

## **États financiers intermédiaires non audités**

*Pour la période de six mois close le 30 septembre 2022*

*Les présents états financiers intermédiaires non audités ne contiennent pas le rapport intermédiaire de la direction sur le rendement du Fonds (« RDRF ») du fonds d'investissement. 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](http://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 d'investissement.*

### **AVIS DE NON-AUDIT DES ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES**

*Corporation Financière Mackenzie, le gestionnaire du Fonds de revenu stratégique mondial en dollars US Mackenzie (le « Fonds »), nomme des auditeurs indépendants pour auditer les états financiers annuels du Fonds. Conformément aux lois sur les valeurs mobilières du Canada (Règlement 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 EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

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

	30 sept. 2022 \$	31 mars 2022 (Audité) \$
<b>ACTIF</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements à la juste valeur	79 048	98 756
Trésorerie et équivalents de trésorerie	2 201	7 733
Intérêts courus à recevoir	214	201
Dividendes à recevoir	86	81
Sommes à recevoir pour placements vendus	229	487
Sommes à recevoir pour titres émis	135	118
Marge sur instruments dérivés	827	857
Actifs dérivés	1 156	676
<b>Total de l'actif</b>	<b>83 896</b>	<b>108 909</b>
<b>PASSIF</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Sommes à payer pour placements achetés	250	110
Sommes à payer pour titres rachetés	261	7
Sommes à payer au gestionnaire	9	18
Passifs dérivés	95	458
<b>Total du passif</b>	<b>615</b>	<b>593</b>
<b>Actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>83 281</b>	<b>108 316</b>

## ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

Pour les périodes closes les 30 septembre  
(en milliers de \$ US, sauf les montants par titre)

	2022 \$	2021 \$
<b>Revenus</b>		
Dividendes	829	596
Revenu d'intérêts	1 045	627
Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets		
Profit (perte) net(te) réalisé(e)	28	2 965
Profit (perte) net(te) latent(e)	(16 272)	(776)
Revenu tiré du prêt de titres	3	2
Revenu provenant des rabais sur les frais	4	5
<b>Total des revenus (pertes)</b>	<b>(14 363)</b>	<b>3 419</b>
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	690	681
Rabais sur les frais de gestion	(1)	(1)
Frais d'administration	85	84
Intérêts débiteurs	1	1
Commissions et autres coûts de transaction liés au portefeuille	20	28
Frais du comité d'examen indépendant	–	–
<b>Charges avant les montants absorbés par le gestionnaire</b>	<b>795</b>	<b>793</b>
Charges absorbées par le gestionnaire	–	–
<b>Charges nettes</b>	<b>795</b>	<b>793</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, avant impôt</b>	<b>(15 158)</b>	<b>2 626</b>
Charge (économie) d'impôt étranger retenu à la source	84	71
Impôt étranger sur le résultat payé (recouvré)	(7)	17
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation</b>	<b>(15 235)</b>	<b>2 538</b>

### Actif net attribuable aux porteurs de titres (note 3)

	par titre		par série	
	30 sept. 2022	31 mars 2022 (Audité)	30 sept. 2022	31 mars 2022 (Audité)
Série A	8,26	10,01	9 830	12 662
Série D	8,37	10,09	137	148
Série F	8,86	10,66	29 230	39 748
Série F8	11,43	14,00	49	58
Série FB	9,05	10,91	44	51
Série PW	8,38	10,15	37 535	48 086
Série PWFB	8,83	10,63	2 632	3 016
Série PWT8	10,37	12,78	1 521	1 849
Série PWX	9,40	11,26	1 741	2 003
Série PWX8	12,80	15,61	1	1
Série T8	8,95	11,05	561	694
			<b>83 281</b>	<b>108 316</b>

### Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation (note 3)

	par titre		par série	
	2022	2021	2022	2021
Série A	(1,47)	0,25	(1 805)	265
Série D	(1,44)	0,08	(23)	–
Série F	(1,44)	0,35	(5 366)	1 126
Série F8	(1,98)	(0,36)	(8)	(2)
Série FB	(1,57)	0,26	(6)	1
Série PW	(1,52)	0,24	(6 930)	897
Série PWFB	(1,52)	0,36	(442)	80
Série PWT8	(1,87)	0,44	(270)	60
Série PWX	(1,56)	0,45	(284)	91
Série PWX8	(2,15)	0,65	–	–
Série T8	(1,64)	0,33	(101)	20
			<b>(15 235)</b>	<b>2 538</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE LA SITUATION FINANCIÈRE

Pour les périodes closes les 30 septembre  
(en milliers de \$ US, sauf les montants par titre)

	Total		Série A		Série D		Série F		Série F8	
	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	<b>108 316</b>	<b>84 393</b>	<b>12 662</b>	<b>9 738</b>	<b>148</b>	<b>23</b>	<b>39 748</b>	<b>32 515</b>	<b>58</b>	<b>4</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(15 235)	2 538	(1 805)	265	(23)	–	(5 366)	1 126	(8)	(2)
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(1 033)	(449)	(71)	(29)	(2)	–	(524)	(242)	(1)	–
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(1 801)	(1 961)	(252)	(255)	(2)	(1)	(516)	(646)	(2)	–
Rabais sur les frais de gestion	(1)	(1)	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>Total des distributions aux porteurs de titres</b>	<b>(2 835)</b>	<b>(2 411)</b>	<b>(323)</b>	<b>(284)</b>	<b>(4)</b>	<b>(1)</b>	<b>(1 040)</b>	<b>(888)</b>	<b>(3)</b>	<b>–</b>
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	7 455	30 118	1 484	9 690	12	29	3 176	6 931	–	56
Réinvestissement des distributions	2 191	1 921	280	252	4	–	721	645	2	–
Paiements au rachat de titres	(16 611)	(12 885)	(2 468)	(7 261)	–	–	(8 009)	(2 476)	–	–
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>(6 965)</b>	<b>19 154</b>	<b>(704)</b>	<b>2 681</b>	<b>16</b>	<b>29</b>	<b>(4 112)</b>	<b>5 100</b>	<b>2</b>	<b>56</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>(25 035)</b>	<b>19 281</b>	<b>(2 832)</b>	<b>2 662</b>	<b>(11)</b>	<b>28</b>	<b>(10 518)</b>	<b>5 338</b>	<b>(9)</b>	<b>54</b>
<b>À la clôture</b>	<b>83 281</b>	<b>103 674</b>	<b>9 830</b>	<b>12 400</b>	<b>137</b>	<b>51</b>	<b>29 230</b>	<b>37 853</b>	<b>49</b>	<b>58</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) :</b>										
<b>Titres en circulation, à l'ouverture</b>			<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>
Émis			1 265	927	15	2	3 730	2 947	4	–
Réinvestissement des distributions			162	899	1	3	324	608	–	4
Rachetés			31	23	–	–	75	57	–	–
Rachetés			(268)	(672)	–	–	(828)	(217)	–	–
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>			<b>1 190</b>	<b>1 177</b>	<b>16</b>	<b>5</b>	<b>3 301</b>	<b>3 395</b>	<b>4</b>	<b>4</b>

	Série FB		Série PW		Série PWFB		Série PWT8		Série PWX	
	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	<b>51</b>	<b>18</b>	<b>48 086</b>	<b>34 940</b>	<b>3 016</b>	<b>2 111</b>	<b>1 849</b>	<b>2 049</b>	<b>2 003</b>	<b>2 277</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(6)	1	(6 930)	897	(442)	80	(270)	60	(284)	91
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(1)	–	(334)	(131)	(41)	(16)	(13)	(6)	(37)	(23)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(1)	(1)	(884)	(879)	(40)	(45)	(66)	(70)	(17)	(36)
Rabais sur les frais de gestion	–	–	(1)	(1)	–	–	–	–	–	–
<b>Total des distributions aux porteurs de titres</b>	<b>(2)</b>	<b>(1)</b>	<b>(1 219)</b>	<b>(1 011)</b>	<b>(81)</b>	<b>(61)</b>	<b>(79)</b>	<b>(76)</b>	<b>(54)</b>	<b>(59)</b>
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	–	33	2 624	12 448	74	793	26	–	56	126
Réinvestissement des distributions	1	1	1 015	873	81	61	32	28	43	49
Paiements au rachat de titres	–	–	(6 041)	(2 407)	(16)	(488)	(37)	(216)	(23)	(37)
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>1</b>	<b>34</b>	<b>(2 402)</b>	<b>10 914</b>	<b>139</b>	<b>366</b>	<b>21</b>	<b>(188)</b>	<b>76</b>	<b>138</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>(7)</b>	<b>34</b>	<b>(10 551)</b>	<b>10 800</b>	<b>(384)</b>	<b>385</b>	<b>(328)</b>	<b>(204)</b>	<b>(262)</b>	<b>170</b>
<b>À la clôture</b>	<b>44</b>	<b>52</b>	<b>37 535</b>	<b>45 740</b>	<b>2 632</b>	<b>2 496</b>	<b>1 521</b>	<b>1 845</b>	<b>1 741</b>	<b>2 447</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) :</b>										
<b>Titres en circulation, à l'ouverture</b>			<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>
Émis	5	2	4 740	3 291	284	192	145	148	178	197
Réinvestissement des distributions	–	3	279	1 139	8	70	2	–	5	11
Rachetés	–	–	111	80	8	5	3	2	4	4
Rachetés	–	–	(653)	(220)	(2)	(43)	(3)	(15)	(2)	(3)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>5</b>	<b>5</b>	<b>4 477</b>	<b>4 290</b>	<b>298</b>	<b>224</b>	<b>147</b>	<b>135</b>	<b>185</b>	<b>209</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

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

Pour les périodes closes les 30 septembre  
(en milliers de \$ US, sauf les montants par titre)

	Série PWX8		Série T8	
	2022	2021	2022	2021
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>				
<b>À l'ouverture</b>	<b>1</b>	<b>1</b>	<b>694</b>	<b>717</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	–	–	(101)	20
Distributions aux porteurs de titres :				
Revenu de placement	–	–	(9)	(2)
Gains en capital	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	(21)	(28)
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–
<b>Total des distributions aux porteurs de titres</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(30)</b>	<b>(30)</b>
Opérations sur les titres :				
Produit de l'émission de titres	–	–	3	12
Réinvestissement des distributions	–	–	12	12
Paievements au rachat de titres	–	–	(17)	–
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(2)</b>	<b>24</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(133)</b>	<b>14</b>
<b>À la clôture</b>	<b>1</b>	<b>1</b>	<b>561</b>	<b>731</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) :</b>	<b>Titres</b>		<b>Titres</b>	
<b>Titres en circulation, à l'ouverture</b>	–	–	<b>63</b>	<b>60</b>
Émis	–	–	–	1
Réinvestissement des distributions	–	–	1	1
Rachetés	–	–	(1)	–
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>63</b>	<b>62</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

Pour les périodes closes les 30 septembre (en milliers de \$ US)

	2022	2021
	\$	\$
<b>Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation	(15 235)	2 538
Ajustements pour :		
Perte (profit) net(te) réalisé(e) sur les placements	1 837	(3 139)
Variation de la perte (du profit) net(te) latent(e) sur les placements	16 272	781
Achat de placements	(21 344)	(51 226)
Produit de la vente et de l'échéance de placements	22 643	28 645
(Augmentation) diminution des sommes à recevoir et autres actifs	12	3
Augmentation (diminution) des sommes à payer et autres passifs	(9)	17
<b>Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités d'exploitation</b>	<b>4 176</b>	<b>(22 381)</b>
<b>Flux de trésorerie liés aux activités de financement</b>		
Produit de l'émission de titres	5 620	21 479
Paievements au rachat de titres	(14 539)	(4 302)
Distributions versées, déduction faite des réinvestissements	(644)	(490)
<b>Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités de financement</b>	<b>(9 563)</b>	<b>16 687</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>	<b>(5 387)</b>	<b>(5 694)</b>
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à l'ouverture	7 733	12 404
Incidence des fluctuations des taux de change sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie	(145)	(9)
<b>Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture</b>	<b>2 201</b>	<b>6 701</b>
Trésorerie	2 201	6 306
Équivalents de trésorerie	–	395
<b>Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture</b>	<b>2 201</b>	<b>6 701</b>
<b>Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :</b>		
Dividendes reçus	824	580
Impôts étrangers payés	77	88
Intérêts reçus	1 032	554
Intérêts versés	1	1

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## TABLEAU DES PLACEMENTS

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N <sup>bre</sup> d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$ US)	Juste valeur (en milliers de \$ US)
<b>OBLIGATIONS</b>					
407 International Inc. 1,80 % 22-05-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	41 000 CAD	31	28
407 International Inc. 4,22 % 14-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	51 000 CAD	39	36
407 International Inc. 3,14 % 06-03-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
407 International Inc. 2,59 % 25-05-2032, rachetables 2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	7	6
407 International Inc. 3,43 % 01-06-2033, série MTN	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	6
407 International Inc. 4,19 % 25-04-2042, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	13 000 CAD	12	9
407 International Inc. 3,60 % 21-05-2047, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	23	18
407 International Inc. 3,67 % 08-03-2049, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	68 000 CAD	44	41
ADS Tactical Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 04-03-2028	États-Unis	Prêts à terme	18 500	18	17
Advantage Sales & Marketing Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 28-10-2027	États-Unis	Prêts à terme	19 650	19	18
Aéroports de Montréal 3,92 % 12-06-2045, rachetables 2044	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 000 CAD	2	2
AES Panama Generation Holdings SRL 4,38 % 31-05-2030, rachetables 2030	Panama	Sociétés – Non convertibles	200 000	200	158
Agile Group Holdings Ltd. 5,75 % 02-01-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000	177	62
Al Aqua Merger Sub Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 30-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	2 222	2	2
AIMCo Realty Investors LP 2,20 % 04-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	39 000 CAD	31	26
Albertsons Cos. Inc. 4,63 % 15-01-2027, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	30 000	29	27
Alcami Carolinas Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 06-07-2025	États-Unis	Prêts à terme	9 600	10	9
Alchemy US Holdco LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-10-2025	États-Unis	Prêts à terme	8 274	8	8
Algonquin Power & Utilities Corp. 2,85 % 15-07-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	33 000 CAD	27	20
Algonquin Power & Utilities Corp., taux variable 18-01-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000 CAD	40	30
Alimentation Couche-Tard inc. 2,95 % 25-01-2030, rachetables 2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	16
Alphabet Inc. 1,90 % 15-08-2040	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	221 000	163	142
Alphabet Inc. 2,05 % 15-08-2050, rachetables 2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	278 000	190	166
AltaGas Ltd. 2,17 % 16-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	17 000 CAD	14	11
AltaGas Ltd., taux variable 11-01-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	32 000 CAD	25	19
AltaGas Ltd., taux variable 17-08-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	8 000 CAD	6	6
AltaLink, L.P. 1,51 % 11-09-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	6
American Tower Corp. 1,88 % 15-10-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	15
Anglian Water Services Financing PLC 4,53 % 26-08-2032	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	35 000 CAD	27	24
AP Core Holdings II LLC, prêt à terme B2 de premier rang, taux variable 21-07-2027	États-Unis	Prêts à terme	29 000	29	27
Apple Inc. 3,35 % 10-01-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	90 000 AUD	66	57
Apple Inc. 2,51 % 19-08-2024, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	350 000 CAD	263	245
Apple Inc. 2,65 % 11-05-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	296 000	223	194
Apple Inc. 2,65 % 08-02-2051	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	200 000	152	132
ARC Resources Ltd. 2,35 % 10-03-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	29 000 CAD	23	19
ARC Resources Ltd. 3,47 % 10-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	24	19
Ascend Wellness Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 27-08-2025	États-Unis	Prêts à terme	18 000	18	16
Ashton Woods USA LLC 4,63 % 01-04-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 000	3	2
AT&T Inc. 5,10 % 25-11-2048, rachetables 2048	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	17 000 CAD	13	11
Athene Global Funding, taux variable 09-04-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	63 000 CAD	50	45
Athene Global Funding 3,13 % 10-03-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	38 000 CAD	30	26
Athene Global Funding 2,10 % 24-09-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	23	20
Bank of America Corp., taux variable 15-09-2027 (taux variable différé)	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	6
Bank of America Corp., taux variable 16-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	48 000 CAD	37	32
Bank of America Corp., taux variable 04-04-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	25 000 CAD	20	16
Banque de Montréal 2,70 % 11-09-2024, série DPNT	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	103 000 CAD	78	74
BCE Inc. 2,20 % 29-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	37 000 CAD	31	23
BCI QuadReal Realty 2,55 % 24-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000 CAD	39	34
bclMC Realty Corp. 1,06 % 12-03-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	16 000 CAD	13	11
bclMC Realty Corp. 1,07 % 04-02-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	23 000 CAD	18	15
bclMC Realty Corp. 1,75 % 24-07-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	15	12

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$ US)	Juste valeur (en milliers de \$ US)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
BCPE Cycle Merger Sub II Inc. 10,63 % 15-07-2027, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	9
Bell Canada Inc. 3,60 % 29-09-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	24	20
BP Capital Markets PLC 3,47 % 15-05-2025	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Broadcast Media Partners Holdings Inc. 4,50 % 01-05-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	7 000	7	6
Brookfield Infrastructure Finance ULC 4,20 % 11-09-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	34 000 CAD	26	23
Brookfield Infrastructure Finance ULC 3,41 % 09-10-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	60 000 CAD	43	39
Brookfield Infrastructure Finance ULC 2,86 % 01-09-2032, rachetables 2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	6
Brookfield Renewable Energy Partners ULC 3,63 % 15-01-2027, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	172 000 CAD	133	118
Brookfield Renewable Partners ULC 4,25 % 15-01-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000 CAD	31	28
Brookfield Renewable Partners ULC 4,29 % 05-11-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	15	12
Brookfield Residential Properties Inc. 5,13 % 15-06-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	9 000 CAD	7	5
Bruce Power L.P. 2,68 % 21-12-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	16	13
Bruce Power L.P. 4,00 % 21-06-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	6 000 CAD	5	4
BWAY Holding Co. 7,25 % 15-04-2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	42 000	41	37
Fiducie du Canada pour l'habitation 1,10 % 15-03-2031	Canada	Gouvernement fédéral	10 000 CAD	8	6
Canadian Core Real Estate LP 3,30 % 02-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	44 000 CAD	35	29
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 21-04-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	55 000 CAD	44	35
Canadian Natural Resources Ltd. 2,50 % 17-01-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	15	13
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 2,54 % 28-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	132 000 CAD	105	85
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 3,15 % 13-03-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	220 000 CAD	188	144
Capital Power Corp. 4,28 % 18-09-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	17	14
Capital Power Corp. 4,42 % 08-02-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	210 000 CAD	187	143
Capital Power Corp. 3,15 % 01-10-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000 CAD	30	23
Capital Power Corp., taux variable 09-09-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	15	14
Cascades inc. 5,13 % 15-01-2026, rachetables 2023 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	9
CCS-CMGC Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 25-09-2025	États-Unis	Prêts à terme	9 650	10	9
Cenovus Energy Inc. 3,50 % 07-02-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000 CAD	38	34
Cenovus Energy Inc. 3,75 % 15-02-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	151 000	119	102
Groupe CGI inc. 2,10 % 18-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	27 000 CAD	21	17
Charter Communications Operating LLC 2,80 % 01-04-2031, rachetables 2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	15
Charter Communications Operating LLC 2,30 % 01-02-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	14
Charter Communications Operating LLC 3,50 % 01-06-2041	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	6
Chevron U.S.A. Inc. 2,34 % 12-08-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	301 000	220	185
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 2,46 % 30-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	29 000 CAD	23	19
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 4,18 % 08-03-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	111 000 CAD	99	76
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 6,00 % 24-06-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	33 000 CAD	25	24
Ville d'Oslo, taux variable 06-05-2026	Norvège	Gouvernements étrangers	2 000 000 NOK	231	182
The Clorox Co. 1,80 % 15-05-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	15 000	15	12
Cogeco Communications inc. 2,99 % 22-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	32 000 CAD	25	19
Cologix Data Centers Issuer LLC 4,94 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	13 000 CAD	10	9
Cologix Data Centers Issuer LLC 5,68 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	10 000 CAD	8	7
Columbia Care Inc. 6,00 % 29-06-2025, conv.	Canada	Sociétés – Convertibles	7 000	7	7
CommScope Technologies Finance LLC 8,25 % 01-03-2027, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	13 000	13	11
Connect Finco SARL 6,75 % 01-10-2026	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	5 000	5	4
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	24 047 CAD	18	16
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-09-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	16 100 CAD	12	11
Corus Entertainment Inc. 5,00 % 11-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	9 000 CAD	7	5

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N <sup>bre</sup> d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$ US)	Juste valeur (en milliers de \$ US)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Covis Finco SARL, prêt à terme B de premier rang, taux variable 14-02-2027	Luxembourg	Prêts à terme	28 638	26	23
CPPIB Capital Inc. 1,95 % 30-09-2029	Canada	Gouvernement fédéral	61 000 CAD	47	39
Creation Technologies Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 24-09-2028	Canada	Prêts à terme	28 928	28	24
Fonds de placement immobilier Crombie 3,92 % 21-06-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 000 CAD	4	3
Fonds de placement immobilier Crombie 3,21 % 09-10-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	210 000 CAD	172	127
Fonds de placement immobilier Crombie 3,13 % 12-08-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	19 000 CAD	15	11
Curaleaf Holdings Inc. 8,00 % 15-12-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	40 000	40	36
République fédérale d'Allemagne, obligations indexées sur l'inflation, 0,10 % 15-04-2046	Allemagne	Gouvernements étrangers	400 000 EUR	721	486
DIRECTV Holdings LLC 5,88 % 15-08-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	6 000	6	5
Dollarama inc. 1,51 % 20-09-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	6
Domtar Corp. 6,75 % 01-10-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	16 000	16	12
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 1,66 % 22-12-2025 (A)	Canada	Sociétés – Non convertibles	239 000 CAD	191	154
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,54 % 07-12-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	24	19
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,06 % 17-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	24 000 CAD	20	15
Easy Tactic Ltd. 6,50 % 11-07-2027	Chine	Sociétés – Non convertibles	210 379	46	32
Electronic Arts Inc. 2,95 % 15-02-2051	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	151 000	112	100
Emera Inc. 2,90 % 16-06-2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000 CAD	30	29
Empire Communities Corp. 7,38 % 15-12-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	6
L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie 3,63 % 17-04-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 000 CAD	2	1
Enbridge Inc. 3,10 % 21-09-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	67 000 CAD	52	39
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	180 000 CAD	145	120
Enbridge Inc., taux variable 12-04-2078, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	80 000 CAD	64	56
Énergir inc. 2,10 % 16-04-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	14	13
Énergir S.E.C. 4,67 % 27-09-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	33 000 CAD	24	24
EPCOR Utilities Inc. 3,55 % 27-11-2047, rachetables 2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	24	18
EPCOR Utilities Inc. 3,11 % 08-07-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	23	16
EPCOR Utilities Inc. 4,73 % 02-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	45 000 CAD	35	32
The Estée Lauder Cos. Inc. 1,95 % 15-03-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	21 000	21	17
Exxon Mobil Corp. 3,10 % 16-08-2049	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	301 000	242	211
Fairfax Financial Holdings Ltd. 8,30 % 15-04-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000	50	43
Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,23 % 14-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Fairfax Financial Holdings Ltd. 3,95 % 03-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	55 000 CAD	44	34
Flynn America LP, prêt à terme B de premier rang, taux variable 23-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	23 550	23	21
Compagnie Crédit Ford du Canada 2,96 % 16-09-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	16	12
Ford Motor Credit Co. LLC 6,78 % 15-09-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	76 000 CAD	58	55
Fortified Trust 3,76 % 23-06-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	71 000 CAD	56	50
Fortified Trust 1,96 % 23-10-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	90 000 CAD	73	58
Fortis Inc. 4,43 % 31-05-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	56 000 CAD	44	39
Foxtrot Escrow Issuer LLC 12,25 % 15-11-2026, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	12 000	12	10
Frontera Generation Holdings LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 28-07-2026	États-Unis	Prêts à terme	935	1	–
Frontera Generation Holdings LLC, prêt à terme de second rang, taux variable 26-04-2028	États-Unis	Prêts à terme	912	1	–
FXI Holdings Inc. 7,88 % 01-11-2024, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	8
GFL Environmental Inc. 3,50 % 01-09-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 000	4	3
Gibson Energy Inc. 2,85 % 14-07-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	15	13
Gibson Energy Inc. 3,60 % 17-09-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	15 000 CAD	11	10
Gibson Energy Inc., taux variable 22-12-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	15 000 CAD	12	9
The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 30-11-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	89 000 CAD	70	58
The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 28-02-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	63 000 CAD	50	39
Gouvernement de l'Argentine 1,00 % 09-07-2029	Argentine	Gouvernements étrangers	2 134	4	–
Gouvernement de l'Argentine 1,00 % 09-07-2029 SEDOL BLN8K52	Argentine	Gouvernements étrangers	392	–	–
Gouvernement de l'Argentine, taux variable 09-07-2035	Argentine	Gouvernements étrangers	590 000	205	109
Gouvernement de l'Argentine 0,13 % 09-07-2035	Argentine	Gouvernements étrangers	10 505	–	2



# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N <sup>bre</sup> d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$ US)	Juste valeur (en milliers de \$ US)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Gouvernement de l'Argentine 0,13 % 09-07-2046	Argentine	Gouvernements étrangers	121 250	117	23
Gouvernement de l'Australie 1,75 % 21-06-2051	Australie	Gouvernements étrangers	900 000 AUD	358	352
Gouvernement des Bahamas 6,95 % 20-11-2029	Bahamas	Gouvernements étrangers	40 000	46	23
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2029	Brésil	Gouvernements étrangers	190 000 BRL	443	325
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2031	Brésil	Gouvernements étrangers	100 000 BRL	234	167
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-08-2024	Canada	Gouvernement fédéral	25 000 CAD	19	18
Gouvernement du Canada 1,25 % 01-03-2027	Canada	Gouvernement fédéral	35 000 CAD	25	23
Gouvernement du Canada 0,50 % 01-12-2030	Canada	Gouvernement fédéral	216 000 CAD	134	126
Gouvernement du Canada 1,50 % 01-06-2031	Canada	Gouvernement fédéral	46 000 CAD	36	29
Gouvernement du Canada 1,50 % 01-12-2031	Canada	Gouvernement fédéral	10 000 CAD	7	6
Gouvernement du Canada 1,75 % 01-12-2053	Canada	Gouvernement fédéral	3 493 000 CAD	2 275	1 855
Gouvernement de l'Allemagne 0 % 15-08-2052	Allemagne	Gouvernements étrangers	1 210 000 EUR	1 038	640
Gouvernement du Mexique 5,75 % 05-03-2026	Mexique	Gouvernements étrangers	2 000 000 MXN	92	87
Gouvernement du Mexique 2,66 % 24-05-2031	Mexique	Gouvernements étrangers	400 000	386	305
Gouvernement du Mexique 7,75 % 29-05-2031	Mexique	Gouvernements étrangers	4 000 000 MXN	226	177
Gouvernement du Mexique 8,00 % 07-11-2047	Mexique	Gouvernements étrangers	8 000 000 MXN	463	336
Fiducie de placement immobilier Granite 2,19 % 30-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	45 000 CAD	36	28
Gray Television Inc. 5,38 % 15-11-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	35 000	35	27
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 2,73 % 03-04-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	220 000 CAD	186	144
Fonds de placement immobilier H&R 3,37 % 30-01-2024, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	17 000 CAD	14	12
Fonds de placement immobilier H&R 2,91 % 02-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Fonds de placement immobilier H&R 2,63 % 19-02-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000 CAD	32	26
Hadrian Merger Sub Inc. 8,50 % 01-05-2026, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	21 000	21	19
HCA Healthcare Inc. 3,50 % 01-09-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	8 000	8	7
Heathrow Funding Ltd. 3,25 % 21-05-2025	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	13 000 CAD	11	9
Heathrow Funding Ltd. 2,69 % 13-10-2027	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	40 000 CAD	32	26
Heathrow Funding Ltd. 3,40 % 08-03-2028	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	60 000 CAD	47	39
Heathrow Funding Ltd. 3,79 % 04-09-2030, rachetables 2030	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	40 000 CAD	31	26
Heathrow Funding Ltd. 3,73 % 13-04-2033	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	31 000 CAD	26	19
Compagnie Home Trust 5,32 % 13-06-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	46 000 CAD	36	33
Honda Canada Finance Inc., taux variable 26-02-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	35 000 CAD	28	25
Honda Canada Finance Inc. 1,34 % 17-03-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	15	13
Honda Canada Finance Inc. 1,65 % 25-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000 CAD	32	24
Hunter Douglas Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 09-02-2029	Pays-Bas	Prêts à terme	54 000	54	45
Hydro One Inc. 1,69 % 16-01-2031, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	162 000 CAD	124	94
Hydro One Inc. 2,23 % 17-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	139 000 CAD	110	83
Hydro One Ltd. 1,41 % 15-10-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	15	12
iA Société financière inc., taux variable 25-02-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000 CAD	78	66
L'Ordre Indépendant des Forestiers, taux variable 15-10-2035, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	15	12
Indy US Bidco LLC, prêt à terme B3 de premier rang, taux variable 05-03-2028	États-Unis	Prêts à terme	9 751	10	9
INEOS Enterprises Holdings US Finco LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 03-09-2026	États-Unis	Prêts à terme	7 972	8	8
Intact Corporation financière 5,46 % 22-09-2032 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	32 000	32	31
Intact Corporation financière, taux variable 31-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	8 000 CAD	6	5
Inter Pipeline Ltd. 2,73 % 18-04-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	49 000 CAD	38	34
Inter Pipeline Ltd. 3,48 % 16-12-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	15	13
Inter Pipeline Ltd. 4,23 % 01-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	70 000 CAD	58	48
Inter Pipeline Ltd. 3,98 % 25-11-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000 CAD	158	124
Inter Pipeline Ltd. 5,85 % 18-05-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000 CAD	39	36
Inter Pipeline Ltd., taux variable 26-03-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	7	7
Inter Pipeline Ltd., taux variable 19-11-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	23	20
Interconexión Eléctrica SA ESP 3,83 % 26-11-2033	Colombie	Sociétés – Non convertibles	200 000	200	157
Société Financière Internationale 7,00 % 20-07-2027	Suprationales	s.o.	580 000 MXN	31	26
Société Financière Internationale 7,50 % 18-01-2028	Suprationales	s.o.	3 000 000 MXN	163	135
Société Financière Internationale 0 % 22-02-2038	Suprationales	s.o.	28 000 000 MXN	406	314
ION Trading Finance Ltd., prêt à terme B de premier rang, taux variable 26-03-2028	Irlande	Prêts à terme	19 750 EUR	23	18

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$ US)	Juste valeur (en milliers de \$ US)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Iris Escrow Issuer Corp. 10,00 % 15-12-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	9 000	7	7
Ivanhoe Cambridge II Inc. 2,91 % 27-06-2023, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	15	14
Ivanhoe Cambridge II Inc. 2,30 % 12-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	15	14
Jadex Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 12-02-2028	États-Unis	Prêts à terme	19 552	19	18
JPMorgan Chase & Co. 1,90 % 05-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	63 000 CAD	50	40
Kaisa Group Holdings Ltd. 8,65 % 22-07-2022	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000	73	21
Kaisa Group Holdings Ltd. 10,50 % 07-09-2022	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000	138	21
Keane Group Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 18-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	9 575	10	9
Keyera Corp. 3,96 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	210 000 CAD	182	136
Keyera Corp., taux variable 13-06-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	15	14
Keyera Corp., taux variable 10-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	25 000 CAD	20	16
Knight Health Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 17-12-2028	États-Unis	Prêts à terme	33 830	31	25
Kommunalbanken AS 2,13 % 11-02-2025	Norvège	Gouvernements étrangers	200 000	196	190
KP Germany Erste GmbH, prêt à terme B de premier rang, taux variable 04-02-2026	Allemagne	Prêts à terme	10 000 EUR	12	8
Produits Kruger S.E.C. 6,00 % 24-04-2025, rachetables 2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Produits Kruger S.E.C. 5,38 % 09-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 000 CAD	4	3
LABL Escrow Issuer LLC 6,75 % 15-07-2026, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	9 000	9	8
LABL Escrow Issuer LLC 10,50 % 15-07-2027, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	12 000	12	10
Liberty Utilities (Canada) LP 3,32 % 14-02-2050, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	5
Les Compagnies Loblaw Itée 4,49 % 11-12-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Les Compagnies Loblaw Itée 2,28 % 07-05-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000 CAD	29	24
Les Compagnies Loblaw Itée 5,01 % 13-09-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000 CAD	31	29
Les Compagnies Loblaw Itée 5,34 % 13-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	23	22
LogMeln Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 14-08-2027	États-Unis	Prêts à terme	19 650	19	14
Lower Mattagami Energy LP 2,43 % 14-05-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	29 000 CAD	24	18
LSF10 XL Bidco SCA, prêt à terme B de premier rang, taux variable 30-03-2028	Luxembourg	Prêts à terme	17 069 EUR	20	14
Banque Manuvie du Canada 1,54 % 14-09-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	63 000 CAD	50	40
Société Financière Manuvie, taux variable 09-05-2028, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	23	21
Société Financière Manuvie, taux variable 19-03-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	48 000 CAD	39	28
Société Financière Manuvie, taux variable 19-06-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	51 000 CAD	40	37
Mastercard Inc. 1,90 % 15-03-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	13 000	13	10
Mav Acquisition Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 21-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	9 743	10	9
Microsoft Corp. 2,53 % 01-06-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	500 000	374	327
Minerva Merger Sub Inc. 6,50 % 15-02-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	30 000	30	24
Morgan Stanley 3,00 % 07-02-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	60 000 CAD	46	42
Mozart Debt Merger Sub Inc. 3,88 % 01-04-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	16
Mozart Debt Merger Sub Inc. 5,25 % 01-10-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	31 000	31	23
National Grid Electricity Transmission PLC 2,30 % 22-06-2029	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	51 000 CAD	42	31
Natural Resource Partners LP 9,13 % 30-06-2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	210 000	213	215
NAV CANADA 2,06 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	7	6
Nestlé Holdings Inc. 2,19 % 26-01-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	47 000 CAD	38	30
Nexstar Escrow Inc. 5,63 % 15-07-2027, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	9 000	9	8
Nine Energy Service Inc. 8,75 % 01-11-2023, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	33 000	23	26
North West Redwater Partnership Co. Ltd. 3,70 % 23-02-2043, rachetables 2042	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	6
North West Redwater Partnership 3,20 % 22-07-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	60 000 CAD	48	42
North West Redwater Partnership 2,80 % 01-06-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	69 000 CAD	56	42
Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc. 4,11 % 31-03-2042	Canada	Sociétés – Non convertibles	29 959 CAD	23	19
Nova Scotia Power Inc. 3,57 % 05-04-2049, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	15	11
NVIDIA Corp. 3,50 % 01-04-2050, rachetables 2049	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	151 000	131	111
OMERS Finance Trust 2,60 % 14-05-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000 CAD	30	27
Ontario Power Generation Inc. 3,32 % 04-10-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	25 000 CAD	20	17
Ontario Power Generation Inc. 2,98 % 13-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	26 000 CAD	21	17

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$ US)	Juste valeur (en milliers de \$ US)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Ontario Teachers' Finance Trust 1,10 % 19-10-2027	Canada	Gouvernements provinciaux	20 000 CAD	15	13
Corporation Parkland du Canada 3,88 % 16-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	87 000 CAD	72	57
Corporation Parkland du Canada 4,50 % 01-10-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	8
Corporation Parkland 4,38 % 26-03-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	66 000 CAD	52	40
Corporation Pétroles Parkland					
5,88 % 15-07-2027, rachetables 2022 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 000	2	2
Corporation Pétroles Parkland 6,00 % 23-06-2028, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	22	21
PayPal Holdings Inc. 2,65 % 01-10-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	18
PayPal Holdings Inc. 2,30 % 01-06-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	8
Pembina Pipeline Corp. 3,54 % 03-02-2025, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000 CAD	31	28
Pembina Pipeline Corp. 4,02 % 27-03-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	140 000 CAD	111	95
Pembina Pipeline Corp. 3,62 % 03-04-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	23	20
Pembina Pipeline Corp. 3,31 % 01-02-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000 CAD	168	126
Pembina Pipeline Corp., taux variable 25-01-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	24	18
PepsiCo Inc. 2,50 % 01-11-2022	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 GBP	151	111
PepsiCo Inc. 3,00 % 15-10-2027, rachetables 2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	225 000	225	208
Petróleos de Venezuela SA 6,00 % 16-05-2024	Venezuela	Sociétés – Non convertibles	20 000	5	–
Petróleos Mexicanos 5,95 % 28-01-2031 144A	Mexique	Sociétés – Non convertibles	186 000	175	126
Petróleos Mexicanos 6,70 % 16-02-2032	Mexique	Sociétés – Non convertibles	272 000	273	192
Pioneer Natural Resources Co. 2,15 % 15-01-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	151 000	127	117
Plaze Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 03-08-2026	États-Unis	Prêts à terme	19 651	19	18
Pluto Acquisition I Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 20-06-2026	États-Unis	Prêts à terme	22 770	23	20
Province de l'Alberta 1,65 % 01-06-2031	Canada	Gouvernements provinciaux	50 000 CAD	38	30
Province de l'Alberta 3,10 % 01-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	150 000 CAD	120	91
Province de l'Alberta 2,95 % 01-06-2052	Canada	Gouvernements provinciaux	10 000 CAD	8	6
Province de l'Ontario 3,75 % 02-06-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	396 000 CAD	301	282
Province de l'Ontario 3,45 % 02-06-2045	Canada	Gouvernements provinciaux	6 000 CAD	6	4
Province de l'Ontario 3,75 % 02-12-2053	Canada	Gouvernements provinciaux	40 000 CAD	29	27
Province de Québec 3,65 % 20-05-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	91 000 CAD	70	65
Province de Québec 3,50 % 01-12-2048	Canada	Gouvernements provinciaux	5 000 CAD	5	3
Province de Québec 3,10 % 01-12-2051	Canada	Gouvernements provinciaux	1 000 CAD	1	1
PSP Capital Inc. 2,05 % 15-01-2030	Canada	Gouvernement fédéral	9 000 CAD	7	6
PSP Capital Inc. 2,60 % 01-03-2032	Canada	Gouvernement fédéral	50 000 CAD	39	32
Quasar Intermediate Holdings Ltd., prêt à terme B de premier rang, taux variable 20-01-2029	États-Unis	Prêts à terme	28 000	28	21
Reliance LP 2,68 % 01-12-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	15	13
Reliance LP 2,67 % 01-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	26 000 CAD	21	16
Rogers Communications Inc. 3,10 % 15-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	15 000 CAD	12	10
Rogers Communications Inc. 3,75 % 15-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	115 000 CAD	90	77
Rogers Communications Inc. 5,25 % 15-04-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	22 000 CAD	17	14
Rogers Communications Inc., taux variable 15-03-2082 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	24 000	24	21
Banque Royale du Canada 2,95 % 01-05-2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 000 CAD	2	1
Sagen MI Canada Inc. 3,26 % 05-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	23 000 CAD	18	14
Sagen MI Canada Inc., taux variable 24-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	17 000 CAD	14	10
Saputo inc. 2,88 % 19-11-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Saputo inc. 1,42 % 19-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	23	19
Saputo inc. 2,24 % 16-06-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	15 000 CAD	11	10
Saputo inc. 2,30 % 22-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	6 000 CAD	5	4
Secure Energy Services Inc. 7,25 % 30-12-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Shaw Communications Inc. 2,90 % 09-12-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000 CAD	79	60
Sienna Senior Living Inc. 3,11 % 04-11-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Sienna Senior Living Inc. 3,45 % 27-02-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Sienna Senior Living Inc. 2,82 % 31-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	210 000 CAD	175	136
Sigma Bidco BV, prêt à terme B de premier rang, taux variable 07-03-2025	Pays-Bas	Prêts à terme	20 000 EUR	25	16
Signal Parent Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-04-2028	États-Unis	Prêts à terme	9 875	10	7
Silgan Holdings Inc. 4,13 % 01-02-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	5 000	5	4
Sinclair Television Group Inc. 5,13 % 15-02-2027, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000	9	8

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$ US)	Juste valeur (en milliers de \$ US)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
SmartCentres Real Estate Investment Trust 3,19 % 11-06-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	7	7
SmartCentres Real Estate Investment Trust 3,83 % 21-12-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	14 000 CAD	12	9
Source energy Services 10,50 % 15-03-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	47 731 CAD	38	21
South Coast British Columbia Transportation Authority 1,60 % 03-07-2030	Canada	Administrations municipales	30 000 CAD	22	18
Spa US HoldCo Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 12-03-2028	États-Unis	Prêts à terme	19 751	20	18
Specialty Pharma III Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 24-02-2028	États-Unis	Prêts à terme	19 800	20	19
Stitch Acquisition Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 27-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	20 790	19	18
Summit Industrial Income Real Estate Investment Trust 1,82 % 01-04-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	16	13
Summit Industrial Income Real Estate Investment Trust 2,25 % 12-01-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	14 000 CAD	11	9
Summit Industrial Income Real Estate Investment Trust 2,44 % 14-07-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	229 000 CAD	184	141
Financière Sun Life inc., taux variable 19-09-2028, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	38 000 CAD	32	27
Financière Sun Life inc., taux variable 21-11-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	115 000 CAD	92	72
Financière Sun Life inc., taux variable 10-08-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000 CAD	39	35
Financière Sun Life inc., taux variable 01-10-2035	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	22	17
Financière Sun Life inc., taux variable 30-06-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	38 000 CAD	31	22
Suncor Énergie Inc. 3,10 % 24-05-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	22	20
Suncor Énergie Inc. 3,75 % 04-03-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	151 000	123	107
Suncor Énergie Inc. 3,95 % 04-03-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	16 000 CAD	12	9
Sunset Debt Merger Sub Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 17-09-2028	États-Unis	Prêts à terme	45 885	45	36
Supérieur Plus S.E.C. 4,25 % 18-05-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	6
Suzano SA 3,75 % 15-01-2031	Bésil	Sociétés – Non convertibles	20 000	21	16
Target Corp. 2,25 % 15-04-2025, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	19
TELUS Corp. 2,35 % 27-01-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	14	13
TELUS Corp. 3,30 % 02-05-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	13 000 CAD	10	8
TELUS Corp. 3,15 % 19-02-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000 CAD	30	25
TELUS Corp. 2,05 % 07-10-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000 CAD	15	11
TELUS Corp. 5,25 % 15-11-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	76 000 CAD	58	54
Tenet Healthcare Corp. 4,38 % 15-01-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	5 000	5	4
Teranet Holdings LP 3,72 % 23-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000 CAD	79	66
Thevelia (US) LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 10-02-2029	États-Unis	Prêts à terme	23 000	23	22
Thomson Reuters Corp. 2,24 % 14-05-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	21	20
Timber Servicios Empresariales SA, prêt à terme B de premier rang, taux variable 17-02-2029	Espagne	Prêts à terme	17 000 EUR	19	14
T-Mobile USA Inc. 3,50 % 15-04-2025, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	19
T-Mobile USA Inc. 2,55 % 15-02-2031, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	8
T-Mobile USA Inc. 5,20 % 15-01-2033	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	47 000	47	45
Groupe TMX Ltée 2,30 % 11-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Groupe TMX Ltée 3,78 % 05-06-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	23	21
Groupe TMX Ltée 2,02 % 12-02-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	15 000 CAD	12	9
La Banque Toronto-Dominion 4,21 % 01-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	46 000 CAD	35	32
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-10-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	78 000 CAD	59	56
Tourmaline Oil Corp. 2,53 % 12-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	22 000 CAD	17	14
Crédit Toyota Canada Inc. 1,18 % 23-02-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	52 000 CAD	39	33
Toyota Motor Corp. 1,34 % 25-03-2026	Japon	Sociétés – Non convertibles	15 000	15	13
TransCanada PipeLines Ltd. 3,30 % 17-07-2025, rachetables 2025, série MTN	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	9	7
TransCanada PipeLines Ltd. 3,80 % 05-04-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	38 000 CAD	33	26
TransCanada PipeLines Ltd. 4,18 % 03-07-2048, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 000 CAD	2	2
TransCanada PipeLines Ltd. 4,20 % 04-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	57 000 CAD	45	33
TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000 CAD	204	163
Trulieve Cannabis Corp. 8,00 % 06-10-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	13 000	13	12

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N <sup>bre</sup> d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$ US)	Juste valeur (en milliers de \$ US)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2023	États-Unis	Gouvernements étrangers	1 000 000	1 300	1 271
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,50 % 15-04-2024	États-Unis	Gouvernements étrangers	2 600 000	3 182	2 971
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-10-2026	États-Unis	Gouvernements étrangers	2 000 000	2 250	2 021
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-04-2027	États-Unis	Gouvernements étrangers	1 400 000	1 458	1 293
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,38 % 15-07-2027	États-Unis	Gouvernements étrangers	800 000	956	904
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,25 % 15-07-2029	États-Unis	Gouvernements étrangers	800 000	1 001	835
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2031	États-Unis	Gouvernements étrangers	1 550 000	1 854	1 540
Obligations du Trésor des États-Unis 1,13 % 15-02-2031	États-Unis	Gouvernements étrangers	64 000	62	52
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2032	États-Unis	Gouvernements étrangers	1 900 000	2 071	1 755
Obligations du Trésor des États-Unis 2,75 % 15-08-2032	États-Unis	Gouvernements étrangers	46 000	42	42
Obligations du Trésor des États-Unis 2,38 % 15-02-2042	États-Unis	Gouvernements étrangers	98 000	86	75
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,25 % 15-02-2050	États-Unis	Gouvernements étrangers	400 000	519	301
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2051	États-Unis	Gouvernements étrangers	390 000	492	277
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052	États-Unis	Gouvernements étrangers	2 100 000	2 057	1 407
Obligations du Trésor des États-Unis 2,25 % 15-02-2052	États-Unis	Gouvernements étrangers	78 000	72	57
Obligations du Trésor des États-Unis 3,00 % 15-08-2052	États-Unis	Gouvernements étrangers	22 000	19	19
Ventas Canada Finance Ltd. 2,45 % 04-01-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	33 000 CAD	26	21
Ventas Canada Finance Ltd. 3,30 % 01-12-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	43 000 CAD	34	26
Ventas Inc. 2,80 % 12-04-2024, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	30 000 CAD	23	21
Veregy, prêt à terme de premier rang, taux variable 03-11-2027	États-Unis	Prêts à terme	19 650	19	19
Verizon Communications Inc., taux variable 20-03-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	16 000	16	16
Verizon Communications Inc. 2,38 % 22-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	58 000 CAD	46	37
Verizon Communications Inc. 2,50 % 16-05-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	24 000 CAD	17	15
Verizon Communications Inc. 2,55 % 21-03-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	30 000	30	24
Vidéotron Itée 5,75 % 15-01-2026, rachetables 2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Vidéotron Itée 3,63 % 15-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	45 000 CAD	37	28
Vidéotron Itée 4,50 % 15-01-2030, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000 CAD	38	31
Visa Inc. 2,00 % 15-08-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	301 000	201	174
Walgreens Boots Alliance Inc. 3,20 % 15-04-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	8
Weatherford International Ltd. 8,63 % 30-04-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	340 000	338	297
Wells Fargo & Co. 2,57 % 01-05-2026, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000 CAD	8	7
Wells Fargo & Co. 2,98 % 19-05-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	11 000 CAD	9	7
Wells Fargo & Co., taux variable 15-03-2169	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	12 000	12	10
WireCo WorldGroup Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 29-10-2028	États-Unis	Prêts à terme	25 148	25	24
Groupe WSP Global Inc. 2,41 % 19-04-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	32 000 CAD	26	20
<b>Total des obligations</b>				<b>40 583</b>	<b>33 300</b>

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$ US)	Juste valeur (en milliers de \$ US)
<b>ACTIONS</b>					
AbbVie Inc.	États-Unis	Soins de santé	8 987	960	1 206
Adobe Systems Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	1 073	469	295
AIA Group Ltd.	Hong Kong	Services financiers	42 680	394	354
Air Liquide SA	France	Matériaux	3 858	413	439
Alphabet Inc., cat. A	États-Unis	Services de communication	9 802	1 245	938
Altria Group Inc.	États-Unis	Consommation de base	17 946	880	725
Amadeus IT Group SA	Espagne	Technologie de l'information	10 738	704	497
Amazon.com Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	6 522	998	737
Analog Devices Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	2 396	430	334
Aon PLC	Irlande	Services financiers	3 089	739	827
Apple Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	5 298	412	732
Atlas Copco AB, A	Suède	Produits industriels	20 774	203	192
Bank of America Corp.	États-Unis	Services financiers	15 531	656	469
BCE Inc., priv., série AA	Canada	Services de communication	665	8	8
BCE Inc., priv., série AI	Canada	Services de communication	97	1	1
BCE Inc. 4,54 %, à div. cumulatif, rachetables, priv. de premier rang, série R, rachetables	Canada	Services de communication	590	9	6
Becton, Dickinson and Co.	États-Unis	Soins de santé	4 119	912	918
The Blackstone Group Inc., cat. A	États-Unis	Services financiers	5 268	365	441
Broadcom Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	1 443	497	641
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 46	Canada	Biens immobiliers	1 190	23	19
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 48	Canada	Biens immobiliers	441	9	7
Brookfield Renewable Partners L.P., priv., série 13	Canada	Services publics	308	6	5
Cenovus Energy Inc., priv., série 3	Canada	Énergie	250	4	4
Cenovus Energy Inc., priv., série 7	Canada	Énergie	1 700	28	25
Chevron Corp.	États-Unis	Énergie	8 973	983	1 289
CME Group Inc.	États-Unis	Services financiers	4 172	657	739
The Coca-Cola Co.	États-Unis	Consommation de base	16 378	862	917
Corteva Inc.	États-Unis	Matériaux	15 603	532	892
Crown Castle International Corp.	États-Unis	Biens immobiliers	3 746	646	541
DBS Group Holdings Ltd.	Singapour	Services financiers	26 960	648	623
Deutsche Börse AG	Allemagne	Services financiers	5 968	731	982
Diageo PLC	Royaume-Uni	Consommation de base	14 828	575	621
Domino's Pizza Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	822	394	255
Emera Inc., priv., série L	Canada	Services publics	910	18	12
Emerson Electric Co.	États-Unis	Produits industriels	7 282	444	533
Equifax Inc.	États-Unis	Produits industriels	1 534	213	263
Eurofins Scientific	France	Soins de santé	3 114	168	185
Frontera Generation Holdings LLC	États-Unis	Énergie	67	–	–
Glencore PLC	Suisse	Matériaux	206 326	897	1 089
Hannover Rueckversicherung SE, nom.	Allemagne	Services financiers	3 207	568	484
Heineken Holding NV, A	Pays-Bas	Consommation de base	5 033	434	344
Honeywell International Inc.	États-Unis	Produits industriels	3 650	591	609
Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	Hong Kong	Services financiers	8 990	336	305
Housing Development Finance Corp. Ltd.	Inde	Services financiers	10 384	281	288
Hoya Corp.	Japon	Soins de santé	3 800	398	365
Intelsat Jackson Holdings SA, A, bons de souscription éch. 05-12-2025	Luxembourg	Services de communication	30	–	–
Intelsat Jackson Holdings SA, B, bons de souscription éch. 05-12-2025	Luxembourg	Services de communication	30	–	–
Intelsat Jackson Holdings SA	Luxembourg	Services de communication	289	10	10
Japan Exchange Group Inc.	Japon	Services financiers	26 460	463	358
Johnson & Johnson	États-Unis	Soins de santé	6 981	997	1 140
JPMorgan Chase & Co.	États-Unis	Services financiers	9 247	1 129	966
Keyence Corp.	Japon	Technologie de l'information	840	276	279
Koninklijke Philips NV	Pays-Bas	Soins de santé	15 772	551	244
Lam Research Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	939	547	344
Linde PLC	Irlande	Matériaux	1 292	246	348
Les Compagnies Loblaw Itée 5,30 %, à div. cumulatif, rachetables, priv. de second rang, série B	Canada	Consommation de base	103	2	2
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	France	Consommation discrétionnaire	507	243	298

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N <sup>bre</sup> d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$ US)	Juste valeur (en milliers de \$ US)
<b>ACTIONS (suite)</b>					
Marathon Petroleum Corp.	États-Unis	Énergie	13 390	681	1 330
McDonald's Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	2 120	373	489
Medtronic PLC	États-Unis	Soins de santé	5 922	682	478
Meta Platforms Inc.	États-Unis	Services de communication	1 928	654	262
Microsoft Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	6 647	977	1 548
Moody's Corp.	États-Unis	Services financiers	766	138	186
Motorola Solutions Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	3 515	662	787
Nestlé SA, nom.	Suisse	Consommation de base	7 834	722	848
Nike Inc., cat. B	États-Unis	Consommation discrétionnaire	1 685	132	140
Novo Nordisk AS, B	Danemark	Soins de santé	6 647	370	662
PepsiCo Inc.	États-Unis	Consommation de base	3 183	460	520
<sup>1</sup> Pernod Ricard SA	France	Consommation de base	1 321	201	241
Philip Morris International Inc.	États-Unis	Consommation de base	10 958	988	910
Realty Income Corp.	États-Unis	Biens immobiliers	5 780	401	336
Roche Holding AG Genussscheine	Suisse	Soins de santé	2 734	858	891
S&P Global Inc.	États-Unis	Services financiers	2 299	837	702
Safran SA	France	Produits industriels	4 098	436	373
SAP AG	Allemagne	Technologie de l'information	6 567	756	541
Schlumberger Ltd.	États-Unis	Énergie	7 684	318	276
Shell PLC (actions en livres sterling)	Pays-Bas	Énergie	18 059	477	449
The Sherwin-Williams Co.	États-Unis	Matériaux	1 248	194	256
Sika AG	Suisse	Matériaux	1 087	198	217
Sony Corp.	Japon	Consommation discrétionnaire	8 400	589	540
Source Energy Services Ltd.	Canada	Énergie	2 501	5	2
Starbucks Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	3 923	269	331
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	Taiwan	Technologie de l'information	39 930	467	524
Tencent Holdings Ltd.	Chine	Services de communication	8 910	449	301
Texas Instruments Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	2 961	373	458
Thermo Fisher Scientific Inc.	États-Unis	Soins de santé	855	466	434
TransAlta Corp., priv., série A	Canada	Services publics	1 685	17	17
TransAlta Corp. 4,60 %, perpétuelles, priv., rachetables 2022, série C	Canada	Services publics	160	2	2
U.S. Bancorp	États-Unis	Services financiers	14 451	802	583
Union Pacific Corp.	États-Unis	Produits industriels	3 713	858	723
UnitedHealth Group Inc.	États-Unis	Soins de santé	390	199	197
Visa Inc., cat. A	États-Unis	Technologie de l'information	3 841	591	682
The Walt Disney Co.	États-Unis	Services de communication	2 363	263	223
The Williams Companies Inc.	États-Unis	Énergie	12 119	384	347
Wolters Kluwer NV	Pays-Bas	Produits industriels	6 542	544	637
<b>Total des actions</b>				<b>42 998</b>	<b>43 588</b>
<b>OPTIONS</b>					
Options achetées (se reporter au tableau des options achetées)				11	7
<b>Total des options</b>				<b>11</b>	<b>7</b>
<b>FONDS/BILLETS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>					
<sup>2</sup> FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	15 350	1 112	814
<sup>2</sup> FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	21 000	335	261
<sup>2</sup> FINB Obligations américaines totales Mackenzie (couvert en \$ CA)	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	2 000	128	117
<sup>2</sup> FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	4 509	383	274
<b>Total des fonds/billets négociés en bourse</b>				<b>1 958</b>	<b>1 466</b>
<b>FONDS COMMUNS DE PLACEMENT</b>					
<sup>3</sup> Fonds mondial chinois Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	29 531	234	166
<sup>3</sup> Fonds international de dividendes Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	20 028	156	168
<sup>3</sup> Fonds de revenu fixe sans contraintes Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	6 408	48	39
<b>Total des fonds communs de placement</b>				<b>438</b>	<b>373</b>

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N <sup>bre</sup> d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$ US)	Juste valeur (en milliers de \$ US)
<b>FONDS PRIVÉS</b>					
<sup>4</sup>	Canada	Services financiers	37	232	232
<sup>5</sup>	Canada	Services financiers	37	85	82
				<b>317</b>	<b>314</b>
				(38)	–
				<b>86 267</b>	<b>79 048</b>
					1 061
					2 201
					971
					<b>83 281</b>

<sup>1</sup> L'émetteur de ce titre est lié à Mackenzie. Voir note 1.

<sup>2</sup> Ce fonds négocié en bourse est géré par Mackenzie.

<sup>3</sup> Ce fonds est géré par Mackenzie.

<sup>4</sup> Ce fonds est géré par Northleaf Capital Partners (Canada) Ltd., une société affiliée à Mackenzie.

<sup>5</sup> Ce fonds est géré par Sagard Holdings Inc., une société affiliée à Mackenzie.



# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## APERÇU DU PORTEFEUILLE

30 SEPTEMBRE 2022

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Actions	52,4
Obligations	40,3
<i>Obligations</i>	40,0
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)</i>	0,3
Trésorerie et placements à court terme	2,6
Autres éléments d'actif (de passif)	2,1
Fonds/billets négociés en bourse	1,8
Fonds privés	0,4
Fonds communs de placement	0,4
Options sur devises achetées	–

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	57,5
Canada	13,0
Autre	5,5
Allemagne	3,8
Suisse	3,7
Trésorerie et placements à court terme	2,6
Autres éléments d'actif (de passif)	2,1
Pays-Bas	2,1
Mexique	2,0
Japon	1,9
France	1,8
Irlande	1,4
Royaume-Uni	1,0
Danemark	0,8
Hong Kong	0,8

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations d'État étrangères	21,9
Obligations de sociétés	13,6
Services financiers	10,1
Technologie de l'information	9,2
Soins de santé	8,1
Consommation de base	6,2
Énergie	4,4
Produits industriels	4,0
Matériaux	3,9
Consommation discrétionnaire	3,4
Autre	2,9
Trésorerie et placements à court terme	2,6
Obligations fédérales	2,6
Autres éléments d'actif (de passif)	2,1
Services de communication	2,1
Fonds/billets négociés en bourse	1,8
Biens immobiliers	1,1

31 MARS 2022

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Actions	56,1
Obligations	33,3
<i>Obligations</i>	32,7
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)</i>	0,4
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)</i>	0,2
<i>Options achetées</i>	0,0
Trésorerie et placements à court terme	6,9
Fonds/billets négociés en bourse	1,8
Autres éléments d'actif (de passif)	1,3
Fonds communs de placement	0,4
Fonds privés	0,2
Options sur devises achetées	0,0

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	57,0
Canada	9,5
Trésorerie et placements à court terme	6,9
Autre	5,2
Suisse	3,9
Allemagne	3,2
France	2,1
Mexique	2,1
Pays-Bas	1,9
Japon	1,9
Irlande	1,5
Autres éléments d'actif (de passif)	1,3
Royaume-Uni	1,0
Hong Kong	0,9
Taïwan	0,8
Singapour	0,8

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations d'État étrangères	20,0
Services financiers	11,1
Technologie de l'information	10,7
Obligations de sociétés	9,7
Soins de santé	7,7
Trésorerie et placements à court terme	6,9
Consommation de base	6,3
Produits industriels	4,6
Matériaux	4,1
Énergie	3,9
Consommation discrétionnaire	3,5
Autre	3,0
Services de communication	2,6
Fonds/billets négociés en bourse	1,8
Prêts à terme	1,5
Biens immobiliers	1,3
Autres éléments d'actif (de passif)	1,3

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## TABLEAU DES OPTIONS ACHETÉES

au 30 septembre 2022

Élément sous-jacent	Nombre de contrats	Type d'option	Date d'échéance	Prix d'exercice (\$)	Prime payée (en milliers de \$ US)	Juste valeur (en milliers de \$ US)
Option de vente sur devises JPY/MXN	40 300 000	Vente	4 janvier 2023	5,95 JPY	11	7
<b>Total des options</b>					<b>11</b>	<b>7</b>

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS

au 30 septembre 2022

### Tableau des contrats à terme standardisés

Type de contrat	Nombre de contrats	Date d'échéance	Prix moyen des contrats (\$)	Montant notionnel* (en milliers de \$ US)	Profits latents (en milliers de \$ US)	Pertes latentes (en milliers de \$ US)
Contrats à terme standardisés sur obligations Euro-Bobl, décembre 2022	(27)	8 décembre 2022	122,59 EUR	(3 168)	75	–
Contrats à terme standardisés sur euro-obligations à long terme du gouvernement italien (BTP), décembre 2022	(15)	8 décembre 2022	117,33 EUR	(1 646)	78	–
Contrats à terme standardisés sur obligations Euro-Schatz, décembre 2022	(38)	8 décembre 2022	108,05 EUR	(3 991)	33	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans, décembre 2022	(12)	13 décembre 2022	148,40 JPY	(12 291)	5	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor américain à 5 ans, décembre 2022	(15)	30 décembre 2022	111,23 USD	(1 613)	56	–
<b>Total des contrats à terme standardisés</b>				<b>(22 709)</b>	<b>247</b>	<b>–</b>

\* Le montant notionnel représente l'exposition aux instruments sous-jacents au 30 septembre 2022.

### Tableau des contrats de change à terme de gré à gré

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$ US)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$ US)	Profits latents (en milliers de \$ US)	(Pertes) latentes (en milliers de \$ US)
A	31 AUD	(21) USD	4 octobre 2022	21	20	–	(1)
A	20 USD	(31) AUD	4 octobre 2022	(20)	(20)	–	–
A	663 CAD	(506) USD	4 octobre 2022	506	480	–	(26)
A	483 USD	(663) CAD	4 octobre 2022	(483)	(480)	3	–
A	116 CHF	(119) USD	4 octobre 2022	119	117	–	(2)
A	118 USD	(116) CHF	4 octobre 2022	(118)	(118)	–	–
A	111 EUR	(112) USD	4 octobre 2022	112	109	–	(3)
A	109 USD	(111) EUR	4 octobre 2022	(109)	(109)	–	–
A	291 GBP	(339) USD	4 octobre 2022	339	325	–	(14)
A	325 USD	(291) GBP	4 octobre 2022	(325)	(325)	–	–
A	214 USD	(29 600) JPY	4 octobre 2022	(214)	(204)	10	–
A	29 600 JPY	(204) USD	4 octobre 2022	204	204	–	–
A	279 USD	(2 770) NOK	4 octobre 2022	(279)	(254)	25	–
A	2 770 NOK	(254) USD	4 octobre 2022	254	254	–	–
A	132 USD	(215) NZD	4 octobre 2022	(132)	(121)	11	–
A	215 NZD	(122) USD	4 octobre 2022	122	121	–	(1)
A	238 USD	(2 530) SEK	4 octobre 2022	(238)	(228)	10	–
A	2 530 SEK	(228) USD	4 octobre 2022	228	228	–	–
A	759 USD	(740) EUR	21 octobre 2022	(759)	(727)	32	–
A	60 EUR	(60) USD	21 octobre 2022	60	59	–	(1)
A	45 EUR	(45) USD	21 octobre 2022	45	44	–	(1)
A	72 EUR	(72) USD	21 octobre 2022	72	70	–	(2)
A	40 EUR	(40) USD	21 octobre 2022	40	39	–	(1)
A	1 108 USD	(23 017) MXN	21 octobre 2022	(1 108)	(1 141)	–	(33)
A	50 USD	(1 035) MXN	21 octobre 2022	(50)	(51)	–	(1)
A	816 MXN	(41) USD	21 octobre 2022	41	41	–	–
A	1 000 MXN	(50) USD	21 octobre 2022	50	50	–	–
A	199 USD	(2 000) NOK	21 octobre 2022	(199)	(184)	15	–
A	500 AUD	(322) USD	2 novembre 2022	322	321	–	(1)
A	696 CAD	(507) USD	2 novembre 2022	507	505	–	(2)
A	405 USD	(398) CHF	2 novembre 2022	(405)	(404)	1	–
A	264 USD	(269) EUR	2 novembre 2022	(264)	(264)	–	–
A	262 GBP	(293) USD	2 novembre 2022	293	293	–	–

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2022

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$ US)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$ US)	Profits latents (en milliers de \$ US)	(Pertes) latentes (en milliers de \$ US)
A	311 USD	(44 900) JPY	2 novembre 2022	(311)	(311)	–	–
A	1 USD	(10) NOK	2 novembre 2022	(1)	(1)	–	–
A	13 USD	(23) NZD	2 novembre 2022	(13)	(13)	–	–
A	309 USD	(3 430) SEK	2 novembre 2022	(309)	(309)	–	–
A	11 696 USD	(15 130) CAD	4 novembre 2022	(11 696)	(10 955)	741	–
A	175 USD	(240) CAD	4 novembre 2022	(175)	(174)	1	–
A	31 USD	(30) EUR	4 novembre 2022	(31)	(30)	1	–
A	626 USD	(610) EUR	4 novembre 2022	(626)	(600)	26	–
A	62 USD	(90) AUD	9 novembre 2022	(62)	(57)	5	–
A	365 USD	(560) AUD	9 novembre 2022	(365)	(358)	7	–
A	230 000 COP	(51) USD	9 novembre 2022	51	49	–	(2)
A	9 000 INR	(112) USD	9 novembre 2022	112	110	–	(2)
A	39 USD	(190) PLN	9 novembre 2022	(39)	(38)	1	–
A	660 ZAR	(39) USD	9 novembre 2022	39	37	–	(2)
AA	123 USD	(100) GBP	16 novembre 2022	(123)	(112)	11	–
AA	31 USD	(30) EUR	18 novembre 2022	(31)	(30)	1	–
AA	153 USD	(148) EUR	18 novembre 2022	(153)	(146)	7	–
AA	50 EUR	(48) USD	18 novembre 2022	48	49	1	–
AA	60 EUR	(59) USD	18 novembre 2022	59	59	–	–
<b>Total des contrats de change à terme de gré à gré</b>						<b>909</b>	<b>(95)</b>
<b>Total des actifs dérivés</b>							<b>1 156</b>
<b>Total des passifs dérivés</b>							<b>(95)</b>

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## 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 2022 et 2021 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 2022, selon le cas. Pour l'exercice au cours duquel un fonds ou une série est établi(e) ou rétabli(e), l'information fournie se rapporte à la période commençant à la date d'établissement ou de rétablissement. Lorsqu'une série d'un fonds a été dissoute au cours de l'une ou l'autre des périodes, l'information concernant la série est fournie jusqu'à la fermeture des bureaux à la date de dissolution. Se reporter à la note 10 pour la date de constitution du Fonds et la date d'établissement de chacune des séries.

Le Fonds a été constitué en fiducie de fonds commun de placement à capital variable en vertu des lois de la province de l'Ontario aux termes d'une déclaration de fiducie qui a été modifiée et mise à jour de temps à autre. Le siège social du Fonds est situé au 180, rue Queen Ouest, Toronto (Ontario) Canada. Le Fonds est autorisé à émettre un nombre illimité de parts (désignées en tant que « titre » ou « titres ») de séries multiples. Les séries du Fonds sont offertes à la vente aux termes d'un prospectus simplifié ou aux termes d'options de 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. Gestion de placements Canada Vie limitée (« GPCV ») appartient à cent pour cent à La Compagnie d'Assurance du Canada sur la Vie (« Canada Vie »), filiale de Power Corporation du Canada. Les placements du Fonds dans des sociétés du groupe de sociétés Power sont identifiés dans le tableau des placements.

### 2. Base d'établissement et mode de présentation

Les présents états financiers 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 2022. 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 américains, 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 11 novembre 2022.

### 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).

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

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.

Les titres rachetables du Fonds confèrent aux porteurs le droit de faire racheter leur participation dans le Fonds contre un montant de trésorerie égal à leur part proportionnelle de la valeur liquidative du Fonds, entre autres droits contractuels. Les titres rachetables du Fonds satisfont aux critères de classement à titre de passifs financiers conformément à 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.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## NOTES ANNEXES

### 3. Principales méthodes comptables (suite)

#### 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.

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.

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

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

La valeur des contrats à terme standardisés ou des swaps fluctue quotidiennement; les règlements au comptant effectués tous les jours par le Fonds, le cas échéant, représentent la variation des profits ou des pertes latent(e)s, mieux établi(e)s au prix de règlement. Ces profits ou pertes latent(e)s sont inscrit(e)s et comptabilisé(e)s de cette manière jusqu'à ce que le Fonds 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 payées pour l'achat d'options sont comptabilisées dans l'état de la situation financière – Placements à la juste valeur.

Les primes reçues à la souscription d'options sont incluses dans l'état de la situation financière à titre de passif et sont par la suite ajustées quotidiennement à leur juste valeur. Si une option souscrite vient à échéance sans avoir été exercée, la prime reçue est inscrite à titre de profit réalisé. Lorsqu'une option d'achat souscrite est exercée, l'écart entre le produit de la vente plus la valeur de la prime et le coût du titre est inscrit à titre de profit ou de perte réalisé(e). Lorsqu'une option de vente souscrite est exercée, le coût du titre acquis correspond au prix d'exercice de l'option moins la prime 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 2022.

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

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

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

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

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

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

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## NOTES ANNEXES

### 3. Principales méthodes comptables (suite)

#### b) Évaluation de la juste valeur (suite)

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

Voir la note 10 pour le classement de la juste valeur du Fonds.

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

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

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

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

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

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

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

#### f) Compensation

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

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

#### g) Devise

Le dollar américain 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 américains 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 américains 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, et est présentée à la note 10.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## NOTES ANNEXES

### 3. Principales méthodes comptables (suite)

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

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

#### k) Fusions

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

#### l) Modifications comptables futures

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

### 4. Estimations et jugements comptables critiques

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.

Voici à la suite les estimations et les jugements comptables les plus importants utilisés pour la préparation des états financiers :

#### Utilisation d'estimations

##### *Juste valeur des titres non cotés sur un marché actif*

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

#### Utilisation de jugements

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

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

##### *Monnaie fonctionnelle*

Le dollar américain 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 fiduciaire de fonds commun de placement en vertu des dispositions de la *Loi de l'impôt sur le revenu (Canada)*. Par conséquent, il est assujéti à l'impôt pour ce qui est de ses bénéficiaires, y compris le montant net des gains en capital réalisés pour l'année d'imposition, qui ne sont ni payés ni à payer à ses porteurs de titres à la fin de l'année d'imposition. Le Fonds maintient la fin de l'exercice en décembre aux fins de l'impôt. Le Fonds peut être assujéti aux retenues à la source d'impôts étrangers. En général, le Fonds traite les retenues d'impôts à la source en tant que charges portées en réduction du bénéfice aux fins du calcul de l'impôt. Le Fonds distribuera des montants suffisants tirés de son bénéfice net aux fins du calcul de l'impôt, au besoin, afin de ne pas payer d'impôt sur le résultat, à l'exception des impôts remboursables sur les gains en capital, le cas échéant.

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



# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## NOTES ANNEXES

### 6. Frais de gestion et frais d'exploitation

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

Chaque série du Fonds, 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.

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 10 pour les taux des frais de gestion et d'administration imputés à chaque série de titres.

### 7. Capital du Fonds

Le capital du Fonds, qui comprend l'actif net attribuable aux porteurs de titres, est réparti entre les différentes séries, lesquelles comportent chacune un nombre illimité de titres. Les titres en circulation du Fonds aux 30 septembre 2022 et 2021 ainsi que les titres qui ont été émis, réinvestis et rachetés au cours de ces périodes sont présentés dans l'état de l'évolution de la situation financière. Mackenzie gère le capital du Fonds conformément aux objectifs de placement décrits à la note 10.

### 8. Risques découlant des instruments financiers

#### i. Exposition au risque et gestion du risque

Les activités de placement du Fonds l'exposent à divers risques financiers, tels qu'ils sont définis dans 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 2022, regroupés par type d'actif, région géographique et secteur.

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

#### ii. Risque de liquidité

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

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

#### iii. Risque de change

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

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

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## NOTES ANNEXES

### 8. Risques découlant des instruments financiers (suite)

#### iii. Risque de change (suite)

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

#### iv. Risque de taux d'intérêt

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

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

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

#### v. Autre risque de prix

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

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

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

#### vi. Risque de crédit

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

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

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

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

#### vii. Fonds sous-jacents

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

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## NOTES ANNEXES

### 9. Autres renseignements

#### Abréviations

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

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

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## NOTES ANNEXES

### 10. Renseignements propres au Fonds (en milliers de \$ US, sauf pour a))

#### a) Constitution du Fonds et renseignements sur les séries

Date de constitution : 1<sup>er</sup> mai 2015

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 montants minimaux ci-dessous sont calculés en dollars américains.

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

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 PW 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 PWT8 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % ou de 8 % par année, respectivement.

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 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.

Depuis le 1<sup>er</sup> juin 2022, les investisseurs peuvent acheter des titres du Fonds seulement en vertu d'un mode de souscription avec frais d'acquisition. Les frais d'acquisition du mode de souscription avec frais d'acquisition sont négociés entre l'investisseur et son courtier. Les titres souscrits avant le 1<sup>er</sup> juin 2022 en vertu du mode de souscription avec frais de rachat, du mode de souscription avec frais modérés 3 et du mode de souscription avec frais modérés 2 (collectivement, les « modes de souscription avec frais d'acquisition différés ») peuvent continuer d'être détenus dans les comptes des investisseurs. Les investisseurs peuvent échanger des titres d'un fonds Mackenzie souscrits antérieurement en vertu de ces modes de souscription avec frais d'acquisition différés contre des titres d'autres fonds Mackenzie, en vertu du même mode de souscription, jusqu'à l'expiration du délai prévu dans le barème des frais de rachat. Pour de plus amples renseignements, veuillez vous reporter au prospectus simplifié du Fonds et à l'aperçu du Fonds.

Série	Date d'établissement/ de rétablissement	Frais de gestion	Frais d'administration
Série A	20 mai 2015	1,85 %	0,24 %
Série D	20 mai 2015	0,85 % <sup>2)</sup>	0,16 %
Série F	20 mai 2015	0,70 %	0,15 %
Série F8	1 <sup>er</sup> juin 2018	0,70 %	0,15 %
Série FB	26 octobre 2015	0,85 %	0,24 %
Série PW	20 mai 2015	1,70 %	0,15 %
Série PWFB	3 avril 2017	0,70 %	0,15 %
Série PWT8	3 avril 2017	1,70 %	0,15 %
Série PWX	15 juin 2015	— <sup>1)</sup>	— <sup>1)</sup>
Série PWX8	24 octobre 2018	— <sup>1)</sup>	— <sup>1)</sup>
Série T8	26 mai 2015	1,85 %	0,24 %

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

2) Avant le 4 avril 2022, les frais de gestion pour la série D étaient imputés au Fonds au taux de 1,10 %.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## NOTES ANNEXES

### 10. Renseignements propres au Fonds (en milliers de \$ US, sauf pour a)) (suite)

#### b) Reports prospectifs de pertes

#### Date d'échéance des pertes autres qu'en capital

Total de la perte en capital \$	Total de la perte autre qu'en capital \$	2028	2029	2030	2031	2032	2033	2034	2035	2036	2037	2038	2039	2040	2041
		\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
1 318	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

#### c) Prêt de titres

	30 septembre 2022		31 mars 2022	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
Valeur des titres prêtés	1 596		8 854	
Valeur des biens reçus en garantie	1 691		9 309	

	30 septembre 2022		30 septembre 2021	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
Revenus de prêts de titres bruts	4	100,0	2	100,0
Impôt retenu à la source	-	-	-	-
Paiements à l'agent de prêt de titres	4	100,0	2	100,0
Revenu tiré du prêt de titres	(1)	(25,0)	-	-
	3	75,0	2	100,0

#### d) Commissions

	(\$)
30 septembre 2022	2
30 septembre 2021	5

#### e) Risques découlant des instruments financiers

##### i. Exposition au risque et gestion du risque

Le Fonds vise à générer un revenu avec un potentiel de croissance du capital à long terme en dollars américains 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 EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## NOTES ANNEXES

### 10. Renseignements propres au Fonds (en milliers de \$ US, sauf pour a)) (suite)

#### e) Risques découlant des instruments financiers (suite)

##### ii. Risque de change

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

Devise	30 septembre 2022				Incidence sur l'actif net			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Renforcement de 5 %		Affaiblissement de 5 %	
					(\$)	%	(\$)	%
EUR	6 461	(174)	(1 291)	4 996				
GBP	2 270	(1)	181	2 450				
CAD	11 419	1 072	(10 624)	1 867				
CHF	1 956	–	(405)	1 551				
JPY	1 549	(30)	(306)	1 213				
HKD	960	2	–	962				
DKK	662	6	–	668				
SGD	623	–	–	623				
NTD	524	–	–	524				
BRL	492	(1)	–	491				
INR	288	8	110	406				
AUD	409	2	(94)	317				
COP	–	–	49	49				
ZAR	–	–	37	37				
NOK	182	–	(185)	(3)				
NZD	–	–	(13)	(13)				
MXN	1 075	5	(1 101)	(21)				
PLN	–	–	(38)	(38)				
SEK	192	–	(309)	(117)				
Total	29 062	889	(13 989)	15 962				
% de l'actif net	34,9	1,1	(16,8)	19,2				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					(3 207)	(3,9)	3 207	3,9

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## NOTES ANNEXES

### 10. Renseignements propres au Fonds (en milliers de \$ US, sauf pour a)) (suite)

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

31 mars 2022

Devise	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Incidence sur l'actif net			
					Renforcement de 5 %		Affaiblissement de 5 %	
					(\$)	%	(\$)	%
CAD	11 108	1 080	(4 365)	7 823				
GBP	2 810	(323)	14	2 501				
CHF	2 739	20	(667)	2 092				
EUR	8 448	307	(6 711)	2 044				
ILS	–	1 723	2	1 725				
JPY	2 057	7	(352)	1 712				
HKD	1 419	5	–	1 424				
SGD	790	32	131	953				
NTD	888	–	–	888				
DKK	821	6	–	827				
BRL	566	–	(44)	522				
INR	362	8	–	370				
AUD	69	(2)	299	366				
NZD	–	–	268	268				
THB	–	–	219	219				
PLN	–	–	88	88				
SEK	300	–	(261)	39				
CLP	–	10	–	10				
MXN	1 333	6	(1 333)	6				
NOK	228	–	(246)	(18)				
ZAR	–	–	(35)	(35)				
RUB	19	–	(69)	(50)				
PEN	–	–	(54)	(54)				
COP	–	–	(58)	(58)				
KOR	–	–	(97)	(97)				
IDR	–	–	(172)	(172)				
EGP	–	–	(346)	(346)				
<b>Total</b>	<b>33 957</b>	<b>2 879</b>	<b>(13 789)</b>	<b>23 047</b>				
% de l'actif net	31,3	2,7	(12,7)	21,3				
<b>Total de la sensibilité aux variations des taux de change</b>					<b>(1 117)</b>	<b>(1,0)</b>	<b>1 154</b>	<b>1,1</b>

\* Comprend les instruments financiers monétaires et non monétaires.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## NOTES ANNEXES

### 10. Renseignements propres au Fonds (en milliers de \$ US, sauf pour a)) (suite)

#### e) Risques découlant des instruments financiers (suite)

##### iii. Risque de taux d'intérêt

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

30 septembre 2022	Obligations (\$)	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
			Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
			(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	1 468	(22 709)				
1 an à 5 ans	10 625	–				
5 ans à 10 ans	11 283	–				
Plus de 10 ans	9 924	–				
Total	33 300	(22 709)				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt			(1 683)	(2,0)	1 683	2,0

31 mars 2022	Obligations (\$)	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
			Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
			(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	3 731	(21 680)				
1 an à 5 ans	8 837	–				
5 ans à 10 ans	14 782	–				
Plus de 10 ans	8 113	–				
Total	35 463	(21 680)				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt			(2 185)	(2,0)	2 184	2,0

##### iv. Autre risque de prix

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

Incidence sur l'actif net	Augmentation de 10 %		Diminution de 10 %	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
30 septembre 2022	4 574	5,5	(4 574)	(5,5)
31 mars 2022	6 328	5,8	(6 329)	(5,8)

##### 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 2022 était de 17,8 % de l'actif net du Fonds (17,4 % au 31 mars 2022).

Au 30 septembre 2022 et au 31 mars 2022, les titres de créance par note de crédit étaient les suivants :

Note des obligations*	30 septembre 2022	31 mars 2022
	% de l'actif net	% de l'actif net
AAA	5,8	1,3
AA	19,8	15,5
A	2,6	2,0
BBB	6,5	5,0
Inférieure à BBB	2,9	3,9
Sans note	2,4	5,0
Total	40,0	32,7

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



# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## NOTES ANNEXES

### 10. Renseignements propres au Fonds (en milliers de \$ US, sauf pour a)) (suite)

#### f) Classement de la juste valeur

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

	30 septembre 2022				31 mars 2022			
	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	–	33 300	–	33 300	–	35 444	19	35 463
Actions	29 407	14 171	10	43 588	40 741	19 934	10	60 685
Options	–	7	–	7	–	7	–	7
Fonds/billets négociés en bourse	1 466	–	–	1 466	1 934	–	–	1 934
Fonds communs de placement	373	–	–	373	467	–	–	467
Fonds privés	–	–	314	314	–	–	200	200
Actifs dérivés	247	909	–	1 156	410	266	–	676
Passifs dérivés	–	(95)	–	(95)	(5)	(453)	–	(458)
Placements à court terme	–	–	–	–	–	5 698	–	5 698
<b>Total</b>	<b>31 493</b>	<b>48 292</b>	<b>324</b>	<b>80 109</b>	<b>43 547</b>	<b>60 896</b>	<b>229</b>	<b>104 672</b>

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

Au cours de la période close le 30 septembre 2022, 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 2022, ces titres étaient classés dans le niveau 2 (niveau 2 au 31 mars 2022).

Le tableau ci-après présente un rapprochement des instruments financiers évalués à la juste valeur à l'aide de données non observables (niveau 3) pour les périodes closes le 30 septembre 2022 et le 31 mars 2022 :

	30 septembre 2022				31 mars 2022			
	Actions (\$)	Obligations (\$)	Fonds privés (\$)	Total (\$)	Actions (\$)	Obligations (\$)	Fonds privés (\$)	Total (\$)
Solde, à l'ouverture	10	19	200	229	–	–	–	–
Achats	–	–	127	127	10	227	190	427
Ventes	–	(311)	–	(311)	–	–	–	–
Transferts entrants	–	–	–	–	–	18	–	18
Transferts sortants	–	–	–	–	–	–	–	–
Profits (pertes) au cours de la période :								
Réalisé(e)s	–	(797)	–	(797)	–	–	–	–
Latent(e)s	–	1 089	(13)	1 076	–	(226)	10	(216)
<b>Solde, à la clôture</b>	<b>10</b>	<b>–</b>	<b>314</b>	<b>324</b>	<b>10</b>	<b>19</b>	<b>200</b>	<b>229</b>
Variation des profits (pertes) latent(e)s au cours de la période attribuables aux titres détenus à la clôture de la période	–	–	(13)	(13)	–	(226)	10	(216)

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

#### g) Placements détenus par le gestionnaire et des sociétés affiliées

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

	30 septembre 2022	31 mars 2022
	(\$)	(\$)
Gestionnaire	10	11
Autres fonds gérés par le gestionnaire	–	–
Fonds gérés par des sociétés affiliées au gestionnaire	–	–

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL EN DOLLARS US MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## NOTES ANNEXES

### 10. Renseignements propres au Fonds (en milliers de \$ US, sauf pour a)) (suite)

#### h) Compensation d'actifs et de passifs financiers

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

	30 septembre 2022			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	1 049	(50)	–	999
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(83)	50	–	(33)
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	966	–	–	966

	31 mars 2022			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	620	(116)	–	504
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(383)	116	512	245
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	237	–	512	749

#### i) Engagement

	30 septembre 2022		31 mars 2022	
	Montant appelé (\$)	Engagement d'investissement total (\$)	Montant appelé (\$)	Engagement d'investissement total (\$)
Northleaf Private Credit II LP <sup>1)</sup>	232	366	172	366
Sagard Credit Partners II LP <sup>2)</sup>	82	366	28	366

<sup>1)</sup> Ce fonds est géré par Northleaf Capital Partners (Canada) Ltd., une société affiliée à Mackenzie.

<sup>2)</sup> Ce fonds est géré par Sagard Holdings Inc., une société affiliée à Mackenzie.