxtrot Escrow Issuer LLC 12,25 % 15-11-2026, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	184 000 USD	236	263
Fresenius US Finance II Inc. 4,25 % 01-02-2021 144A	Allemagne	Sociétés – Non convertibles	2 000 000 USD	2 706	2 690
Frontera Generation Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 25-04-2025	États-Unis	Prêts à terme	254 800 USD	326	118
Fusion Connect Inc., prêt à terme (paiement en nature) de premier rang, taux variable 14-07-2025	États-Unis	Prêts à terme	113 793 USD	399	64
FXI Holdings Inc. 7,88 % 01-11-2024, rachetables 2020 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	30 000 USD	36	38
GEMS MENASA (Cayman) Ltd., prêt à terme B de premier rang, taux variable 30-07-2026	Émirats arabes unis	Prêts à terme	88 236 USD	115	114
GFL Environmental Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 31-05-2025	Canada	Prêts à terme	242 700 USD	315	322
GFL Environmental Inc. 7,00 % 01-06-2026, rachetables 2021 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	90 000 USD	115	126
GFL Environmental Inc. 5,13 % 15-12-2026, rachetables 2022 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	140 000 USD	185	193
Gibson Energy Inc. 2,85 % 14-07-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	320 000	325	333
Gibson Energy Inc. 3,60 % 17-09-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	650 000	648	702
GLOBALFOUNDRIES Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 24-05-2026	États-Unis	Prêts à terme	829 500 USD	1 103	1 104
Gouvernement de l'Argentine 8,75 % 07-05-2024	Argentine	Gouvernements étrangers	249 567 USD	–	127
Gouvernement de l'Argentine 1,00 % 09-07-2029	Argentine	Gouvernements étrangers	110 113 USD	159	67
Gouvernement de l'Argentine, taux variable 09-07-2035	Argentine	Gouvernements étrangers	1 330 000 USD	642	668
Gouvernement de l'Argentine 0,13 % 09-07-2046	Argentine	Gouvernements étrangers	4 229 200 USD	5 153	2 176
Gouvernement de l'Australie 2,50 % 21-05-2030	Australie	Gouvernements étrangers	6 950 000 AUD	7 269	7 654
Gouvernement de l'Australie 1,00 % 21-12-2030	Australie	Gouvernements étrangers	20 080 000 AUD	18 299	19 379
Gouvernement de l'Australie 1,75 % 21-06-2051	Australie	Gouvernements étrangers	7 720 000 AUD	7 067	7 349
Gouvernement des Bermudes 3,72 % 25-01-2027, rachetables 2026	Bermudes	Gouvernements étrangers	1 831 000 USD	2 548	2 689
Gouvernement des Bermudes 2,38 % 20-08-2030, rachetables 2030	Bermudes	Gouvernements étrangers	1 200 000 USD	1 582	1 627
Gouvernement des Bermudes 3,38 % 20-08-2050, rachetables 2050	Bermudes	Gouvernements étrangers	3 700 000 USD	5 031	4 991
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2029	Brésil	Gouvernements étrangers	2 590 000 BRL	7 910	7 108
Gouvernement du Brésil 3,88 % 12-06-2030	Brésil	Gouvernements étrangers	4 900 000 USD	6 556	6 463
Gouvernement du Canada 1,75 % 01-05-2021	Canada	Gouvernement fédéral	100 000	101	101
Gouvernement du Canada 1,25 % 01-03-2025	Canada	Gouvernement fédéral	10 000	10	10
Gouvernement de la Chine 1,99 % 09-04-2025	Chine	Gouvernements étrangers	70 000 000 CNY	13 126	13 144
Gouvernement de la Chine 3,29 % 23-05-2029	Chine	Gouvernements étrangers	111 600 000 CNY	21 344	22 039
Gouvernement de la Chine 3,13 % 21-11-2029	Chine	Gouvernements étrangers	134 600 000 CNY	26 195	26 335
Gouvernement de l'Irlande 5,00 % 18-10-2020	Irlande	Gouvernements étrangers	2 700 000 EUR	4 755	4 224
Gouvernement d'Israël 2,75 % 03-07-2030	Israël	Gouvernements étrangers	1 530 000 USD	2 157	2 249
Gouvernement du Japon 0 % 22-02-2021	Japon	Gouvernements étrangers	843 900 000 JPY	10 539	10 661
Gouvernement du Mexique 6,50 % 10-06-2021	Mexique	Gouvernements étrangers	3 433 400 MXN	220	210
Gouvernement du Mexique 5,75 % 05-03-2026	Mexique	Gouvernements étrangers	58 594 900 MXN	3 537	3 611
Gouvernement du Mexique 7,50 % 03-06-2027	Mexique	Gouvernements étrangers	119 840 000 MXN	8 099	8 013
Gouvernement du Mexique 8,50 % 31-05-2029	Mexique	Gouvernements étrangers	171 520 000 MXN	13 122	12 162
Gouvernement du Mexique 3,25 % 16-04-2030, rachetables 2030	Mexique	Gouvernements étrangers	2 500 000 USD	3 379	3 382
Gouvernement de la Russie 6,90 % 23-05-2029	Russie	Gouvernements étrangers	144 656 000 RUB	3 005	2 620



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2020

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
OBLIGATIONS (suite)					
Gouvernement de la Russie 7,65 % 10-04-2030	Russie	Gouvernements étrangers	414 000 000 RUB	8 176	7 905
Gouvernement de l'Afrique du Sud 8,00 % 31-01-2030	Afrique du Sud	Gouvernements étrangers	76 700 000 ZAR	5 538	5 575
Gouvernement de l'Australie-Méridionale 3,00 % 24-05-2028	Australie	Gouvernements étrangers	6 800 000 AUD	6 864	7 472
Gouvernement de la Suède 0,13 % 09-09-2030	Suède	Gouvernements étrangers	19 000 000 SEK	2 869	2 883
Gouvernement de Trinité-et-Tobago 4,50 % 26-06-2030, rachetables 2030	Trinité-et-Tobago	Gouvernements étrangers	2 200 000 USD	2 966	2 797
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 2,73 % 03-04-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	560 000	573	602
Grupo GICSA SAB de CV 9,50 % 18-12-2034	Mexique	Sociétés – Non convertibles	29 800 000 MXN	2 037	1 398
Hadrian Merger Sub Inc. 8,50 % 01-05-2026, rachetables 2021 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	483 000 USD	616	642
HCA Healthcare Inc. 3,50 % 01-09-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	340 000 USD	452	463
HCA Inc. 5,63 % 01-09-2028, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000 USD	32	31
Heathrow Funding Ltd. 4,875 % 15-07-2021 144A	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	1 150 000 USD	1 682	1 568
Heathrow Funding Ltd. 3,25 % 21-05-2025	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	30 000	31	31
Heathrow Funding Ltd. 3,40 % 08-03-2028	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	1 190 000	1 188	1 234
Heathrow Funding Ltd. 3,79 % 04-09-2030, rachetables 2030	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	990 000	990	1 026
Heritage Power LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 08-07-2026	États-Unis	Prêts à terme	474 000 USD	602	606
Honda Canada Finance Inc. 1,34 % 17-03-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	560 000	560	560
Hudson River Trading LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 18-02-2027	États-Unis	Prêts à terme	578 543 USD	758	755
Husky Energy Inc. 3,50 % 07-02-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 060 000	1 060	1 059
Hydro One Inc. 2,54 % 05-04-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 180 000	1 197	1 248
Hydro One Inc. 2,97 % 26-06-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000	127	131
Hydro One Inc. 2,16 % 28-02-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	140 000	149	148
Hydro One Inc. 3,72 % 18-11-2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	400 000	400	483
Hydro One Inc. 3,63 % 25-06-2049, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	60 000	70	72
Hydro One Ltd. 1,41 % 15-10-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	620 000	620	622
IAMGOLD Corp. 5,75 % 15-10-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 200 000 USD	2 901	2 844
INEOS Enterprises Holdings US Finco LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 03-09-2026	États-Unis	Prêts à terme	382 380 USD	498	507
Innovative Water Care Global Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 27-02-2026	États-Unis	Prêts à terme	443 250 USD	554	503
Institutional Shareholder Services Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 26-02-2026	États-Unis	Prêts à terme	384 150 USD	506	496
Intelsat Jackson Holdings SA 8,50 % 15-10-2024, rachetables 2020 144A	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	1 020 000 USD	1 352	878
Inter Pipeline Ltd. 2,73 % 18-04-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	460 000	465	474
Inter Pipeline Ltd. 3,48 % 16-12-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	470 000	470	499
Inter Pipeline Ltd., taux variable 26-03-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	380 000	380	375
Inter Pipeline Ltd., taux variable 19-11-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	660 000	660	641
Interior Logic Group Holdings IV LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 21-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	568 400 USD	728	730
Intermedia Holdings Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 13-07-2025	États-Unis	Prêts à terme	264 681 USD	345	351
Isagenix International LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 26-04-2025	États-Unis	Prêts à terme	247 652 USD	316	175
Ivanhoe Cambridge II Inc. 2,91 % 27-06-2023, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	530 000	530	558



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2020

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
OBLIGATIONS (suite)					
Ivanhoe Cambridge II Inc. 2,30 % 12-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	420 000	420	441
Jane Street Group LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 31-01-2025	États-Unis	Prêts à terme	373 288 USD	495	494
John Deere Financial Inc. 1,34 % 08-09-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	580 000	581	580
Keane Group Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 18-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	293 250 USD	376	349
Kestrel Bidco Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 07-08-2026	Canada	Prêts à terme	597 000 USD	781	693
Keyera Corp., taux variable 13-06-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	440 000	441	451
Kommuninvest I Sverige AB 2,50 % 01-12-2020	Suède	Gouvernements étrangers	8 600 000 SEK	1 481	1 284
The Kroger Co. 3,95 % 15-01-2050, rachetables 2049	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	635 000 USD	904	996
Produits Kruger s.e.c. 6,00 % 24-04-2025, rachetables 2021	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000	200	200
L&W Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 17-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	258 361 USD	331	334
LABL Escrow Issuer LLC 6,75 % 15-07-2026, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	136 000 USD	182	191
LABL Escrow Issuer LLC 10,50 % 15-07-2027, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	487 000 USD	648	691
Liberty Utilities (Canada) LP 3,32 % 14-02-2050, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	360 000	360	369
LifeMiles Ltd., prêt à terme B de premier rang, taux variable 18-08-2022	Colombie	Prêts à terme	338 275 USD	434	415
LifeScan Global Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 19-06-2024	États-Unis	Prêts à terme	671 722 USD	853	849
Les Compagnies Loblaw Itée 4,49 % 11-12-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000	44	48
Les Compagnies Loblaw Itée 2,28 % 07-05-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	840 000	845	868
LogMeIn Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 14-08-2027	États-Unis	Prêts à terme	600 000 USD	775	774
Société Financière Manuvie, taux variable 09-05-2028, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	550 000	550	579
Matterhorn Merger Sub LLC 8,50 % 01-06-2026, rachetables 2021 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	166 000 USD	212	218
McDonald's Corp. 3,13 % 04-03-2025, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 710 000	1 706	1 853
Meredith Corp., prêt à terme B de premier rang 31-01-2025	États-Unis	Prêts à terme	438 900 USD	575	578
Meredith Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 31-01-2025	États-Unis	Prêts à terme	410 904 USD	509	529
Metronet Systems Holding LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 31-12-2049	États-Unis	Prêts à terme	396 900 USD	521	530
Minotaur Acquisition Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 27-02-2026	États-Unis	Prêts à terme	433 227 USD	558	552
Morgan Stanley 3,00 % 07-02-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 900 000	1 900	2 015
Multi-Color Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 17-06-2026	États-Unis	Prêts à terme	346 500 USD	459	458
MyNEXUS Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 19-06-2024	États-Unis	Prêts à terme	256 109 USD	330	327
NAV CANADA 2,06 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	420 000	420	436
NAV CANADA 2,92 % 29-09-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000	250	265
Nederlandse Waterschapsbank NV 1,00 % 28-05-2030	Pays-Bas	Gouvernements étrangers	1 200 000 USD	1 655	1 584
Neenah Foundry Co., prêt à terme B de premier rang, taux variable 08-12-2022	États-Unis	Prêts à terme	245 548 USD	313	286
New Red Finance Inc. 5,00 % 15-10-2025, rachetables 2020 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000 USD	147	164
New Red Finance Inc. 4,00 % 15-10-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	60 000 USD	79	80



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2020

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
OBLIGATIONS (suite)					
Nexstar Escrow Inc. 5,63 % 15-07-2027, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	232 000 USD	308	325
NextEra Energy Capital Holdings Inc. 2,25 % 01-06-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	960 000 USD	1 348	1 333
Nine Energy Service Inc. 8,75 % 01-11-2023, rachetables 2020 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	670 000 USD	861	268
Norbord Inc. 5,75 % 15-07-2027, rachetables 2022 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	90 000 USD	120	127
Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc. 4,11 % 31-03-2042	Canada	Sociétés – Non convertibles	749 412	749	895
Nova Scotia Power Inc. 3,57 % 05-04-2049, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	480 000	481	544
OMERS Finance Trust 1,55 % 21-04-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 060 000	2 058	2 106
OMERS Finance Trust 2,60 % 14-05-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 100 000	1 099	1 203
OMERS Realty Corp. 3,24 % 04-10-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 940 000	1 940	2 180
Ontario Power Generation Inc. 3,32 % 04-10-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	970 000	970	1 086
Ontario Power Generation Inc. 2,98 % 13-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	560 000	560	616
Ontario Power Generation Inc. 4,25 % 18-01-2049, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	435 000	439	544
Owens & Minor Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	298 328 USD	376	386
Panther BF Aggregator 2 LP 8,50 % 15-05-2027, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	770 000 USD	1 047	1 063
Corporation Pétroles Parkland 6,00 % 01-04-2026, rachetables 2021 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	386 000 USD	506	540
Corporation Pétroles Parkland 5,88 % 15-07-2027, rachetables 2022 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	26 000 USD	34	36
Corporation Pétroles Parkland 6,00 % 23-06-2028, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	970 000	970	1 020
The Pasha Group, prêt à terme B de premier rang, taux variable 13-12-2022	États-Unis	Prêts à terme	258 672 USD	323	319
PayPal Holdings Inc. 1,35 % 01-06-2023	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	300 000 USD	420	409
PayPal Holdings Inc. 2,65 % 01-10-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	600 000 USD	794	872
PayPal Holdings Inc. 2,30 % 01-06-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	370 000 USD	518	521
Pembina Pipeline Corp. 3,54 % 03-02-2025, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	450 000	449	484
Pembina Pipeline Corp. 4,02 % 27-03-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 800 000	1 843	2 018
Pembina Pipeline Corp. 3,62 % 03-04-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	980 000	994	1 070
PepsiCo Inc. 2,50 % 01-11-2022	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	700 000 GBP	1 355	1 261
Petróleos de Venezuela SA 6,00 % 16-05-2024	Venezuela	Sociétés – Non convertibles	480 000 USD	153	20
Petróleos Mexicanos 6,50 % 23-01-2029	Mexique	Sociétés – Non convertibles	650 000 USD	841	779
Petróleos Mexicanos 5,95 % 28-01-2031, rachetables 2030	Mexique	Sociétés – Non convertibles	1 180 000 USD	1 543	1 323
Plaze Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 03-08-2026	États-Unis	Prêts à terme	480 000 USD	616	631
PLH Group Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 06-08-2023	États-Unis	Prêts à terme	196 845 USD	248	227
Pluto Acquisition I Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 18-06-2026	États-Unis	Prêts à terme	355 500 USD	471	472
Polymer Process Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 29-04-2026	États-Unis	Prêts à terme	395 000 USD	519	511
Project Leopard Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 07-07-2023	États-Unis	Prêts à terme	313 561 USD	404	412
Province de l'Ontario 2,65 % 02-12-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	50 000	58	57
Province de l'Ontario 1,90 % 02-12-2051	Canada	Gouvernements provinciaux	10 000	10	10
Province de Québec 1,90 % 01-09-2030	Canada	Gouvernements provinciaux	5 000	5	5
PS HoldCo LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 02-03-2025	États-Unis	Prêts à terme	116 800 USD	150	147



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2020

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
OBLIGATIONS (suite)					
PSC Industrial Outsourcing LP, prêt à terme B de premier rang, taux variable 05-10-2024	États-Unis	Prêts à terme	399 750 USD	498	504
PSP Capital Inc. 2,05 % 15-01-2030	Canada	Gouvernement fédéral	2 830 000	2 839	3 024
Rackspace Hosting Inc. 8,63 % 15-11-2024, rachetables 2020 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	670 000 USD	837	936
Reliance LP 2,68 % 01-12-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	430 000	430	444
Research Now Group Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 20-12-2024	États-Unis	Prêts à terme	407 927 USD	499	517
Rite Aid Corp. 7,70 % 15-02-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 600 000 USD	2 817	2 816
Rogers Communications Inc. 3,65 % 31-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 520 000	1 574	1 703
Rogers Communications Inc. 3,25 % 01-05-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	710 000	709	785
Banque Royale du Canada 2,95 % 01-05-2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	150 000	154	159
Obligation d'emprunt fédéral de la Russie (OFZ) 7,05 % 19-01-2028	Russie	Gouvernements étrangers	200 820 000 RUB	4 372	3 678
Saputo inc. 2,88 % 19-11-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	360 000	360	384
Saputo inc. 2,24 % 16-06-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	670 000	671	696
Saudi Arabian Oil Co. 2,75 % 16-04-2022 144A	Arabie saoudite	Sociétés – Non convertibles	500 000 USD	665	684
Shaw Communications Inc. 2,90 % 09-12-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 300 000	1 314	1 370
Shields Health Solutions Holdings LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 13-08-2026	États-Unis	Prêts à terme	297 750 USD	392	386
Sienna Senior Living Inc. 3,11 % 04-11-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	260 000	260	260
Sienna Senior Living Inc. 3,45 % 27-02-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	330 000	330	332
Sigma Bidco BV, prêt à terme B de premier rang, taux variable 07-03-2025	Pays-Bas	Prêts à terme	390 000 EUR	618	593
Silgan Holdings Inc. 4,13 % 01-02-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	132	136
SIRVA Worldwide Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 31-07-2025	États-Unis	Prêts à terme	304 284 USD	390	338
SmartCentres Real Estate Investment Trust 3,19 % 11-06-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	360 000	360	375
Source Energy Services Canada LP 10,50 % 15-12-2021, rachetables 2020 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	286 000	295	80
South Coast British Columbia Transportation Authority 1,60 % 03-07-2030	Canada	Gouvernements provinciaux	840 000	840	855
SS&C Technologies Inc., prêt à terme B5 de premier rang, taux variable 16-04-2025	États-Unis	Prêts à terme	244 936 USD	320	317
Starfruit US Holdco LLC 8,00 % 01-10-2026, rachetables 2021 144A	Pays-Bas	Sociétés – Non convertibles	120 000 USD	152	170
Summit Industrial Income Real Estate Investment Trust 2,15 % 17-09-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	390 000	390	392
Financière Sun Life inc., taux variable 01-10-2035	Canada	Sociétés – Non convertibles	860 000	859	859
Suncor Énergie Inc. 3,10 % 24-05-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	770 000	769	806
Supérieur Plus S.E.C. 7,00 % 15-07-2026, rachetables 2021 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	290 000 USD	385	416
Target Corp. 2,25 % 15-04-2025, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	450 000 USD	631	643
TELUS Corp. 2,75 % 08-07-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	640 000	639	684
TELUS Corp. 2,35 % 27-01-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	610 000	608	635
TELUS Corp. 3,30 % 02-05-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	460 000	456	509
TELUS Corp. 3,15 % 19-02-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	900 000	898	988
TELUS Corp. 2,05 % 07-10-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	620 000	619	619
TELUS Corp. 4,70 % 06-03-2048, rachetables 2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000	152	146
Tencent Holdings Ltd. 2,39 % 03-06-2030, rachetables 2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	420 000 USD	578	570
Tencent Music Entertainment Group 1,38 % 03-09-2025, rachetables 2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	290 000 USD	381	384



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2020

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
OBLIGATIONS (suite)					
Tencent Music Entertainment Group 2,00 % 03-09-2030, rachetables 2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	210 000 USD	275	274
Teneo Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 12-07-2025	États-Unis	Prêts à terme	117 009 USD	147	151
Tenet Healthcare Corp. 6,13 % 01-10-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	160 000 USD	209	208
TerraForm Power Operating LLC 5,00 % 31-01-2028, rachetables 2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	270 000 USD	347	394
TerraForm Power Operating LLC 4,75 % 15-01-2030, rachetables 2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	40 000 USD	53	57
Terrier Media Buyer Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 12-12-2026	États-Unis	Prêts à terme	436 700 USD	573	569
Thomson Reuters Corp. 2,24 % 14-05-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	930 000	930	969
Thor Industries Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-11-2025	États-Unis	Prêts à terme	465 493 USD	600	618
Titan Sub LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 19-09-2026	États-Unis	Prêts à terme	267 975 USD	352	357
T-Mobile USA Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-04-2027	États-Unis	Prêts à terme	389 025 USD	536	518
T-Mobile USA Inc. 3,50 % 15-04-2025, rachetables 2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	450 000 USD	638	656
T-Mobile USA Inc. 2,55 % 15-02-2031, rachetables 2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	380 000 USD	516	525
Groupe TMX Ltée 2,30 % 11-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	400 000	401	430
Groupe TMX Ltée 3,78 % 05-06-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	470 000	472	539
TransCanada PipeLines Ltd. 3,69 % 19-07-2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	160 000	163	170
TransCanada PipeLines Ltd. 3,00 % 18-09-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	470 000	469	502
TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 240 000	1 210	1 231
Trico Group LLC, prêt à terme B3 de premier rang, taux variable 02-02-2024	États-Unis	Prêts à terme	338 244 USD	407	445
Trulieve Cannabis Corp. 9,75 % 18-06-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	290 000 USD	379	402
Ultra Clean Holdings Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 27-08-2025	États-Unis	Prêts à terme	289 172 USD	371	385
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-04-2021	États-Unis	Gouvernements étrangers	70 000 USD	104	102
Obligations du Trésor des États-Unis 1,13 % 28-02-2027	États-Unis	Gouvernements étrangers	15 000 000 USD	22 255	20 887
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,50 % 15-01-2028	États-Unis	Gouvernements étrangers	5 960 000 USD	7 896	9 354
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-07-2030	États-Unis	Gouvernements étrangers	3 600 000 USD	5 341	5 326
Obligations du Trésor des États-Unis 3,00 % 15-02-2047	États-Unis	Gouvernements étrangers	8 150 000 USD	11 135	14 711
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,01 % 15-02-2048	États-Unis	Gouvernements étrangers	8 097 000 USD	10 769	15 644
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,00 % 15-02-2049	États-Unis	Gouvernements étrangers	9 603 200 USD	16 262	18 400
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,25 % 15-02-2050	États-Unis	Gouvernements étrangers	3 600 000 USD	5 579	5 638
Obligations du Trésor des États-Unis 2,00 % 15-02-2050	États-Unis	Gouvernements étrangers	10 900 000 USD	18 248	16 470
Administration de l'aéroport de Vancouver 3,66 % 23-11-2048, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	920 000	920	1 063
Ventas Inc. 2,80 % 12-04-2024, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	750 000	750	759



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2020

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
OBLIGATIONS (suite)					
VeriFone Systems Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 09-08-2025	États-Unis	Prêts à terme	265 275 USD	344	318
Verizon Communications Inc. 2,50 % 16-05-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 000 000	998	1 051
Vertex Aerospace Services Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 14-06-2025	États-Unis	Prêts à terme	155 709 USD	203	205
Vidéotron ltée 4,50 % 15-01-2030, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 310 000	1 310	1 376
VTR Comunicaciones SPA 5,13 % 15-01-2028, rachetables 2023 144A	Chili	Sociétés – Non convertibles	700 000 USD	953	965
VTR Finance NV 6,38 % 15-07-2028, rachetables 2023 144A	Chili	Sociétés – Non convertibles	500 000 USD	681	703
Vungle Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 30-09-2026	États-Unis	Prêts à terme	236 804 USD	309	314
VVC Holding Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 07-02-2026	États-Unis	Prêts à terme	341 996 USD	446	450
Walgreen Co. 4,40 % 15-09-2042	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 020 000 USD	1 239	1 465
Walgreens Boots Alliance Inc. 3,20 % 15-04-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	390 000 USD	545	546
Walgreens Boots Alliance Inc. 4,80 % 18-11-2044, rachetables 2044	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	370 000 USD	475	539
Waste Management of Canada Corp. 2,60 % 23-09-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 140 000	1 138	1 215
Wells Fargo & Co. 3,19 % 08-02-2024, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	780 000	780	825
Xperi Holding Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-06-2025	États-Unis	Prêts à terme	691 250 USD	849	899
Xplornet Communications Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 29-05-2027	Canada	Prêts à terme	578 550 USD	757	759
YPF SA 6,95 % 21-07-2027	Argentine	Sociétés – Non convertibles	840 000 USD	959	755
Zotec Partners LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 14-02-2024	États-Unis	Prêts à terme	418 646 USD	521	554
Total des obligations				564 443	574 990
ACTIONS					
3M Co.	États-Unis	Produits industriels	67 020	13 665	14 292
AIA Group Ltd.	Hong Kong	Services financiers	593 260	6 164	7 781
Air Liquide SA	France	Matières	71 015	9 100	15 000
AltaGas Ltd., priv., série K	Canada	Énergie	29 189	730	651
Altria Group Inc.	États-Unis	Consommation courante	275 520	17 551	14 174
Amadeus IT Group SA	Espagne	Technologie de l'information	125 240	10 372	9 252
Amphenol Corp., cat. A	États-Unis	Technologie de l'information	36 180	3 747	5 215
Aon PLC	Irlande	Services financiers	35 070	10 117	9 632
Apple Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	205 580	11 859	31 698
Atlas Copco AB, A	Suède	Produits industriels	173 330	6 393	10 988
Automatic Data Processing Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	47 870	8 554	8 890
Becton, Dickinson and Co.	États-Unis	Soins de santé	66 210	15 669	20 510
The Blackstone Group Inc., cat. A	États-Unis	Services financiers	294 444	19 909	20 463
British American Tobacco PLC	Royaume-Uni	Consommation courante	217 170	14 412	10 398
Broadcom Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	32 450	10 464	15 739
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 46	Canada	Immobilier	16 234	407	400
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 48	Canada	Immobilier	19 088	477	460
Brookfield Renewable Partners L.P., priv., série 11	Canada	Services publics	51 967	1 299	1 152
Cerner Corp.	États-Unis	Soins de santé	78 810	7 501	7 585
CME Group Inc.	États-Unis	Services financiers	67 020	11 003	14 929



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2020

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
ACTIONS (suite)					
Colgate-Palmolive Co.	États-Unis	Consommation courante	130 200	12 985	13 373
Corteva Inc.	États-Unis	Matières	193 290	7 124	7 414
Deutsche Börse AG	Allemagne	Services financiers	94 430	10 942	22 075
Diageo PLC	Royaume-Uni	Consommation courante	155 500	6 247	7 096
DuPont de Nemours Inc.	États-Unis	Matières	166 680	10 693	12 311
Ecolab Inc.	États-Unis	Matières	16 020	3 760	4 262
Emerson Electric Co.	États-Unis	Produits industriels	149 650	10 600	13 064
Equifax Inc.	États-Unis	Produits industriels	57 640	7 584	12 040
Eurofins Scientific	France	Soins de santé	10 080	5 276	10 622
Fusion Connect Inc., bons de souscription éch. 14-01-2040	États-Unis	Services de communication	4 761	—	—
Heineken Holding NV, A	Pays-Bas	Consommation courante	102 090	10 913	10 576
Honeywell International Inc.	États-Unis	Produits industriels	56 640	9 027	12 413
Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	Hong Kong	Services financiers	220 190	9 211	13 779
Housing Development Finance Corp. Ltd.	Inde	Services financiers	192 180	6 516	6 090
Intertek Group PLC	Royaume-Uni	Produits industriels	77 190	6 203	8 364
Japan Exchange Group Inc.	Japon	Services financiers	386 570	8 005	14 404
Johnson & Johnson	États-Unis	Soins de santé	102 390	16 019	20 295
JPMorgan Chase & Co.	États-Unis	Services financiers	165 670	19 567	21 234
Kerry Group PLC, A	Irlande	Consommation courante	26 200	4 186	4 477
Keyence Corp.	Japon	Technologie de l'information	20 260	7 107	12 572
Koninklijke Philips NV	Pays-Bas	Soins de santé	246 298	10 599	15 445
Kweichow Moutai Co. Ltd., cat. A	Chine	Consommation courante	34 410	1 278	11 295
Linde PLC	Irlande	Matières	28 720	6 161	9 105
Lockheed Martin Corp.	États-Unis	Produits industriels	30 723	10 432	15 677
London Stock Exchange Group PLC	Royaume-Uni	Services financiers	71 250	5 706	10 858
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	France	Consommation discrétionnaire	14 410	7 940	8 967
McDonald's Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	35 980	5 854	10 514
Microsoft Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	116 090	9 741	32 509
Moody's Corp.	États-Unis	Services financiers	41 220	6 025	15 906
Nestlé SA, nom.	Suisse	Consommation courante	157 510	16 199	24 876
New Oriental Education & Technology Group Inc., CAAE	Chine	Consommation discrétionnaire	42 220	4 487	8 403
Nike Inc., cat. B	États-Unis	Consommation discrétionnaire	44 495	3 222	7 437
Novo Nordisk AS, B	Danemark	Soins de santé	198 330	10 642	18 339
Oracle Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	35 070	1 990	2 787
Otis Worldwide Corp.	États-Unis	Produits industriels	36 630	2 274	3 044
Otsuka Corp.	Japon	Technologie de l'information	148 440	6 830	10 115
Pernod Ricard SA*	France	Consommation courante	27 210	4 503	5 780
Philip Morris International Inc.	États-Unis	Consommation courante	214 650	23 361	21 430
Raytheon Technologies Corp.	États-Unis	Produits industriels	89 690	12 998	6 871
RELX PLC	Royaume-Uni	Produits industriels	287 510	9 412	8 477
Roche Holding AG Genussscheine	Suisse	Soins de santé	47 620	16 838	21 687
Safran SA	France	Produits industriels	77 900	7 717	10 204
SAP AG	Allemagne	Technologie de l'information	70 950	7 965	14 707
The Sherwin-Williams Co.	États-Unis	Matières	21 770	9 401	20 194
Sika AG	Suisse	Matières	51 500	9 241	16 841
Sony Corp.	Japon	Consommation discrétionnaire	145 620	10 020	14 830
Source Energy Services Ltd.	Canada	Énergie	1 547	15	—
Starbucks Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	89 690	6 517	10 260
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	Taiwan	Technologie de l'information	1 140 480	12 635	22 833



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2020

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
ACTIONS (suite)					
Corporation TC Énergie, priv., série 15	Canada	Énergie	27 623	692	674
Tencent Holdings Ltd.	Chine	Services de communication	138 470	6 212	12 277
Texas Instruments Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	96 540	13 806	18 353
TransAlta Corp., priv., série A	Canada	Services publics	48 682	646	427
Trulieve Cannabis Corp., bons de souscription éch. 18-06-2022	États-Unis	Soins de santé	4 659	–	67
Unilever NV CVA	Royaume-Uni	Consommation courante	170 010	10 327	13 662
Vail Resorts Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	40 610	11 715	11 568
Visa Inc., cat. A	États-Unis	Technologie de l'information	60 870	7 326	16 205
Vonovia SE	Allemagne	Immobilier	165 670	11 412	15 154
The Walt Disney Co.	États-Unis	Services de communication	45 250	5 973	7 475
Wolters Kluwer NV	Pays-Bas	Produits industriels	116 290	11 547	13 216
Total des actions				671 017	934 139
OPTIONS					
Options achetées (se reporter au tableau des options achetées)				229	41
Total des options				229	41
FONDS/BILLETS NÉGOCIÉS EN BOURSE					
FINB Obligations de marchés émergents Mackenzie (couvert en \$ CA)	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	73 687	7 219	7 071
FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	208 200	21 017	19 974
FNB de revenu à taux variable Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	601 498	11 253	11 182
FNB de revenu fixe à rendement élevé mondial Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	585 300	11 992	11 305
FINB Obligations américaines à rendement élevé Mackenzie (couvert en \$ CA)	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	88 140	7 973	8 033
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	66 818	6 865	7 232
Total des fonds/billets négociés en bourse				66 319	64 797
FONDS COMMUNS DE PLACEMENT					
Fonds international de dividendes Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	558 892	5 605	8 280
Fonds de revenu fixe sans contraintes Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	167 944	1 662	1 686
Total des fonds communs de placement				7 267	9 966
Coûts de transaction				(1 034)	–
Total des placements				1 308 241	1 583 933
Instruments dérivés					
(se reporter au tableau des instruments dérivés)					
					(988)
Obligation pour options vendues (se reporter au tableau des options vendues)					(3)
Trésorerie et équivalents de trésorerie					144 709
Autres éléments d'actif moins le passif					3 498
Total de l'actif net					1 731 149

* Liée à Mackenzie. Voir note 1.



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

APERÇU DU PORTEFEUILLE

30 septembre 2020	
Répartition du portefeuille	% de la VL
Actions	54,1
Obligations	39,9
<i>Obligations</i>	<i>33,2</i>
<i>Positions acheteur sur contrats à terme</i>	<i>6,7</i>
<i>Positions vendeur sur contrats à terme</i>	<i>(0,0)</i>
Fonds/billets négociés en bourse	3,7
Trésorerie et placements à court terme	1,7
Fonds communs de placement	0,6
Options sur devises achetées	0,0
Options sur devises vendues	(0,0)

Répartition régionale	% de la VL
États-Unis	44,5
Autre	9,7
Canada	9,3
Chine	5,5
Allemagne	3,8
Suisse	3,7
Royaume-Uni	3,7
Japon	3,6
Australie	3,0
France	2,9
Pays-Bas	2,4
Mexique	2,1
Trésorerie et placements à court terme	1,7
Irlande	1,6
Taiwan	1,3
Hong Kong	1,2

Répartition sectorielle	% de la VL
Obligations d'État étrangères	26,8
Technologie de l'information	11,6
Obligations de sociétés	10,7
Services financiers	9,1
Consommation courante	7,9
Produits industriels	7,4
Soins de santé	6,6
Matières	4,9
Consommation discrétionnaire	4,2
Fonds/billets négociés en bourse	3,7
Prêts à terme	2,2
Autre	2,1
Trésorerie et placements à court terme	1,7
Services de communication	1,1

31 mars 2020	
Répartition du portefeuille	% de la VL
Actions	49,8
Obligations	49,6
<i>Obligations</i>	<i>44,7</i>
<i>Positions acheteur sur contrats à terme</i>	<i>4,8</i>
<i>Positions vendeur sur contrats à terme</i>	<i>0,1</i>
Fonds/billets négociés en bourse	2,6
Fonds communs de placement	0,6
Options sur devises achetées	0,1
Autres éléments d'actif (de passif)	(1,0)
Trésorerie et placements à court terme	(1,7)

Répartition régionale	% de la VL
États-Unis	50,1
Canada	10,7
Chine	5,3
Autre	4,7
Autres pays d'Europe	4,4
Allemagne	3,8
Royaume-Uni	3,7
Suisse	3,7
Autres pays d'Asie	3,4
Japon	3,3
France	2,6
Pays-Bas	2,4
Mexique	1,7
Norvège	1,7
Bermudes	1,2
Autres éléments d'actif (de passif)	(1,0)
Trésorerie et placements à court terme	(1,7)

Répartition sectorielle	% de la VL
Obligations d'État étrangères	33,3
Obligations de sociétés	9,6
Technologie de l'information	9,5
Services financiers	8,4
Consommation courante	7,8
Produits industriels	7,4
Soins de santé	6,8
Matières	4,2
Autre	4,2
Consommation discrétionnaire	3,6
Obligations fédérales	2,7
Prêts à terme	2,6
Fonds/billets négociés en bourse	2,6
Autres éléments d'actif (de passif)	(1,0)
Trésorerie et placements à court terme	(1,7)



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

TABLEAU DES OPTIONS ACHETÉES

Au 30 septembre 2020

Élément sous-jacent	Nombre de contrats	Type d'option	Date d'échéance	Prix d'exercice \$	Prime payée \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
Option d'achat sur devises USD/EUR	1 110 000	Achat	14 octobre 2020	1,20 USD	25	10
Option de vente sur devises JPY/USD	16 200 000	Vente	13 novembre 2020	101,00 JPY	71	31
Option d'achat sur devises SAR/USD	45 940 000	Achat	8 mars 2021	4,00 SAR	133	–
Total des options					229	41

TABLEAU DES OPTIONS VENDUES

Au 30 septembre 2020

Élément sous-jacent	Nombre de contrats	Type d'option	Date d'échéance	Prix d'exercice \$	Prime reçue \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
Option de vente sur devises JPY/USD	(16 200 000)	Option de vente vendue	13 novembre 2020	97,00 JPY	(20)	(3)
Total des options					(20)	(3)



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS

Au 30 septembre 2020

Tableau des contrats à terme standardisés

Nombre de contrats	Type de contrat	Date d'échéance	Prix moyen des contrats (\$)	Montant notionnel* \$ (en milliers)	Profits (pertes) latent(e)s \$ (en milliers)
428	Contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans, décembre 2020	21 décembre 2020	159,47 USD	91 126	256
60	Contrats à terme sur obligations à long terme du Trésor américain, décembre 2020	21 décembre 2020	175,76 USD	14 081	42
Profits latents				105 207	298
(58)	Contrats à terme sur obligations Euro-Buxl à 30 ans, décembre 2020	8 décembre 2020	218,72 EUR	(20 157)	(358)
(38)	Contrats à terme sur euro-obligations, décembre 2020	8 décembre 2020	174,21 EUR	(10 350)	(2)
76	Contrats à terme sur obligations du Trésor australien à 10 ans, décembre 2020	15 décembre 2020	149,51 AUD	10 830	(9)
(Pertes) latentes				(19 677)	(369)
Total des contrats à terme standardisés				85 530	(71)

* Le montant notionnel représente l'exposition aux instruments sous-jacents au 30 septembre 2020.

Tableau des contrats de change à terme

Note de crédit de la contrepartie	Achetés \$ (en milliers)	Vendus \$ (en milliers)	Date de règlement	Coût du contrat \$ (en milliers)	Juste valeur actuelle \$ (en milliers)	Profits latents \$ (en milliers)	
A	39 716	Dollar canadien (29 410)	Dollar américain	2 octobre 2020	(39 716)	(39 155)	561
A	1 180	Dollar américain (1 537)	Dollar canadien	2 octobre 2020	1 537	1 571	34
A	681	Dollar américain (951)	Dollar australien	8 octobre 2020	(907)	(907)	–
A	876	Dollar américain (4 710)	Real brésilien	8 octobre 2020	(1 166)	(1 118)	48
A	8 170	Real brésilien (1 449)	Dollar américain	8 octobre 2020	1 929	1 939	10
A	5 302	Dollar américain (4 806)	Franc suisse	8 octobre 2020	(7 059)	(6 947)	112
A	1 005 000	Peso chilien (1 277)	Dollar américain	8 octobre 2020	1 700	1 705	5
A	55 550	Couronne tchèque (2 405)	Dollar américain	8 octobre 2020	3 202	3 204	2
A	918	Dollar américain (710)	Livre sterling	8 octobre 2020	(1 222)	(1 220)	2
A	1 676	Dollar américain (513 400)	Forint hongrois	8 octobre 2020	(2 231)	(2 204)	27
A	7 173	Dollar américain (527 400)	Roupie indienne	8 octobre 2020	(9 550)	(9 534)	16
A	2 565 000	Won sud-coréen (2 165)	Dollar américain	8 octobre 2020	2 882	2 929	47
A	925	Dollar américain (20 210)	Peso mexicain	8 octobre 2020	(1 232)	(1 215)	17
A	5 180	Dollar américain (45 230)	Couronne norvégienne	8 octobre 2020	(6 896)	(6 455)	441
A	35 870	Couronne norvégienne (3 834)	Dollar américain	8 octobre 2020	5 104	5 119	15
A	4 028	Dollar néo-zélandais (2 663)	Dollar américain	8 octobre 2020	3 545	3 548	3
A	225	Dollar américain (850)	Zloty polonais	8 octobre 2020	(299)	(293)	6
A	9	Dollar américain (700)	Rouble russe	8 octobre 2020	(12)	(12)	–
A	1 314	Dollar américain (102 100)	Rouble russe	8 octobre 2020	(1 750)	(1 748)	2
A	4 277	Dollar américain (37 020)	Couronne suédoise	8 octobre 2020	(5 694)	(5 506)	188
A	3 967	Dollar américain (5 392)	Dollar de Singapour	8 octobre 2020	(5 281)	(5 259)	22
A	15 780	Rand sud-africain (931)	Dollar américain	8 octobre 2020	1 239	1 255	16
A	946	Dollar américain (15 780)	Rand sud-africain	8 octobre 2020	(1 259)	(1 254)	5
A	4 969	Dollar canadien (34 415)	Couronne norvégienne	9 octobre 2020	(4 969)	(4 912)	57
A	4 617	Dollar canadien (3 410)	Dollar américain	9 octobre 2020	(4 617)	(4 540)	77
AA	16 003	Dollar canadien (11 825)	Dollar américain	9 octobre 2020	(16 003)	(15 743)	260
A	123 840	Peso mexicain (7 384)	Dollar canadien	16 octobre 2020	7 384	7 436	52
A	1 796 341	Yen japonais (22 344)	Dollar canadien	21 octobre 2020	22 344	22 684	340



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

Au 30 septembre 2020

Tableau des contrats de change à terme (suite)

Note de crédit de la contrepartie	Achetés \$ (en milliers)		Vendus \$ (en milliers)		Date de règlement	Coût du contrat \$ (en milliers)	Juste valeur actuelle \$ (en milliers)	Profits (pertes) latent(e)s \$ (en milliers)
AA	7 793	Dollar canadien	(5 800)	Dollar américain	23 octobre 2020	(7 793)	(7 724)	69
A	26 437	Dollar canadien	(27 660)	Dollar australien	18 novembre 2020	(26 437)	(26 373)	64
A	4 775	Dollar canadien	(12 267)	Shekel israélien	2 décembre 2020	(4 775)	(4 771)	4
A	19 489	Dollar canadien	(1 540 631)	Yen japonais	17 février 2021	(19 489)	(19 483)	6
Profits latents								2 508
A	2 073	Dollar australien	(1 530)	Dollar américain	8 octobre 2020	2 037	1 977	(60)
A	4 710	Real brésilien	(847)	Dollar américain	8 octobre 2020	1 127	1 118	(9)
A	11 522	Dollar canadien	(8 831)	Dollar américain	8 octobre 2020	(11 521)	(11 757)	(236)
A	6 869	Dollar américain	(9 175)	Dollar canadien	8 octobre 2020	9 174	9 144	(30)
A	17	Franc suisse	(19)	Dollar américain	8 octobre 2020	25	25	–
A	1 080 000	Peso chilien	(1 395)	Dollar américain	8 octobre 2020	1 857	1 832	(25)
A	238	Euro	(285)	Dollar américain	8 octobre 2020	379	371	(8)
A	510	Euro	(598)	Dollar américain	8 octobre 2020	796	796	–
A	176	Livre sterling	(237)	Dollar américain	8 octobre 2020	315	302	(13)
A	24 900	Forint hongrois	(80)	Dollar américain	8 octobre 2020	107	107	–
A	321 300	Roupie indienne	(4 389)	Dollar américain	8 octobre 2020	5 843	5 808	(35)
A	206 100	Roupie indienne	(2 802)	Dollar américain	8 octobre 2020	3 730	3 726	(4)
A	4 311	Dollar américain	(456 700)	Yen japonais	8 octobre 2020	(5 739)	(5 766)	(27)
A	1 337	Dollar américain	(141 100)	Yen japonais	8 octobre 2020	(1 780)	(1 781)	(1)
A	2 161	Dollar américain	(2 565 000)	Won sud-coréen	8 octobre 2020	(2 877)	(2 929)	(52)
A	20 210	Peso mexicain	(933)	Dollar américain	8 octobre 2020	1 242	1 215	(27)
A	2 025	Dollar néo-zélandais	(1 370)	Dollar américain	8 octobre 2020	1 824	1 784	(40)
A	8 120	Zloty polonais	(2 173)	Dollar américain	8 octobre 2020	2 893	2 797	(96)
A	10	Zloty polonais	(3)	Dollar américain	8 octobre 2020	4	4	–
A	303	Dollar américain	(1 170)	Zloty polonais	8 octobre 2020	(403)	(403)	–
A	46 700	Rouble russe	(615)	Dollar américain	8 octobre 2020	819	799	(20)
A	56 100	Rouble russe	(762)	Dollar américain	8 octobre 2020	1 014	961	(53)
A	15 020	Couronne suédoise	(1 678)	Dollar américain	8 octobre 2020	2 234	2 233	(1)
A	729	Dollar américain	(998)	Dollar de Singapour	8 octobre 2020	(971)	(973)	(2)
A	13 434	Dollar de Singapour	(9 841)	Dollar américain	8 octobre 2020	13 102	13 102	–
A	7 563	Dollar canadien	(4 900)	Euro	9 octobre 2020	(7 563)	(7 650)	(87)
A	11 240	Dollar canadien	(188 890)	Peso mexicain	16 octobre 2020	(11 240)	(11 342)	(102)
A	16 691	Dollar canadien	(17 610)	Dollar australien	21 octobre 2020	(16 691)	(16 793)	(102)
AA	7 947	Dollar canadien	(5 160)	Euro	23 octobre 2020	(7 947)	(8 061)	(114)
A	17 910	Dollar canadien	(13 466)	Dollar américain	20 novembre 2020	(17 910)	(17 931)	(21)
AA	6 461	Dollar canadien	(4 890)	Dollar américain	20 novembre 2020	(6 461)	(6 512)	(51)
A	6 960	Dollar canadien	(17 919)	Shekel israélien	2 décembre 2020	(6 960)	(6 968)	(8)
AA	1 231	Dollar canadien	(728)	Livre sterling	10 février 2021	(1 231)	(1 251)	(20)
A	27 428	Dollar canadien	(20 917)	Dollar américain	12 février 2021	(27 428)	(27 841)	(413)
AA	41 929	Dollar canadien	(31 945)	Dollar américain	12 février 2021	(41 929)	(42 519)	(590)
A	77 373	Dollar canadien	(58 727)	Dollar américain	19 février 2021	(77 373)	(78 167)	(794)
AA	13 491	Dollar canadien	(10 241)	Dollar américain	26 février 2021	(13 491)	(13 631)	(140)
A	23 840	Dollar canadien	(18 095)	Dollar américain	26 février 2021	(23 840)	(24 084)	(244)
(Pertes) latentes								(3 425)
Total des contrats de change à terme								(917)
Total des instruments dérivés à la juste valeur								(988)



MACKENZIE
Placements

NOTES ANNEXES

1. Périodes comptables et renseignements généraux

L'information fournie dans les présents états financiers et dans les notes annexes se rapporte aux 30 septembre 2020 et 2019 ou aux semestres clos à ces dates, à l'exception des données comparatives présentées dans les états de la situation financière et les notes annexes, qui se rapportent au 31 mars 2020, selon le cas. Pour l'exercice au cours duquel un fonds ou une série est établi(e) ou rétabli(e), l'information fournie se rapporte à la période commençant à la date d'établissement ou de rétablissement. Se reporter à la note 9 pour la date de constitution du Fonds et la date d'établissement de chacune des séries.

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

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

2. Base d'établissement et mode de présentation

Les présents états financiers intermédiaires non audités (les « états financiers ») ont été préparés conformément aux Normes internationales d'information financière (« IFRS »), y compris la Norme comptable internationale 34 (« IAS »), *Information financière intermédiaire*, telles qu'elles ont été publiées par l'International Accounting Standards Board (l'« IASB »). Ces états financiers ont été préparés selon les mêmes méthodes comptables, les mêmes jugements comptables critiques et les mêmes estimations que ceux qui ont été utilisés pour la préparation des états financiers annuels audités les plus récents du Fonds, soit ceux de l'exercice clos le 31 mars 2020. La note 3 présente un résumé des principales méthodes comptables du Fonds en vertu des IFRS.

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

Les présents états financiers ont été approuvés pour publication par le conseil d'administration de Corporation Financière Mackenzie le 10 novembre 2020.

3. Principales méthodes comptables

a) Instruments financiers

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

Les instruments financiers sont par la suite évalués à la juste valeur par le biais du résultat net, et les variations de la juste valeur sont comptabilisées 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).

Les titres rachetables du Fonds comportent de multiples obligations contractuelles différentes et, par conséquent, satisfont aux critères de classement à titre de passifs financiers conformément à IAS 32, *Instruments financiers : Présentation*. L'obligation du Fonds à l'égard de l'actif net attribuable aux porteurs de titres est présentée au prix de rachat.

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.



NOTES ANNEXES

3. Principales méthodes comptables (suite)

a) Instruments financiers (suite)

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

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

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

b) Évaluation de la juste valeur

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

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

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

La trésorerie et les équivalents de trésorerie, qui incluent les dépôts de trésorerie auprès d'institutions financières et les placements à court terme qui sont facilement convertibles en trésorerie, sont soumis à un risque négligeable de changement de valeur et sont utilisés par le Fonds dans la gestion de ses engagements à court terme. La trésorerie et les équivalents de trésorerie sont présentés à leur juste valeur, qui se rapproche de leur coût amorti en raison de leur nature très liquide et de leurs échéances à court terme. Les découverts bancaires sont présentés dans les passifs courants à titre de dette bancaire dans 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 synthétiques) en guise de couverture contre les pertes occasionnées par des fluctuations des cours des titres, des taux d'intérêt ou des taux de change. Le Fonds peut également avoir recours à des instruments dérivés à des fins autres que de couverture afin d'effectuer indirectement des placements dans des titres ou des marchés financiers, de s'exposer à d'autres devises, de chercher à générer des revenus supplémentaires ou à toute autre fin considérée comme appropriée par le ou les portefeuillistes du Fonds, pourvu que cela soit compatible avec les objectifs de placement du Fonds. Les instruments dérivés doivent être utilisés conformément à la législation canadienne sur les organismes de placement collectif, sous réserve des dispenses accordées au Fonds par les organismes de réglementation, le cas échéant. Pour de plus amples renseignements à cet égard, notamment sur les modalités de telles dispenses, le cas échéant, se reporter à la rubrique « Dispenses de l'application des dispositions du Règlement 81-102 » de la notice annuelle du Fonds.

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

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



NOTES ANNEXES

3. Principales méthodes comptables (suite)

b) Évaluation de la juste valeur (suite)

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

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

Se reporter au tableau des instruments dérivés et au tableau des options achetées/vendues, le cas échéant, compris dans le tableau des placements pour la liste des instruments dérivés et des options au 30 septembre 2020.

c) Comptabilisation des produits

Le revenu d'intérêts provenant des placements productifs d'intérêts est comptabilisé au moyen de la méthode du taux d'intérêt effectif. Les dividendes sont cumulés à compter de la date ex-dividende. Les profits ou pertes réalisé(e)s à la vente de placements, lesquels comprennent les profits ou pertes de change sur ces placements, sont établis selon la méthode du coût moyen. Les distributions reçues d'un fonds sous-jacent sont comprises dans les revenus d'intérêts ou de dividendes, dans le profit (la perte) réalisé(e) à la vente de placements ou dans le revenu provenant des rabais sur les frais, selon le cas.

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

d) Commissions et autres coûts de transaction liés au portefeuille

Les commissions et autres coûts de transaction liés au portefeuille sont des charges engagées en vue d'acquérir, d'émettre ou de céder des actifs ou des passifs financiers. Ils comprennent les honoraires et les commissions versés aux agents, aux conseillers et aux courtiers. Des commissions peuvent être versées à des sociétés de courtage qui offrent certains services (ou les paient), outre l'exécution des ordres, y compris la recherche, l'analyse et les rapports sur les placements, et les bases de données et les logiciels à l'appui de ces services. Le cas échéant et lorsqu'elle est vérifiable, la valeur des services fournis par des tiers qui ont été payés par les courtiers au cours des périodes est présentée à la note 9. La valeur de certains services exclusifs fournis par des courtiers ne peut être estimée raisonnablement.

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

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

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

La note 9 résume les détails relatifs aux titres prêtés et aux biens reçus en garantie, et présente un rapprochement des revenus de prêt de titres, le cas échéant.

f) Compensation

Les actifs et les passifs financiers sont compensés et le solde net est comptabilisé dans l'état de la situation financière seulement si le FNB a un droit exécutoire de compenser les montants comptabilisés et qu'il a l'intention soit de régler le montant net, soit de réaliser l'actif et de régler le passif simultanément. Dans le cours normal des activités, le Fonds conclut diverses conventions-cadres de compensation ou ententes similaires qui ne satisfont pas aux critères de compensation dans l'état de la situation financière, mais qui permettent tout de même de déduire les montants dans certaines circonstances, comme une faillite ou une résiliation de contrat. La note 9 résume les détails de la compensation, le cas échéant.

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



NOTES ANNEXES

3. Principales méthodes comptables (suite)

g) Devises

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

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

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

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

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

i) Valeur liquidative par titre

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

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

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

k) Fusions

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

4. Estimations et jugements comptables critiques

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

La durée de la pandémie de coronavirus (COVID-19) et son incidence à long terme sur les entreprises et les marchés, de même que l'ampleur des mesures de soutien économique supplémentaires qui pourraient être offertes par certains gouvernements et certaines banques centrales, étaient inconnues au moment de la rédaction du présent rapport. Le gestionnaire a recours au jugement pour évaluer l'incidence de ces événements sur les hypothèses et les estimations utilisées pour présenter les actifs et les passifs dans les états financiers du Fonds au 30 septembre 2020. Cependant, cette incertitude fait en sorte qu'il est impossible d'estimer de façon fiable l'incidence sur les résultats financiers et la situation du Fonds pour les périodes à venir.

Utilisation d'estimations

Juste valeur des titres non cotés sur un marché actif

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

NOTES ANNEXES

4. Estimations et jugements comptables critiques (suite)

Utilisation de jugements

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

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

Monnaie fonctionnelle

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

Entités structurées et entreprises associées

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

5. Impôts sur les bénéfices

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

Les pertes du Fonds ne peuvent être attribuées aux investisseurs et sont conservées par le Fonds pour des exercices futurs. Les pertes autres qu'en capital peuvent être reportées jusqu'à 20 ans afin de réduire le bénéfice imposable et les gains en capital réalisés au cours d'exercices futurs. Les pertes en capital peuvent être reportées prospectivement indéfiniment afin de réduire les gains en capital réalisés au cours d'exercices futurs. Se reporter à la note 9 pour les reports prospectifs de pertes du Fonds.

6. Frais de gestion et frais d'exploitation

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

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

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



NOTES ANNEXES

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

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

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

7. Capital du Fonds

Le capital du Fonds, qui comprend l'actif net attribuable aux porteurs de titres, est réparti entre les différentes séries, lesquelles comportent chacune un nombre illimité de titres. Les titres en circulation du Fonds aux 30 septembre 2020 et 2019 ainsi que les titres qui ont été émis, réinvestis et rachetés au cours de ces périodes sont présentés dans l'état de l'évolution de la situation financière. Mackenzie gère le capital du Fonds conformément aux objectifs de placement décrits à la note 9.

8. Risques découlant des instruments financiers

i. Exposition au risque et gestion du risque

Les activités de placement du Fonds l'exposent à divers risques financiers, tels qu'ils sont définis dans IFRS 7, *Instruments financiers : Informations à fournir* (« IFRS 7 »). L'exposition du Fonds aux risques financiers est concentrée dans ses placements, lesquels sont présentés dans le tableau des placements au 30 septembre 2020, 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 90 % de son actif dans des placements liquides (c.-à-d. des placements pouvant être facilement vendus).

iii. Risque de change

Le risque de change est le risque que la juste valeur des instruments financiers libellés en monnaie autre que le dollar canadien, qui est la monnaie de présentation du Fonds, fluctue en raison de variations des taux de change. La note 9 résume l'exposition du Fonds au risque de change, si une telle exposition s'applique et est considérable.

iv. Risque de taux d'intérêt

Le risque de taux d'intérêt est le risque que la juste valeur des instruments financiers portant intérêt fluctue en fonction des variations des taux d'intérêt du marché en vigueur. La trésorerie et les équivalents de trésorerie n'exposent pas le Fonds à des niveaux élevés de risque de taux d'intérêt. La note 9 résume l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt, si une telle exposition s'applique et est considérable.



NOTES ANNEXES

8. Risques découlant des instruments financiers (suite)

v. Autre risque de prix

L'autre risque de prix est le risque que la valeur des instruments financiers fluctue en fonction des variations des cours du marché (autres que celles découlant du risque de taux d'intérêt ou du risque de change), que ces variations découlent de facteurs propres à un placement individuel ou à son émetteur, ou d'autres facteurs ayant une incidence sur tous les instruments négociés sur un marché ou un segment du marché. Tous les placements présentent un risque de perte en capital. Ce risque est géré grâce à une sélection minutieuse de placements et d'autres instruments financiers conformes aux stratégies de placement. À l'exception de certains contrats dérivés, le risque maximal découlant des instruments financiers équivaut à leur juste valeur. Le risque maximal de perte sur certains contrats dérivés, comme des contrats à terme, des swaps ou des contrats à terme standardisés équivaut à leurs 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, 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. La note 9 résume l'exposition du Fonds à l'autre risque de prix, si une telle exposition s'applique et est considérable.

vi. Risque de crédit

Le risque de crédit est le risque qu'une contrepartie à un instrument financier ne s'acquitte pas d'une obligation ou d'un engagement pris envers le Fonds. La note 9 résume l'exposition du Fonds au risque de crédit, si une telle exposition s'applique et est considérable.

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

La valeur comptable des placements et des autres actifs représente l'exposition maximale au risque de crédit à la date de l'état de la situation financière.

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

vii. Fonds sous-jacents

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



NOTES ANNEXES

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

a) Constitution du Fonds et renseignements sur les séries

Date de constitution 29 septembre 2006

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

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

Les titres des séries A, T5 et T8 sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$ (5 000 \$ pour les séries T5 et T8). Les investisseurs des séries A et T5 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année, et les investisseurs de série T8 désirent recevoir un flux de revenu mensuel de 8 % par année.

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

Les titres de série D sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$ par l'entremise d'un compte de courtage à escompte ou de tout autre compte approuvé par Mackenzie. Les investisseurs de série D désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année.

Les titres des séries F et F8 sont offerts aux investisseurs qui participent à un programme de services rémunérés à l'acte ou de comptes intégrés parrainé par le courtier, qui sont assujettis à des frais établis en fonction de l'actif plutôt qu'à des commissions pour chaque opération et qui investissent un minimum de 500 \$ (5 000 \$ pour la série F8); ils sont également proposés aux employés de Mackenzie et de ses filiales, et aux administrateurs de Mackenzie. Les investisseurs des séries F et F8 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % ou de 8 % par année, respectivement.

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 investisseurs de série FB désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année.

Les titres des séries O et O5 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 investisseurs des séries O et O5 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année.

Les titres des séries PW, PWT5 et PWT8 sont offerts à certains investisseurs à valeur nette élevée de nos Solutions Patrimoine privé qui investissent un minimum de 100 000 \$. Les investisseurs des séries PW et PWT5 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année. Les investisseurs de série PWT8 désirent recevoir un flux de revenu mensuel de 8 % par année.

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

Les titres de série PWR sont offerts à certains investisseurs à valeur nette élevée de nos Solutions Patrimoine privé qui investissent un minimum de 100 000 \$ dans un régime enregistré d'épargne-invalidité offert par Mackenzie.

Les titres des séries PWX et PWX8 sont offerts à certains investisseurs à valeur nette élevée de nos Solutions Patrimoine privé qui investissent un minimum de 100 000 \$. Les investisseurs doivent négocier leurs honoraires de service du conseiller, lesquels ne peuvent dépasser 1,50 %, avec leur conseiller financier. Les investisseurs des séries PWX et PWX8 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % ou de 8 % par année, respectivement.

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.

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

Les titres de série I ne sont plus offerts à la vente.

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



FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

NOTES ANNEXES

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

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

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

Série	Date d'établissement/ de rétablissement	Frais de gestion	Frais d'administration	Valeur liquidative par titre (\$)	
				30 sept. 2020	31 mars 2020
Série A	31 mars 2008	1,85 %	0,24 %	15,15	13,86
Série AR	19 novembre 2014	1,85 %	0,27 %	13,58	12,16
Série B	24 novembre 2006	1,85 %	0,24 %	22,28	19,96
Série D	19 mars 2014	1,10 %	0,16 %	16,13	14,69
Série F	23 octobre 2006	0,70 %	0,15 %	14,56	13,23
Série F8	1 ^{er} juin 2018	0,70 %	0,15 %	14,71	13,57
Série FB	26 octobre 2015	0,85 %	0,24 %	11,26	10,24
Série G	25 novembre 2016	1,35 %	0,24 %	12,05	10,79
Série I	24 novembre 2006	1,25 %	0,24 %	14,49	12,96
Série OJ	25 novembre 2016	1,70 %	0,20 %	12,10	10,84
Série O	24 novembre 2006	— ¹⁾	—*	15,99	14,45
Série O5	12 janvier 2016	— ¹⁾	—*	15,93	14,40
Série PW	30 octobre 2013	1,70 %	0,15 %	12,82	11,71
Série PWFB	3 avril 2017	0,70 %	0,15 %	10,50	9,53
Série PWR	1 ^{er} avril 2019	1,70 %	0,15 %	11,06	9,90
Série PWT5	3 avril 2017	1,70 %	0,15 %	14,94	13,65
Série PWT8	16 décembre 2013	1,70 %	0,15 %	13,21	12,26
Série PWX	30 juin 2014	— ²⁾	— ²⁾	16,96	15,34
Série PWX8	10 février 2015	— ²⁾	— ²⁾	13,75	12,62
Série S	31 octobre 2017 ³⁾	— ¹⁾	0,025 %	11,31	10,08
Série T5	23 octobre 2006	1,85 %	0,24 %	12,78	11,70
Série T8	24 octobre 2018	1,85 %	0,24 %	15,43	14,34

* Sans objet.

1) Ces frais sont négociables et sont payables directement à Mackenzie par les investisseurs dans cette série.

2) Ces frais sont payables directement à Mackenzie par les investisseurs dans cette série par l'entremise du rachat de leurs titres.

3) La date d'établissement initiale de la série est le 25 novembre 2016. Tous les titres de la série ont été rachetés le 24 octobre 2017. La série a été rétablie à un prix de 10,00 \$ le titre le 31 octobre 2017.

b) Placements détenus par Mackenzie et des sociétés affiliées

Au 30 septembre 2020, Mackenzie et des fonds distincts gérés par La Compagnie d'Assurance du Canada sur la Vie détenaient un placement de 1 057 \$ et 1 \$ (933 \$ et 1 \$ au 31 mars 2020), respectivement, dans le Fonds.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

NOTES ANNEXES

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

c) Reports prospectifs de pertes

À la fin de la dernière année d'imposition, le Fonds avait des pertes en capital de 1 657 \$ qui peuvent être reportées prospectivement indéfiniment afin de réduire les gains en capital réalisés au cours d'exercices futurs. Aucune perte autre qu'en capital n'était disponible pour un report prospectif aux fins de l'impôt.

d) Prêt de titres

Au 30 septembre 2020 et au 31 mars 2020, la valeur des titres prêtés et des biens reçus en garantie s'établissait comme suit :

	30 septembre 2020	31 mars 2020
	(\$)	(\$)
Valeur des titres prêtés	82 990	22 478
Valeur des biens reçus en garantie	87 297	23 869

Les biens reçus en garantie se composent de titres de créance du gouvernement du Canada et d'autres pays, d'administrations municipales, de gouvernements provinciaux et d'institutions financières du Canada.

Le rapprochement du montant brut provenant des opérations de prêts de titres avec les revenus de prêts de titres du Fonds pour les périodes closes les 30 septembre 2020 et 2019 est présenté ci-après :

	2020		2019	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
Revenus de prêts de titres bruts	57	100,0	177	100,0
Impôt retenu à la source	–	–	–	–
	57	100,0	177	100,0
Paiements à l'agent de prêt de titres	(10)	(17,5)	(44)	(24,9)
Revenu tiré du prêt de titres	47	82,5	133	75,1

e) Commissions

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

	(\$)
30 septembre 2020	70
30 septembre 2019	47

f) Placements donnés en garantie

Au 30 septembre 2020, aucun bon du Trésor du gouvernement du Canada (500 \$ au 31 mars 2020) n'avait été donné en garantie en contrepartie de contrats à terme standardisés.



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

NOTES ANNEXES

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

g) Fusion de fonds

Lors d'une assemblée qui s'est tenue le 25 juillet 2019, les investisseurs du Fonds de revenu stratégique américain Mackenzie (le « Fonds dissous ») ont approuvé la fusion du Fonds dissous avec le Fonds. La fusion a été réalisée à la fermeture des bureaux le 16 août 2019 en échangeant l'actif net du Fonds dissous pour des titres du Fonds à la juste valeur de marché. Les porteurs de titres des séries A, AR, D, F, F8, FB, O, PW, PWFB, PWR, PWT8, PWX, PWX8 et T8 du Fonds dissous ont reçu 34 titres de série A, 4 titres de série AR, 0,1 titre de série D, 13 titres de série F, 0,1 titre de série F8, 0,1 titre de série FB, 0,1 titre de série O, 26 titres de série PW, 0,1 titre de série PWFB, 4 titres de série PWR, 0,1 titre de série PWT8, 0,1 titre de série PWX, 0,1 titre de série PWX8 et 2 titres de série T8, respectivement, du Fonds en échange d'un actif net de 1 137 \$, ce qui correspondait à la juste valeur au 16 août 2019. La fusion a été comptabilisée comme une acquisition du Fonds dissous.

Par suite de la fusion, le Fonds dissous a été fermé. Les charges engagées dans le cadre de la fusion ont été acquittées par Mackenzie.

h) Compensation d'actifs et de passifs financiers

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

	30 septembre 2020			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	1 136	(1 059)	–	77
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(2 220)	1 059	3 585	2 424
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	(1 084)	–	3 585	2 501

	31 mars 2020			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	4 871	(2 500)	–	2 371
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(13 169)	2 500	3 257	(7 412)
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	(8 298)	–	3 257	(5 041)

i) Risques découlant des instruments financiers

i. Exposition au risque et gestion du risque

Le Fonds vise une croissance du capital à long terme assortie d'un revenu en investissant principalement dans des titres à revenu fixe et/ou des titres de participation axés sur le revenu émis partout dans le monde. Selon la conjoncture économique et les évaluations relatives des portefeuilles du Fonds, ce dernier investira généralement de 30 % à 70 % de son actif dans des titres de participation et dans des titres à revenu fixe, mais il peut investir jusqu'à 100 % de son actif dans l'une ou l'autre de ces catégories d'actifs.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

NOTES ANNEXES

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

i) Risques découlant des instruments financiers (suite)

ii. Risque de change

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

Devise	30 septembre 2020			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)
Dollar américain	750 135	20 811	(240 593)	530 353
Euro	184 858	330	(13 432)	171 756
Yen japonais	62 582	–	14 211	76 793
Yuan chinois	72 813	876	–	73 689
Franc suisse	63 404	1 052	(6 922)	57 534
Livre sterling	46 454	(12)	(2 169)	44 273
Dollar de Hong Kong	33 837	–	–	33 837
Dollar taïwanais	22 833	–	–	22 833
Peso mexicain	25 394	–	(3 906)	21 488
Couronne danoise	18 339	–	–	18 339
Rouble russe	14 203	–	–	14 203
Couronne suédoise	15 155	–	(3 273)	11 882
Real brésilien	7 108	–	1 939	9 047
Dollar de Singapour	–	–	6 870	6 870
Roupie indienne	6 090	–	–	6 090
Rand sud-africain	5 575	–	1	5 576
Dollar néo-zélandais	–	–	5 332	5 332
Peso chilien	–	–	3 537	3 537
Couronne tchèque	–	–	3 204	3 204
Zloty polonais	–	–	2 105	2 105
Dollar australien	43 732	2	(42 105)	1 629
Shekel israélien	11 726	–	(11 739)	(13)
Couronne norvégienne	4 924	–	(6 248)	(1 324)
Forint hongrois	–	–	(2 097)	(2 097)
Riyal saoudien	–	–	(61 162)	(61 162)
Total	1 389 162	23 059	(356 447)	1 055 774
% de l'actif net	80,2	1,3	(20,6)	60,9



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

NOTES ANNEXES

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

- i) Risques découlant des instruments financiers (suite)
 ii. Risque de change (suite)

Devise	31 mars 2020			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)
Dollar américain	758 623	3 314	(242 988)	518 949
Euro	160 876	780	(28 136)	133 520
Franc suisse	55 736	337	57 155	113 228
Yen japonais	48 783	5 220	23 647	77 650
Yuan chinois	59 200	–	–	59 200
Livre sterling	40 450	834	(1 411)	39 873
Dollar de Hong Kong	27 421	(323)	–	27 098
Dollar taiwanais	12 132	–	8 365	20 497
Won sud-coréen	–	–	19 702	19 702
Couronne danoise	16 692	186	–	16 878
Couronne suédoise	8 860	2 416	716	11 992
Roupie indienne	5 403	–	5 517	10 920
Dollar australien	8 253	25	(212)	8 066
Rouble russe	6 349	–	891	7 240
Nouveau sol péruvien	–	–	5 051	5 051
Real brésilien	3 701	–	–	3 701
Peso colombien	–	–	1 702	1 702
Forint hongrois	–	–	1 606	1 606
Peso chilien	759	–	(1)	758
Rupiah indonésienne	–	34	–	34
Livre turque	–	–	(1)	(1)
Shekel israélien	11 972	–	(12 085)	(113)
Peso mexicain	20 757	20	(21 766)	(989)
Rand sud-africain	–	(1 523)	–	(1 523)
Dollar néo-zélandais	8 221	–	(12 078)	(3 857)
Livre égyptienne	–	–	(5 278)	(5 278)
Couronne norvégienne	24 107	(1 119)	(32 979)	(9 991)
Peso philippin	–	–	(48 638)	(48 638)
Zloty polonais	–	–	(50 339)	(50 339)
Riyal saoudien	–	–	(64 766)	(64 766)
Total	1 278 295	10 201	(396 326)	892 170
% de l'actif net	87,7	0,7	(27,2)	61,2

* Comprend les instruments financiers monétaires et non monétaires.



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

NOTES ANNEXES

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

i) Risques découlant des instruments financiers (suite)

ii. Risque de change (suite)

Au 30 septembre 2020, si le dollar canadien avait connu une hausse ou une baisse de 5 % relativement à toutes les devises, toute autre variable demeurant constante, l'actif net aurait diminué ou augmenté d'environ 52 789 \$ ou 3,0 % du total de l'actif net (44 609 \$ ou 3,1 % au 31 mars 2020). En pratique, les résultats réels de négociation peuvent différer et l'écart pourrait être important.

iii. Risque de taux d'intérêt

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

Durée jusqu'à l'échéance	30 septembre 2020 (\$)		31 mars 2020 (\$)	
	Obligations	Instruments dérivés	Obligations	Instruments dérivés
Moins de 1 an	34 698	85 530	37 040	18 639
1 an à 5 ans	85 099	—	126 125	—
5 ans à 10 ans	307 059	—	350 220	—
Plus de 10 ans	148 134	—	138 221	—
Total	574 990	85 530	651 606	18 639

Au 30 septembre 2020, si les taux d'intérêt en vigueur avaient connu une hausse ou une baisse de 1 %, la courbe des taux évoluant en parallèle et toute autre variable demeurant constante, l'actif net aurait diminué ou augmenté d'environ 54 361 \$ ou 3,1 % du total de l'actif net (52 166 \$ ou 3,6 % au 31 mars 2020). 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 54 361 \$ ou 3,1 % du total de l'actif net (52 166 \$ ou 3,6 % au 31 mars 2020). En pratique, les résultats réels de négociation peuvent différer et l'écart pourrait être important.

iv. Autre risque de prix

Pour ce Fonds, le risque le plus important découlant du risque de prix provient de ses placements dans des titres de participation, des fonds/billets négociés en bourse et des fonds communs de placement. Au 30 septembre 2020, si les cours des Bourses où se négocient ces titres avaient augmenté ou diminué de 10 %, toute autre variable demeurant constante, l'actif net aurait augmenté ou diminué d'environ 100 890 \$ ou 5,8 % du total de l'actif net (77 254 \$ ou 5,3 % au 31 mars 2020). En pratique, les résultats réels de négociation peuvent différer et l'écart pourrait être important.

v. Risque de crédit

Pour ce Fonds, la plus forte concentration du risque de crédit se trouve dans les titres de créance, tels que les obligations. La juste valeur des titres de créance tient compte de la solvabilité de l'émetteur de ces titres. L'exposition maximale à tout émetteur de titres de créance au 30 septembre 2020 était de 6,2 % de l'actif net du Fonds (18,0 % au 31 mars 2020).

Au 30 septembre 2020 et au 31 mars 2020, les titres de créance par note de crédit étaient les suivants :

Note des obligations*	30 septembre 2020	31 mars 2020
	% de l'actif net	% de l'actif net
AAA	3,6	3,0
AA	8,5	21,5
A	6,5	7,9
BBB	7,7	6,4
Inférieure à BBB	5,3	4,8
Sans note	1,6	1,1
Total	33,2	44,7

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



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

NOTES ANNEXES

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

j) Classement de la juste valeur

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

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

Niveau 2 – Données autres que les prix cotés qui sont observables pour l'actif ou le passif, soit directement, soit indirectement;

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

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

	30 septembre 2020				31 mars 2020			
	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	–	574 990	–	574 990	–	651 606	–	651 606
Actions	501 102	433 037	–	934 139	372 229	353 507	–	725 736
Options	–	41	–	41	–	1 852	–	1 852
Fonds/billets négociés en bourse	64 797	–	–	64 797	38 392	–	–	38 392
Fonds communs de placement	9 966	–	–	9 966	8 409	–	–	8 409
Actifs dérivés	298	2 508	–	2 806	2 422	14 058	–	16 480
Passifs dérivés	(369)	(3 428)	–	(3 797)	(51)	(31 335)	–	(31 386)
Placements à court terme	–	124 214	–	124 214	–	29 712	–	29 712
Total	575 794	1 131 362	–	1 707 156	421 401	1 019 400	–	1 440 801

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

Conformément à la politique d'évaluation du Fonds, ce dernier applique des facteurs de rajustement à la juste valeur aux prix cotés pour les actions autres que nord-américaines lorsque les variations boursières intrajournalières nord-américaines dépassent les seuils de tolérance prédéterminés. Les facteurs de rajustement sont appliqués afin d'estimer l'incidence sur la juste valeur d'événements ayant lieu entre la clôture des marchés autres que nord-américains et la clôture pour le Fonds. Si des facteurs de rajustement de la juste valeur sont appliqués, les actions autres que nord-américaines sont classées dans le niveau 2. De ce fait, au cours de la période close le 30 septembre 2020, les actions autres que nord-américaines étaient fréquemment transférées entre le niveau 1 (prix non rajustés cotés) et le niveau 2 (prix rajustés). Au 30 septembre 2020, ces titres étaient classés dans le niveau 2 (niveau 2 au 31 mars 2020).

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.



MACKENZIE
Placements