

## **États financiers intermédiaires non audités**

*Pour la période de six mois close le 30 septembre 2020*

*Les présents États financiers intermédiaires non audités ne contiennent pas le Rapport intermédiaire de la direction sur le rendement du Fonds (« RDRF ») du fonds de placement. Vous pouvez obtenir un exemplaire du RDRF intermédiaire gratuitement en communiquant avec nous d'une des façons indiquées à la rubrique Constitution du Fonds et renseignements sur les séries ou en visitant le site Web de SEDAR à l'adresse [www.sedar.com](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 de placement.*

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

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

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



# FONDS ÉQUILIBRÉ DE DURABILITÉ MONDIALE ET D'IMPACT MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

## ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

En milliers (sauf les montants par titre)

Au

	30 sept. 2020	31 mars 2020 (Audité)		30 sept. 2020	31 mars 2020 (Audité)
	\$	\$		\$	\$
<b>ACTIF</b>			<b>Actif net attribuable aux porteurs de titres, par titre (note 3)</b>		
<b>Actifs courants</b>			Série A	11,05	9,99
Placements à la juste valeur	39 761	28 334	Série AR	11,06	10,00
Trésorerie et équivalents de trésorerie	4 659	2 180	Série D	11,25	10,12
Intérêts courus à recevoir	117	64	Série F	11,33	10,17
Dividendes à recevoir	22	38	Série F5	14,96	13,77
Sommes à recevoir pour placements vendus	224	61	Série F8	13,62	12,74
Sommes à recevoir pour titres émis	256	9	Série FB	11,29	10,15
Marge sur instruments dérivés	118	121	Série FB5	14,83	13,67
Profits latents sur les contrats dérivés	118	240	Série O	11,52	10,29
<b>Total de l'actif</b>	<b>45 275</b>	<b>31 047</b>	Série PW	11,11	10,03
			Série PWFB	11,35	10,19
			Série PWFB5	15,05	13,83
<b>PASSIF</b>			Série PWR	10,69	9,64
<b>Passifs courants</b>			Série PWT5	14,58	13,47
Sommes à payer pour placements achetés	344	154	Série PWT8	13,24	12,46
Sommes à payer pour titres rachetés	20	6	Série PWX	11,52	10,29
Sommes à payer au gestionnaire	2	1	Série PWX8	14,00	13,02
Pertes latentes sur les contrats dérivés	69	669	Série T5	14,38	13,32
<b>Total du passif</b>	<b>435</b>	<b>830</b>	Série T8	13,09	12,33
<b>Actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>44 840</b>	<b>30 217</b>	Série LB	10,36	9,37
<b>Actif net attribuable aux porteurs de titres, par série (note 3)</b>			Série LF	10,48	9,41
Série A	11 346	8 796	Série LF5	15,16	13,94
Série AR	1 657	1 182	Série LW	10,38	9,38
Série D	29	21	Série LW5	15,01	13,89
Série F	14 942	9 813	Série LX	14,97	13,87
Série F5	1 237	1 044			
Série F8	3 367	2 829			
Série FB	228	188			
Série FB5	1	1			
Série O	133	119			
Série PW	9 103	4 765			
Série PWFB	271	264			
Série PWFB5	1	1			
Série PWR	58	79			
Série PWT5	1	1			
Série PWT8	1	2			
Série PWX	1	1			
Série PWX8	1	1			
Série T5	93	114			
Série T8	1	1			
Série LB	546	309			
Série LF	128	25			
Série LF5	1	1			
Série LW	1 422	658			
Série LW5	271	1			
Série LX	1	1			

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.



**MACKENZIE**  
Placements

# FONDS ÉQUILIBRÉ DE DURABILITÉ MONDIALE ET D'IMPACT MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

## ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

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

	2020	2019		2020	2019
	\$	\$		\$	\$
<b>Revenus</b>			<b>Série T5</b>	11	–
Dividendes	182	192	<b>Série T8</b>	–	–
Revenu d'intérêts	180	194	<b>Série LB</b>	37	–
Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets			<b>Série LF</b>	3	–
Profit (perte) net(te) réalisé(e)	373	57	<b>Série LF5</b>	–	–
Profit (perte) net(te) latent(e)	3 273	36	<b>Série LW</b>	88	–
Revenu tiré du prêt de titres	1	1	<b>Série LW5</b>	4	–
<b>Total des revenus (pertes)</b>	<b>4 009</b>	<b>480</b>	<b>Série LX</b>	–	–
<b>Charges (note 6)</b>			<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, par titre</b>		
Frais de gestion	275	162	<b>Série A</b>	1,02	0,12
Frais d'administration	38	24	<b>Série AR</b>	1,00	0,09
Intérêts débiteurs	1	–	<b>Série D</b>	1,07	0,14
Commissions et autres coûts de transaction liés au portefeuille	15	17	<b>Série F</b>	1,09	0,14
Frais du Comité d'examen indépendant	–	–	<b>Série F5</b>	1,52	0,17
<b>Charges avant les montants absorbés par le gestionnaire</b>	<b>329</b>	<b>203</b>	<b>Série F8</b>	1,37	0,17
Charges absorbées par le gestionnaire	–	–	<b>Série FB</b>	1,20	0,11
<b>Charges nettes</b>	<b>329</b>	<b>203</b>	<b>Série FB5</b>	1,52	0,20
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, avant impôt</b>	<b>3 680</b>	<b>277</b>	<b>Série O</b>	1,23	0,21
Impôt étranger retenu à la source	23	21	<b>Série PW</b>	0,93	0,06
Impôt étranger sur le résultat payé (recouvré)	–	–	<b>Série PWFB</b>	1,61	0,04
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation</b>	<b>3 657</b>	<b>256</b>	<b>Série PWFB5</b>	1,58	0,24
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, par série</b>			<b>Série PWR</b>	1,14	(0,11)
<b>Série A</b>	<b>989</b>	<b>86</b>	<b>Série PWT5</b>	1,47	0,02
<b>Série AR</b>	<b>135</b>	<b>7</b>	<b>Série PWT8</b>	1,57	0,15
<b>Série D</b>	<b>3</b>	<b>1</b>	<b>Série PWX</b>	1,23	0,21
<b>Série F</b>	<b>1 250</b>	<b>98</b>	<b>Série PWX8</b>	1,52	0,28
<b>Série F5</b>	<b>119</b>	<b>6</b>	<b>Série T5</b>	1,39	(0,16)
<b>Série F8</b>	<b>311</b>	<b>42</b>	<b>Série T8</b>	1,29	0,53
<b>Série FB</b>	<b>23</b>	<b>1</b>	<b>Série LB</b>	0,85	–
<b>Série FB5</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>Série LF</b>	0,55	–
<b>Série O</b>	<b>15</b>	<b>–</b>	<b>Série LF5</b>	1,59	–
<b>Série PW</b>	<b>631</b>	<b>16</b>	<b>Série LW</b>	0,83	–
<b>Série PWFB</b>	<b>29</b>	<b>–</b>	<b>Série LW5</b>	0,59	–
<b>Série PWFB5</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>Série LX</b>	0,17	–
<b>Série PWR</b>	<b>9</b>	<b>(2)</b>			
<b>Série PWT5</b>	<b>–</b>	<b>1</b>			
<b>Série PWT8</b>	<b>–</b>	<b>–</b>			
<b>Série PWX</b>	<b>–</b>	<b>–</b>			
<b>Série PWX8</b>	<b>–</b>	<b>–</b>			

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.



**MACKENZIE**  
Placements



# FONDS ÉQUILIBRÉ DE DURABILITÉ MONDIALE ET D'IMPACT MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

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

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

	2020	2019	2020	2019	2020	2019	2020	2019
	Série PWFB		Série PWFB5		Série PWR		Série PWT5	
	\$		\$		\$		\$	
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>								
<b>À l'ouverture</b>	264	33	1	1	79	-	1	1
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	29	-	-	-	9	(2)	-	1
Distributions aux porteurs de titres :								
Revenu de placement	-	-	-	-	-	-	-	-
Gains en capital	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-	-	(1)
Total des distributions aux porteurs de titres	-	-	-	-	-	-	-	(1)
Opérations sur les titres :								
Produit de l'émission de titres	20	37	-	-	-	213	-	70
Réinvestissement des distributions	-	-	-	-	-	-	-	-
Paiements au rachat de titres	(42)	-	-	-	(30)	-	-	(3)
Total des opérations sur les titres	(22)	37	-	-	(30)	213	-	67
<b>Augmentation (diminution) totale de l'actif net</b>	<b>7</b>	<b>37</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(21)</b>	<b>211</b>	<b>-</b>	<b>67</b>
<b>À la clôture</b>	<b>271</b>	<b>70</b>	<b>1</b>	<b>1</b>	<b>58</b>	<b>211</b>	<b>1</b>	<b>68</b>

Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) :	Titres		Titres		Titres		Titres	
<b>Titres en circulation, à l'ouverture</b>	26	3	-	-	8	-	-	-
Émis	2	4	-	-	-	21	-	5
Réinvestissement des distributions	-	-	-	-	-	-	-	-
Rachetés	(4)	-	-	-	(3)	-	-	-
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>24</b>	<b>7</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>5</b>	<b>21</b>	<b>-</b>	<b>5</b>

	Série PWT8		Série PWX		Série PWX8		Série T5	
	\$		\$		\$		\$	
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>								
<b>À l'ouverture</b>	2	1	1	1	1	1	114	6
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	-	-	-	-	-	-	11	-
Distributions aux porteurs de titres :								
Revenu de placement	-	-	-	-	-	-	-	-
Gains en capital	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-	(3)	-
Total des distributions aux porteurs de titres	-	-	-	-	-	-	(3)	-
Opérations sur les titres :								
Produit de l'émission de titres	-	-	-	-	-	-	-	9
Réinvestissement des distributions	-	-	-	-	-	-	-	-
Paiements au rachat de titres	(1)	-	-	-	-	-	(29)	-
Total des opérations sur les titres	(1)	-	-	-	-	-	(29)	9
<b>Augmentation (diminution) totale de l'actif net</b>	<b>(1)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(21)</b>	<b>9</b>
<b>À la clôture</b>	<b>1</b>	<b>1</b>	<b>1</b>	<b>1</b>	<b>1</b>	<b>1</b>	<b>93</b>	<b>15</b>

Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) :	Titres		Titres		Titres		Titres	
<b>Titres en circulation, à l'ouverture</b>	-	-	-	-	-	-	9	-
Émis	-	-	-	-	-	-	-	1
Réinvestissement des distributions	-	-	-	-	-	-	-	-
Rachetés	-	-	-	-	-	-	(3)	-
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>6</b>	<b>1</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.



**MACKENZIE**  
Placements

# FONDS ÉQUILIBRÉ DE DURABILITÉ MONDIALE ET D'IMPACT MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

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

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

	2020		2019		2020		2019		2020		2019	
	Série T8		Série LB		Série LF		Série LF5					
	\$		\$		\$		\$					
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>												
<b>À l'ouverture</b>	1	14	309	-	25	-	1	-				
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	-	-	37	-	3	-	-	-				
Distributions aux porteurs de titres :												
Revenu de placement	-	-	-	-	-	-	-	-				
Gains en capital	-	-	-	-	-	-	-	-				
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-	-	-				
Total des distributions aux porteurs de titres	-	-	-	-	-	-	-	-				
Opérations sur les titres :												
Produit de l'émission de titres	-	-	355	-	100	-	-	-				
Réinvestissement des distributions	-	-	-	-	-	-	-	-				
Paiements au rachat de titres	-	(13)	(155)	-	-	-	-	-				
Total des opérations sur les titres	-	(13)	200	-	100	-	-	-				
<b>Augmentation (diminution) totale de l'actif net</b>	-	(13)	237	-	103	-	-	-				
<b>À la clôture</b>	1	1	546	-	128	-	1	-				

Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) :	Titres		Titres		Titres		Titres	
<b>Titres en circulation, à l'ouverture</b>	-	1	33	-	3	-	-	-
Émis	-	-	36	-	9	-	-	-
Réinvestissement des distributions	-	-	-	-	-	-	-	-
Rachetés	-	(1)	(16)	-	-	-	-	-
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	-	-	53	-	12	-	-	-

	Série LW		Série LW5		Série LX		Total	
	\$		\$		\$		\$	
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>								
<b>À l'ouverture</b>	658	-	1	-	1	-	30 217	22 433
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	88	-	4	-	-	-	3 657	256
Distributions aux porteurs de titres :								
Revenu de placement	-	-	-	-	-	-	(19)	(47)
Gains en capital	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	(3)	-	-	-	(144)	(96)
Total des distributions aux porteurs de titres	-	-	(3)	-	-	-	(163)	(143)
Opérations sur les titres :								
Produit de l'émission de titres	710	-	266	-	100	-	16 761	7 542
Réinvestissement des distributions	-	-	3	-	-	-	92	85
Paiements au rachat de titres	(34)	-	-	-	(100)	-	(5 724)	(6 578)
Total des opérations sur les titres	676	-	269	-	-	-	11 129	1 049
<b>Augmentation (diminution) totale de l'actif net</b>	764	-	270	-	-	-	14 623	1 162
<b>À la clôture</b>	1 422	-	271	-	1	-	44 840	23 595

Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) :	Titres		Titres		Titres	
<b>Titres en circulation, à l'ouverture</b>	70	-	-	-	-	-
Émis	70	-	18	-	7	-
Réinvestissement des distributions	-	-	-	-	-	-
Rachetés	(3)	-	-	-	(7)	-
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	137	-	18	-	-	-

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.



**MACKENZIE**  
Placements

# FONDS ÉQUILIBRÉ DE DURABILITÉ MONDIALE ET D'IMPACT MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

## TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

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

	2020	2019
	\$	\$
<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	3 657	256
Ajustements pour :		
Perte (profit) net(te) réalisé(e) sur les placements	(705)	(313)
Variation de la perte (du profit) net(te) latent(e) sur les placements	(3 273)	(36)
Achat de placements	(24 517)	(8 331)
Produit de la vente et de l'échéance de placements	16 617	7 478
Variation des intérêts courus à recevoir	(53)	1
Variation des dividendes à recevoir	16	17
Variation de la marge sur instruments dérivés	3	67
Variation des sommes à payer au gestionnaire	1	–
<b>Trésorerie nette liée aux activités d'exploitation</b>	<b>(8 254)</b>	<b>(861)</b>

## Flux de trésorerie liés aux activités de financement

Produit de l'émission de titres	13 902	6 790
Paievements au rachat de titres	(3 098)	(5 848)
Distributions versées, déduction faite des réinvestissements	(71)	(58)
<b>Trésorerie nette liée aux activités de financement</b>	<b>10 733</b>	<b>884</b>

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

	<b>2 479</b>	<b>23</b>
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à l'ouverture	2 180	794
Incidence des fluctuations des taux de change sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie	–	(2)
<b>Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture</b>	<b>4 659</b>	<b>815</b>

Trésorerie	1 294	815
Équivalents de trésorerie	3 365	–
<b>Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture</b>	<b>4 659</b>	<b>815</b>

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

Dividendes reçus	198	209
Impôts étrangers payés	23	21
Intérêts reçus	127	195
Intérêts versés	1	–

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.



**MACKENZIE**  
Placements

# FONDS ÉQUILIBRÉ DE DURABILITÉ MONDIALE ET D'IMPACT MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

## TABLEAU DES PLACEMENTS

Au 30 septembre 2020

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
<b>OBLIGATIONS</b>					
Advanced Micro Devices Inc. 7,50 % 15-08-2022	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	40 000 USD	57	59
AES Panama Generation Holdings SRL 4,38 % 31-05-2030, rachetables 2030	Panama	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	273	274
Albertsons Cos. Inc. 4,63 % 15-01-2027, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000 USD	28	27
Albertsons Cos. Inc. 5,88 % 15-02-2028, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000 USD	14	14
Alcami Carolinas Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 06-07-2025	États-Unis	Prêts à terme	9 800 USD	13	11
Algonquin Power & Utilities Corp. 4,09 % 17-02-2027, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	65 000	67	73
Algonquin Power Co. 4,60 % 29-01-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000	139	141
AltaLink, L.P. 1,51 % 11-09-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	10
American Tower Corp. 1,88 % 15-10-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000 USD	13	13
APFS Staffing Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 10-04-2026	États-Unis	Prêts à terme	9 875 USD	13	13
Apple Inc. 3,35 % 10-01-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	30 000 AUD	29	31
Apple Inc. 2,51 % 19-08-2024, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	253 000	261	269
ARD Finance SA 6,50 % 30-06-2027, rachetables 2022 144A	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	271	265
AT&T Inc. 2,25 % 01-02-2032, rachetables 2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	120 000 USD	159	160
Atlantica Sustainable Infrastructure Jersey Ltd. 4,00 % 15-07-2025, conv.	Espagne	Sociétés – Convertibles	100 000 USD	135	135
Bank of America Corp. 3,30 % 24-04-2024, rachetables 2023	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	110 000	116	116
Bank of America Corp., taux variable 25-04-2025, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	21
Bank of America Corp., taux variable 22-10-2025, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	139	141
Banque d'Israël 0 % 02-12-2020	Israël	Gouvernements étrangers	527 000 ILS	201	205
La Banque de Nouvelle-Écosse 2,38 % 18-01-2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	137	139
La Banque de Nouvelle-Écosse 2,98 % 17-04-2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	110 000	116	116
bclMC Realty Corp. 1,75 % 24-07-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	210 000	210	211
Bell Canada Inc. 2,70 % 27-02-2024, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	75 000	74	79
Bell Canada Inc. 1,65 % 16-08-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	20
Bell Canada Inc. 2,90 % 10-09-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	15 000	15	16
Brookfield Infrastructure Finance ULC 4,20 % 11-09-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	128 000	142	148
Brookfield Infrastructure Finance ULC 3,41 % 09-10-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	140 000	145	153
Brookfield Property REIT Inc. 5,75 % 15-05-2026, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	105	105
Brookfield Renewable Energy Partners ULC 3,63 % 15-01-2027, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	55 000	55	61
Brookfield Renewable Partners ULC 4,25 % 15-01-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000	100	117
Brookfield Renewable Partners ULC 3,38 % 15-01-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000	40	44
Brookfield Renewable Partners ULC 4,29 % 05-11-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	60 000	60	71
Calpine Corp. 5,25 % 01-06-2026, rachetables 2021, BDVP1Z6	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	40 000 USD	50	55
Capital Power Corp. 3,15 % 01-10-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000	30	30
Cascades inc. 5,13 % 15-01-2026, rachetables 2023 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	95 000 USD	132	133
Celulosa Arauco y Constitución SA 4,20 % 29-01-2030, rachetables 2029	Chili	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	263	282
Charter Communications Operating LLC 2,80 % 01-04-2031, rachetables 2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000 USD	28	28



**MACKENZIE**  
Placements



# FONDS ÉQUILIBRÉ DE DURABILITÉ MONDIALE ET D'IMPACT MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2020

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Chartwell résidences pour retraités 4,21 % 28-04-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	135 000	140	141
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 3,55 % 10-01-2025, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	22
Ville d'Oslo, taux variable 06-05-2026	Norvège	Gouvernements étrangers	1 000 000 NOK	155	143
Ville de Toronto 2,60 % 24-09-2039	Canada	Administrations municipales	110 000	109	118
Clearway Energy Operating LLC 4,75 % 15-03-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	136	139
The Clorox Co. 1,80 % 15-05-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	15 000 USD	21	21
Coca-Cola FEMSA SAB de CV 1,85 % 01-09-2032, rachetables 2032	Mexique	Sociétés – Non convertibles	150 000 USD	196	201
Comber Wind Financial Corp. 5,13 % 15-11-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	34 439	37	40
Corporación Andina de Fomento 3,25 % 11-02-2022	Suprationales	s.o.	100 000 USD	135	137
Covanta Holding Corp. 5,88 % 01-07-2025, rachetables 2020	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	133	138
Covanta Holding Corp. 5,00 % 01-09-2030, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	133	134
CPPIB Capital Inc. 1,95 % 30-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000	40	43
CU Inc. 3,76 % 19-11-2046, rachetables 2046	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000	51	60
Dell International LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 19-09-2025	États-Unis	Prêts à terme	42 954 USD	54	57
Deutsche Bundesrepublik, obligations indexées sur l'inflation 0,50 % 15-04-2030	Allemagne	Gouvernements étrangers	110 000 EUR	204	214
Dollar General Corp. 4,13 % 01-05-2028, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	30 000 USD	45	47
Dollarama inc. 1,51 % 20-09-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	10
Drax Group PLC 6,63 % 01-11-2025, rachetables 2021 144A	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	276	278
Empresas Públicas de Medellín ESP 4,38 % 15-02-2031	Colombie	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	266	268
Enbridge Inc., taux variable 12-04-2078, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	130 000	140	140
ENC Holding Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 30-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	9 811 USD	13	12
EPCOR Utilities Inc. 3,11 % 08-07-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	22
Banque européenne d'investissement 1,25 % 05-11-2020	Suprationales	s.o.	100 000	98	100
Foundation Building Materials LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 11-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	9 825 USD	13	13
Fresenius US Finance II Inc. 4,25 % 01-02-2021	Allemagne	Sociétés – Non convertibles	75 000 USD	101	101
Fusion Connect Inc., prêt à terme (paiement en nature) de premier rang, taux variable 14-07-2025	États-Unis	Prêts à terme	3 924 USD	14	2
Gouvernement de l'Australie 2,50 % 21-05-2030	Australie	Gouvernements étrangers	470 000 AUD	504	518
Gouvernement de l'Australie 1,00 % 21-12-2030	Australie	Gouvernements étrangers	510 000 AUD	465	492
Gouvernement de l'Australie 1,75 % 21-06-2051	Australie	Gouvernements étrangers	190 000 AUD	174	181
Gouvernement du Canada 1,50 % 01-09-2024	Canada	Gouvernement fédéral	10 000	10	10
Gouvernement du Japon 0 % 22-02-2021	Japon	Gouvernements étrangers	16 300 000 JPY	204	206
Gouvernement de l'Australie-Méridionale 3,00 % 24-05-2028	Australie	Gouvernements étrangers	130 000 AUD	131	143
Gouvernement de la Suède 0,13 % 09-09-2030	Suède	Gouvernements étrangers	2 000 000 SEK	302	304
HAT Holdings I LLC 5,25 % 15-07-2024, rachetables 2021 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	131	139
HCA Healthcare Inc. 3,50 % 01-09-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	110 000 USD	151	150
Heathrow Funding Ltd. 3,40 % 08-03-2028	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	21
Heathrow Funding Ltd. 3,79 % 04-09-2030, rachetables 2030	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	21
Honda Canada Finance Inc. 1,34 % 17-03-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	20
Hydro One Inc. 2,54 % 05-04-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	21



**MACKENZIE**  
Placements

# FONDS ÉQUILIBRÉ DE DURABILITÉ MONDIALE ET D'IMPACT MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2020

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Hydro One Inc. 3,72 % 18-11-2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000	50	60
Hydro One Ltd. 1,41 % 15-10-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	20
Hydro-Québec 4,00 % 15-02-2055	Canada	Gouvernements provinciaux	50 000	59	74
Institutional Shareholder Services Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 26-02-2026	États-Unis	Prêts à terme	9 850 USD	13	13
Interior Logic Group Holdings IV LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 21-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	19 600 USD	25	25
Ivanhoe Cambridge II Inc. 2,30 % 12-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	21
John Deere Financial Inc. 1,34 % 08-09-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	20
JPMorgan Chase & Co. 3,19 % 05-03-2021	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	30 000	31	30
Kimco Realty Corp. 2,70 % 01-10-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	268	271
Kommunalbanken AS 2,13 % 11-02-2025	Norvège	Gouvernements étrangers	200 000 USD	251	286
Kommuninvest I Sverige AB 2,50 % 01-12-2020	Suède	Gouvernements étrangers	900 000 SEK	149	134
The Korea Development Bank 5,13 % 13-11-2020	Corée du Sud	Gouvernements étrangers	150 000 NZD	137	133
The Kroger Co. 3,95 % 15-01-2050, rachetables 2049	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	15 000 USD	21	24
Produits Kruger s.e.c. 6,00 % 24-04-2025, rachetables 2021	Canada	Sociétés – Non convertibles	140 000	139	140
Les Compagnies Loblaw Itée 2,28 % 07-05-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	21
LogMeIn Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 14-08-2027	États-Unis	Prêts à terme	130 000 USD	167	168
Société Financière Manuvie, taux variable 09-05-2028, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	140 000	146	147
Meredith Corp., prêt à terme B de premier rang 31-01-2025	États-Unis	Prêts à terme	19 950 USD	26	26
Metronet Systems Holding LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 31-12-2049	États-Unis	Prêts à terme	3 990 USD	5	5
MidAmerican Energy Co. 3,95 % 01-08-2047, rachetables 2047	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	80 000 USD	124	132
Morgan Stanley 3,00 % 07-02-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000	100	106
Nederlandse Waterschapsbank NV 1,00 % 28-05-2030	Pays-Bas	Gouvernements étrangers	200 000 USD	276	264
NextEra Energy Capital Holdings Inc., 2,25 % 01-06-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	142	139
Nokia OYJ 3,38 % 12-06-2022	Finlande	Sociétés – Non convertibles	40 000 USD	51	54
Norbord Inc. 5,75 % 15-07-2027, rachetables 2022 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	140	141
Northland Power Solar Finance One L.P. 4,40 % 30-06-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	36 613	39	42
OMERS Finance Trust 1,55 % 21-04-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000	50	51
OMERS Finance Trust 2,60 % 14-05-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	22
Ontario Power Generation Inc. 2,98 % 13-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000	50	55
Ontario Power Generation Inc. 3,22 % 08-04-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	130 000	144	145
Ontario Power Generation Inc. 3,84 % 22-06-2048, rachetables 2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000	41	47
Pattern Energy Operations LP 4,50 % 15-08-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	60 000 USD	82	83
Pembina Pipeline Corp. 3,62 % 03-04-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	22
PepsiCo Inc. 3,00 % 15-10-2027, rachetables 2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	128	150
Province de l'Ontario 2,60 % 02-06-2025	Canada	Gouvernements provinciaux	264 000	279	287
Province de l'Ontario 2,65 % 02-12-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	5 000	6	6
Province de Québec 2,25 % 22-02-2024	Canada	Gouvernements provinciaux	40 000	40	42
PSP Capital Inc. 2,05 % 15-01-2030	Canada	Gouvernement fédéral	50 000	50	53
Rogers Communications Inc. 4,00 % 13-03-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	75 000	80	82
Rogers Communications Inc. 3,65 % 31-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	130 000	143	146
Banque Royale du Canada 2,95 % 01-05-2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	110 000	116	116



**MACKENZIE**  
Placements

# FONDS ÉQUILBRÉ DE DURABILITÉ MONDIALE ET D'IMPACT MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILBRÉ

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2020

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Saputo inc. 2,24 % 16-06-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	21
Shaw Communications Inc. 2,90 % 09-12-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000	30	32
Sienna Senior Living Inc. 3,11 % 04-11-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	145 000	142	145
Sienna Senior Living Inc. 3,45 % 27-02-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	10
Sigma Bidco BV, prêt à terme B de premier rang, taux variable 07-03-2025	Pays-Bas	Prêts à terme	10 000 EUR	16	15
SmartCentres Real Estate Investment Trust 3,19 % 11-06-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	140 000	143	146
South Coast British Columbia Transportation Authority 1,60 % 03-07-2030	Canada	Gouvernements provinciaux	20 000	20	20
Summit Industrial Income Real Estate Investment Trust 2,15 % 17-09-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	10
Financière Sun Life inc., taux variable 01-10-2035	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000	30	30
TELUS Corp. 2,35 % 27-01-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000	124	125
TELUS Corp. 3,15 % 19-02-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	15 000	15	16
TELUS Corp. 2,05 % 07-10-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	20
Tenet Healthcare Corp. 4,88 % 01-01-2026, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	137	136
Thomson Reuters Corp. 2,24 % 14-05-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	21
T-Mobile USA Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-04-2027	États-Unis	Prêts à terme	9 975 USD	14	13
Groupe TMX Ltée 3,78 % 05-06-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	110 000	123	126
TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	140 000	138	139
Trillium Windpower LP 5,80 % 15-02-2033	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	18 519	21	23
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2023	États-Unis	Gouvernements étrangers	150 000 USD	205	231
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,63 % 15-04-2023	États-Unis	Gouvernements étrangers	150 000 USD	203	218
Obligations du Trésor des États-Unis 1,13 % 28-02-2027	États-Unis	Gouvernements étrangers	500 000 USD	742	695
Obligations du Trésor des États-Unis 2,25 % 15-08-2027	États-Unis	Gouvernements étrangers	50 000 USD	62	75
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,50 % 15-01-2028	États-Unis	Gouvernements étrangers	90 000 USD	119	141
Obligations du Trésor des États-Unis 0,63 % 15-05-2030	États-Unis	Gouvernements étrangers	76 000 USD	100	101
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-07-2030	États-Unis	Gouvernements étrangers	300 000 USD	445	444
Obligations du Trésor des États-Unis 3,00 % 15-02-2047	États-Unis	Gouvernements étrangers	50 000 USD	65	90
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,01 % 15-02-2048	États-Unis	Gouvernements étrangers	123 500 USD	164	239
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,00 % 15-02-2049	États-Unis	Gouvernements étrangers	187 400 USD	319	359
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,25 % 15-02-2050	États-Unis	Gouvernements étrangers	250 000 USD	387	392
Obligations du Trésor des États-Unis 2,00 % 15-02-2050	États-Unis	Gouvernements étrangers	220 000 USD	367	332
Administration de l'aéroport de Vancouver 3,66 % 23-11-2048, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	23
Ventas Inc. 2,80 % 12-04-2024, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	150 000	148	152
Verizon Communications Inc. 2,50 % 16-05-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	130 000	135	137
Walgreen Co. 4,40 % 15-09-2042	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000 USD	24	29
Waste Management of Canada Corp. 2,60 % 23-09-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000	105	107



**MACKENZIE**  
Placements

# FONDS ÉQUILIBRÉ DE DURABILITÉ MONDIALE ET D'IMPACT MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2020

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Xperi Holding Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-06-2025	États-Unis	Prêts à terme	128 375 USD	163	167
Xplornet Communications Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 29-05-2027	Canada	Prêts à terme	119 700 USD	156	157
<b>Total des obligations</b>				<b>17 042</b>	<b>17 553</b>
<b>ACTIONS</b>					
Aflac Inc.	États-Unis	Services financiers	9 203	543	445
Mines Agnico Eagle Ltée	Canada	Matières	3 120	231	331
Air Liquide SA	France	Matières	1 029	227	217
Alnylam Pharmaceuticals Inc.	États-Unis	Soins de santé	1 017	149	197
Amazon.com Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	152	339	637
American Campus Communities Inc.	États-Unis	Immobilier	3 294	167	153
American Water Works Co. Inc.	États-Unis	Services publics	966	177	186
Apple Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	4 259	400	657
Applied Materials Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	3 055	196	242
Becton, Dickinson and Co.	États-Unis	Soins de santé	1 502	454	465
BioMarin Pharmaceutical Inc.	États-Unis	Soins de santé	2 230	253	226
CapitaLand Mall Trust	Singapour	Immobilier	109 600	217	208
Carrier Global Corp.	États-Unis	Produits industriels	6 737	231	274
Cerner Corp.	États-Unis	Soins de santé	2 989	276	288
Cognex Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	1 503	107	130
Compagnie de Saint-Gobain	France	Produits industriels	9 373	513	524
Continental AG	Allemagne	Consommation discrétionnaire	2 215	366	320
Crown Holdings Inc.	États-Unis	Matières	2 835	254	290
Deere & Co.	États-Unis	Produits industriels	1 493	324	441
Deutsche Post AG, nom.	Allemagne	Produits industriels	9 564	362	581
Discover Financial Services	États-Unis	Services financiers	4 420	310	340
Eisai Co. Ltd.	Japon	Soins de santé	1 600	171	194
Enel SPA	Italie	Services publics	52 858	527	611
Facebook Inc.	États-Unis	Services de communication	1 935	478	675
Fidelity National Information Services Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	806	154	158
First Horizon National Corp.	États-Unis	Services financiers	11 589	198	145
First Solar Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	1 344	112	118
Fusion Connect Inc., bons de souscription éch. 14-01-2040	États-Unis	Services de communication	164	—	—
GlaxoSmithKline PLC, CAAE	Royaume-Uni	Soins de santé	6 414	355	321
HeidelbergCement AG	Allemagne	Matières	5 059	485	413
ICICI Bank Ltd., CAAE	Inde	Services financiers	16 245	212	213
Illumina Inc.	États-Unis	Soins de santé	331	113	136
Intact Corporation financière	Canada	Services financiers	1 745	228	249
Ionis Pharmaceuticals Inc.	États-Unis	Soins de santé	1 909	148	121
KDDI Corp.	Japon	Services de communication	13 100	460	441
Keysight Technologies Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	1 289	173	170
KION Group AG	Allemagne	Produits industriels	1 330	131	152
Kohl's Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	6 127	201	151
KT Corp., CAAE	Corée du Sud	Services de communication	13 904	220	178
KT Corp.	Corée du Sud	Services de communication	7 461	210	195
Kyocera Corp.	Japon	Technologie de l'information	4 200	337	320
Lloyds Banking Group PLC	Royaume-Uni	Services financiers	587 435	522	266



**MACKENZIE**  
Placements

# FONDS ÉQUILIBRÉ DE DURABILITÉ MONDIALE ET D'IMPACT MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2020

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
<b>ACTIONS (suite)</b>					
Lyft Inc.	États-Unis	Produits industriels	889	38	33
Martin Marietta Materials Inc.	États-Unis	Matières	449	138	141
Medtronic PLC	États-Unis	Soins de santé	2 164	251	299
Micron Technology Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	4 417	264	276
Microsoft Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	3 907	680	1 093
Neurocrine Biosciences Inc.	États-Unis	Soins de santé	903	118	116
Nintendo Co. Ltd.	Japon	Services de communication	400	247	303
Panasonic Corp.	Japon	Consommation discrétionnaire	13 800	167	156
The Progressive Corp.	États-Unis	Services financiers	6 173	663	777
Reckitt Benckiser Group PLC	Royaume-Uni	Consommation courante	868	97	113
Regeneron Pharmaceuticals Inc.	États-Unis	Soins de santé	204	114	152
Reinsurance Group of America Inc.	États-Unis	Services financiers	3 497	431	443
Roche Holding AG Genussscheine	Suisse	Soins de santé	805	398	367
Schneider Electric SE	France	Produits industriels	5 123	640	845
SolarEdge Technologies Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	473	112	150
Sony Corp.	Japon	Consommation discrétionnaire	4 300	294	438
Svenska Handelsbanken AB, A	Suède	Services financiers	23 646	313	265
Swedbank AB	Suède	Services financiers	15 068	383	314
TE Connectivity Ltd.	États-Unis	Technologie de l'information	2 236	255	291
Tele2 AB	Suède	Services de communication	15 377	294	289
Tencent Holdings Ltd.	Chine	Services de communication	4 100	272	364
Verizon Communications Inc.	États-Unis	Services de communication	8 891	692	703
Vestas Wind Systems AS	Danemark	Produits industriels	657	118	142
Visa Inc., cat. A	États-Unis	Technologie de l'information	1 349	256	359
Vonovia SE	Allemagne	Immobilier	7 003	468	641
Willis Towers Watson PLC	États-Unis	Services financiers	1 989	533	553
<b>Total des actions</b>				<b>19 767</b>	<b>22 002</b>
<b>OPTIONS</b>					
Options achetées (se reporter au tableau des options achetées)				6	1
<b>Total des options</b>				<b>6</b>	<b>1</b>
<b>FONDS/BILLETS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>					
Xtrackers MSCI USA ESG Leaders Equity ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	5 016	195	205
<b>Total des fonds/billets négociés en bourse</b>				<b>195</b>	<b>205</b>
Coûts de transaction				(22)	—
<b>Total des placements</b>				<b>36 988</b>	<b>39 761</b>
Instruments dérivés					
(se reporter au tableau des instruments dérivés)					
Obligation pour options vendues (se reporter au tableau des options vendues)					49
Trésorerie et équivalents de trésorerie					—
Autres éléments d'actif moins le passif					4 659
<b>Total de l'actif net</b>					<b>371</b>
					<b>44 840</b>



**MACKENZIE**  
Placements

# FONDS ÉQUILIBRÉ DE DURABILITÉ MONDIALE ET D'IMPACT MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

## APERÇU DU PORTEFEUILLE

30 septembre 2020	
Répartition du portefeuille	% de la VL
Actions	49,0
Obligations	44,5
<i>Obligations</i>	39,1
<i>Positions acheteur sur contrats à terme</i>	5,4
<i>Positions vendeur sur contrats à terme</i>	(0,0)
Trésorerie et placements à court terme	5,0
Autres éléments d'actif (de passif)	1,0
Fonds/billets négociés en bourse	0,5
Options sur devises achetées	0,0
Options sur devises vendues	(0,0)

Répartition régionale		% de la VL
États-Unis		47,8
Canada		12,9
Allemagne		5,4
Autre		5,3
Trésorerie et placements à court terme		5,0
Japon		4,6
Australie		3,6
France		3,5
Suède		2,9
Royaume-Uni		2,3
Italie		1,4
Corée du Sud		1,1
Norvège		1,0
Autres éléments d'actif (de passif)		1,0
Suisse		0,8
Chine		0,8
Chili		0,6

Répartition sectorielle		% de la VL
Obligations de sociétés		21,0
Obligations d'État étrangères		20,0
Services financiers		8,9
Technologie de l'information		8,8
Services de communication		7,0
Produits industriels		6,7
Soins de santé		6,4
Trésorerie et placements à court terme		5,0
Consommation discrétionnaire		3,8
Matières		3,1
Immobilier		2,2
Services publics		1,8
Prêts à terme		1,6
Autre		1,2
Obligations provinciales		1,0
Autres éléments d'actif (de passif)		1,0
Obligations supranationales		0,5

31 mars 2020	
Répartition du portefeuille	% de la VL
Obligations	51,7
<i>Obligations</i>	48,1
<i>Positions acheteur sur contrats à terme</i>	3,5
<i>Positions vendeur sur contrats à terme</i>	0,1
Actions	44,9
Trésorerie et placements à court terme	3,8
Fonds/billets négociés en bourse	0,6
Options sur devises achetées	0,1
Autres éléments d'actif (de passif)	(1,1)

Répartition régionale		% de la VL
États-Unis		56,6
Canada		10,6
Japon		4,9
Allemagne		4,6
Autre		4,3
France		3,9
Trésorerie et placements à court terme		3,8
Norvège		2,8
Royaume-Uni		2,5
Bermudes		1,8
Chine		1,3
Italie		1,1
Suisse		1,1
Suède		1,0
Chili		0,8
Autres éléments d'actif (de passif)		(1,1)

Répartition sectorielle		% de la VL
Obligations d'État étrangères		32,1
Obligations de sociétés		11,4
Services de communication		10,2
Services financiers		7,1
Technologie de l'information		7,0
Soins de santé		6,9
Produits industriels		5,3
Trésorerie et placements à court terme		3,8
Autre		3,8
Consommation discrétionnaire		3,1
Prêts à terme		2,9
Obligations fédérales		2,4
Énergie		1,4
Obligations provinciales		1,3
Immobilier		1,2
Matières		1,2
Autres éléments d'actif (de passif)		(1,1)



**MACKENZIE**  
Placements

# FONDS ÉQUILBRÉ DE DURABILITÉ MONDIALE ET D'IMPACT MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILBRÉ

## TABLEAU DES OPTIONS ACHETÉES

Au 30 septembre 2020

Élément sous-jacent	Nombre de contrats	Type d'option	Date d'échéance	Prix d'exercice \$	Prime payée \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
Option d'achat sur devises USD/EUR	30 000	Achat	14 octobre 2020	1,20 USD	1	–
Option de vente sur devises JPY/USD	500 000	Vente	13 novembre 2020	101,00 JPY	2	1
Option d'achat sur devises SAR/USD	960 000	Achat	8 mars 2021	4,00 SAR	3	–
<b>Total des options</b>					<b>6</b>	<b>1</b>

## TABLEAU DES OPTIONS VENDUES

Au 30 septembre 2020

Élément sous-jacent	Nombre de contrats	Type d'option	Date d'échéance	Prix d'exercice \$	Prime reçue \$ (en milliers)	Juste valeur \$ (en milliers)
Option de vente sur devises JPY/USD	(500 000)	Option de vente vendue	13 novembre 2020	97,00 JPY	(1)	–
<b>Total des options</b>					<b>(1)</b>	<b>–</b>



**MACKENZIE**  
Placements

# FONDS ÉQUILIBRÉ DE DURABILITÉ MONDIALE ET D'IMPACT MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS

Au 30 septembre 2020

### Tableau des contrats à terme standardisés

Nombre de contrats	Type de contrat	Date d'échéance	Prix moyen des contrats (\$)	Montant notionnel* \$ (en milliers)	Profits (pertes) latent(e)s \$ (en milliers)
9	Contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans, décembre 2020	21 décembre 2020	159,47 USD	1 916	5
1	Contrats à terme sur obligations à long terme du Trésor américain, décembre 2020	21 décembre 2020	175,38 USD	235	1
Profits latents				2 151	6
(1)	Contrats à terme sur obligations Euro-Buxl à 30 ans, décembre 2020	8 décembre 2020	218,72 EUR	(348)	(6)
(2)	Contrats à terme sur euro-obligations, décembre 2020	8 décembre 2020	174,27 EUR	(545)	(1)
2	Contrats à terme sur obligations du Trésor australien à 10 ans, décembre 2020	15 décembre 2020	149,51 AUD	285	–
(Pertes) latentes				(608)	(7)
<b>Total des contrats à terme standardisés</b>				<b>1 543</b>	<b>(1)</b>

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

### Tableau des contrats de change à terme

Note de crédit de la contrepartie	Achetés \$ (en milliers)	Vendus \$ (en milliers)	Date de règlement	Coût du contrat \$ (en milliers)	Juste valeur actuelle \$ (en milliers)	Profits (pertes) latent(e)s \$ (en milliers)	
A	3 853	(2 853)	Dollar canadien / Dollar américain	2 octobre 2020	(3 853)	(3 797)	56
A	20	(27)	Dollar américain / Dollar australien	8 octobre 2020	(26)	(26)	–
A	153	(139)	Dollar américain / Franc suisse	8 octobre 2020	(204)	(201)	3
A	1	(1)	Dollar américain / Franc suisse	8 octobre 2020	(1)	(1)	–
A	27	(21)	Dollar américain / Livre sterling	8 octobre 2020	(36)	(36)	–
A	150	(1 310)	Dollar américain / Couronne norvégienne	8 octobre 2020	(200)	(187)	13
A	1 040	(111)	Couronne norvégienne / Dollar américain	8 octobre 2020	148	148	–
A	118	(78)	Dollar néo-zélandais / Dollar américain	8 octobre 2020	104	104	–
A	124	(1 070)	Dollar américain / Couronne suédoise	8 octobre 2020	(165)	(160)	5
A	10	(16)	Euro / Dollar canadien	9 octobre 2020	16	16	–
A	145	(1 005)	Dollar canadien / Couronne norvégienne	9 octobre 2020	(145)	(143)	2
A	117	(87)	Dollar canadien / Dollar américain	9 octobre 2020	(117)	(115)	2
AA	1 214	(897)	Dollar canadien / Dollar américain	9 octobre 2020	(1 214)	(1 194)	20
A	37 736	(469)	Yen japonais / Dollar canadien	21 octobre 2020	469	476	7
A	138	(155)	Dollar canadien / Dollar néo-zélandais	21 octobre 2020	(138)	(137)	1
AA	116	(87)	Dollar canadien / Dollar américain	23 octobre 2020	(116)	(115)	1
A	1 004	(1 050)	Dollar canadien / Dollar australien	18 novembre 2020	(1 004)	(1 002)	2
A	70	(180)	Dollar canadien / Shekel israélien	2 décembre 2020	(70)	(70)	–
A	330	(26 080)	Dollar canadien / Yen japonais	17 février 2021	(330)	(330)	–
Profits latents						112	
A	60	(44)	Dollar australien / Dollar américain	8 octobre 2020	59	57	(2)
A	333	(255)	Dollar canadien / Dollar américain	8 octobre 2020	(333)	(340)	(7)
A	198	(264)	Dollar américain / Dollar canadien	8 octobre 2020	264	263	(1)
A	7	(8)	Euro / Dollar américain	8 octobre 2020	11	11	–
A	15	(17)	Euro / Dollar américain	8 octobre 2020	23	23	–
A	5	(7)	Livre sterling / Dollar américain	8 octobre 2020	9	9	–



**MACKENZIE**  
Placements



# FONDS ÉQUILIBRÉ DE DURABILITÉ MONDIALE ET D'IMPACT MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

Au 30 septembre 2020

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

Note de crédit de la contrepartie	Achetés \$ (en milliers)	Vendus \$ (en milliers)	Date de règlement	Coût du contrat \$ (en milliers)	Juste valeur actuelle \$ (en milliers)	Profits (pertes) latent(e)s \$ (en milliers)	
A	125	Dollar américain (13 200)	Yen japonais	8 octobre 2020	(166)	(167)	(1)
A	41	Dollar américain (4 300)	Yen japonais	8 octobre 2020	(54)	(54)	–
A	59	Dollar néo-zélandais (40)	Dollar américain	8 octobre 2020	53	52	(1)
A	430	Couronne suédoise (48)	Dollar américain	8 octobre 2020	64	64	–
A	85	Dollar canadien (55)	Euro	9 octobre 2020	(85)	(86)	(1)
A	351	Dollar canadien (370)	Dollar australien	21 octobre 2020	(351)	(353)	(2)
AA	139	Dollar canadien (90)	Euro	23 octobre 2020	(139)	(141)	(2)
AA	16	Dollar canadien (10)	Euro	23 octobre 2020	(16)	(16)	–
A	442	Dollar canadien (332)	Dollar américain	20 novembre 2020	(442)	(443)	(1)
AA	115	Dollar canadien (87)	Dollar américain	20 novembre 2020	(115)	(116)	(1)
A	135	Dollar canadien (347)	Shekel israélien	2 décembre 2020	(135)	(135)	–
A	75	Dollar canadien (57)	Dollar américain	12 février 2021	(75)	(76)	(1)
AA	453	Dollar canadien (345)	Dollar américain	12 février 2021	(453)	(459)	(6)
A	2 852	Dollar canadien (2 165)	Dollar américain	19 février 2021	(2 852)	(2 881)	(29)
AA	151	Dollar canadien (115)	Dollar américain	26 février 2021	(151)	(153)	(2)
A	485	Dollar canadien (368)	Dollar américain	26 février 2021	(485)	(490)	(5)
(Pertes) latentes						(62)	
<b>Total des contrats de change à terme</b>						<b>50</b>	
<b>Total des instruments dérivés à la juste valeur</b>						<b>49</b>	



**MACKENZIE**  
Placements

## NOTES ANNEXES

### 1. Périodes comptables et renseignements généraux

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

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

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

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

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

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

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

### 3. Principales méthodes comptables

#### a) Instruments financiers

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

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

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

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



## NOTES ANNEXES

### 3. Principales méthodes comptables (suite)

#### a) Instruments financiers (suite)

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

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

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

#### b) Évaluation de la juste valeur

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

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

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

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

Le Fonds peut avoir recours à des instruments dérivés (comme les options souscrites, les contrats à terme standardisés ou de gré à gré, les swaps ou les instruments dérivés synthétiques) en guise de couverture contre les pertes occasionnées par des fluctuations des cours des titres, des taux d'intérêt ou des taux de change. Le Fonds peut également avoir recours à des instruments dérivés à des fins autres que de couverture afin d'effectuer indirectement des placements dans des titres ou des marchés financiers, de s'exposer à d'autres devises, de chercher à générer des revenus supplémentaires ou à toute autre fin considérée comme appropriée par le ou les portefeuillistes du Fonds, pourvu que cela soit compatible avec les objectifs de placement du Fonds. Les instruments dérivés doivent être utilisés conformément à la législation canadienne sur les organismes de placement collectif, sous réserve des dispenses accordées au Fonds par les organismes de réglementation, le cas échéant. Pour de plus amples renseignements à cet égard, notamment sur les modalités de telles dispenses, le cas échéant, se reporter à la rubrique « Dispenses de l'application des dispositions du Règlement 81-102 » de la notice annuelle du Fonds.

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

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



## NOTES ANNEXES

### 3. Principales méthodes comptables (suite)

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

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

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

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

#### c) Comptabilisation des produits

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

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

#### d) Commissions et autres coûts de transaction liés au portefeuille

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

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

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

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

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

#### f) Compensation

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

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



## NOTES ANNEXES

### 3. Principales méthodes comptables (suite)

#### g) Devises

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

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

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

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

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

#### i) Valeur liquidative par titre

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

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

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

#### k) Fusions

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

### 4. Estimations et jugements comptables critiques

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

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

Utilisation d'estimations

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

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



## NOTES ANNEXES

### 4. Estimations et jugements comptables critiques (suite)

Utilisation de jugements

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

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

*Monnaie fonctionnelle*

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

*Entités structurées et entreprises associées*

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

### 5. Impôts sur les bénéfices

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

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

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

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

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

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



## NOTES ANNEXES

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

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

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

### 7. Capital du Fonds

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

### 8. Risques découlant des instruments financiers

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

Les activités de placement du Fonds l'exposent à divers risques financiers, tels qu'ils sont définis dans IFRS 7, *Instruments financiers : Informations à fournir* (« IFRS 7 »). L'exposition du Fonds aux risques financiers est concentrée dans ses placements, lesquels sont présentés dans le tableau des placements au 30 septembre 2020, regroupés par type d'actif, région géographique et secteur.

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

#### ii. Risque de liquidité

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

Pour se conformer à la réglementation sur les valeurs mobilières, le Fonds doit conserver au moins 90 % de son actif dans des placements liquides (c.-à-d. des placements pouvant être facilement vendus).

#### iii. Risque de change

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

#### iv. Risque de taux d'intérêt

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



## NOTES ANNEXES

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

#### v. Autre risque de prix

L'autre risque de prix est le risque que la valeur des instruments financiers fluctue en fonction des variations des cours du marché (autres que celles découlant du risque de taux d'intérêt ou du risque de change), que ces variations découlent de facteurs propres à un placement individuel ou à son émetteur, ou d'autres facteurs ayant une incidence sur tous les instruments négociés sur un marché ou un segment du marché. Tous les placements présentent un risque de perte en capital. Ce risque est géré grâce à une sélection minutieuse de placements et d'autres instruments financiers conformes aux stratégies de placement. À l'exception de certains contrats dérivés, le risque maximal découlant des instruments financiers équivaut à leur juste valeur. Le risque maximal de perte sur certains contrats dérivés, comme des contrats à terme, des swaps ou des contrats à terme standardisés équivaut à leurs montants notionnels. Dans le cas d'options d'achat (de vente) et de positions vendeur sur contrats à terme standardisés, la perte pour le Fonds continue d'augmenter, sans limite, au fur et à mesure que la juste valeur de l'élément sous-jacent augmente (diminue). Toutefois, ces instruments sont généralement utilisés dans le cadre du processus global de gestion des placements afin de gérer le risque provenant des placements sous-jacents et n'augmentent généralement pas le risque de perte global du Fonds. Pour atténuer ce risque, le Fonds s'assure de détenir à la fois l'élément sous-jacent, la couverture en espèces ou la marge, dont la valeur équivaut à celle du contrat dérivé ou lui est supérieure. La note 9 résume l'exposition du Fonds à l'autre risque de prix, si une telle exposition s'applique et est considérable.

#### vi. Risque de crédit

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

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

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

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

#### vii. Fonds sous-jacents

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





## NOTES ANNEXES

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

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

Date de constitution 29 septembre 2017

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](http://www.placementsmackenzie.com))

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

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

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

Les titres des séries F, F5 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 les séries F5 et F8); ils sont également proposés aux employés de Mackenzie et de ses filiales, et aux administrateurs de Mackenzie. Les investisseurs des séries F5 et F8 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % ou de 8 % par année, respectivement.

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

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

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

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

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

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

**Séries distribuées par BLC Services Financiers inc.** (1360, boul. René-Lévesque Ouest, 13<sup>e</sup> étage, Montréal (Québec) H3G 0A9; 1-800-252-1846; [www.banquelaurentienne.ca/mackenzie](http://www.banquelaurentienne.ca/mackenzie))

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

Les titres des séries LF et LF5 sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$ (5 000 \$ pour la série LF5), qui participent à un programme de services rémunérés à l'acte parrainé par Gestion privée Banque Laurentienne. Les investisseurs de série LF5 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année.

Les titres des séries LW et LW5 sont offerts à certains investisseurs à valeur nette élevée du programme de tarification préférentielle qui investissent un minimum de 100 000 \$. Les investisseurs de série LW5 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année.



# FONDS ÉQUILIBRÉ DE DURABILITÉ MONDIALE ET D'IMPACT MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

## NOTES ANNEXES

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

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

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

Série	Date d'établissement/ de rétablissement	Frais de gestion	Frais d'administration	Valeur liquidative par titre (\$)	
				30 sept. 2020	31 mars 2020
Série A	16 octobre 2017	1,85 %	0,24 %	11,05	9,99
Série AR	16 octobre 2017	1,85 %	0,27 %	11,06	10,00
Série D	16 octobre 2017	1,10 %	0,16 %	11,25	10,12
Série F	16 octobre 2017	0,70 %	0,15 %	11,33	10,17
Série F5	16 octobre 2017	0,70 %	0,15 %	14,96	13,77
Série F8	16 octobre 2017	0,70 %	0,15 %	13,62	12,73
Série FB	16 octobre 2017	0,85 %	0,24 %	11,29	10,14
Série FB5	16 octobre 2017	0,85 %	0,24 %	14,83	13,67
Série O	16 octobre 2017	— <sup>1)</sup>	— <sup>*</sup>	11,52	10,29
Série PW	16 octobre 2017	1,70 %	0,15 %	11,11	10,03
Série PWFB	16 octobre 2017	0,70 %	0,15 %	11,35	10,18
Série PWFB5	16 octobre 2017	0,70 %	0,15 %	15,05	13,83
Série PWR	1 <sup>er</sup> avril 2019	1,70 %	0,15 %	10,69	9,64
Série PWT5	16 octobre 2017	1,70 %	0,15 %	14,58	13,47
Série PWT8	16 octobre 2017	1,70 %	0,15 %	13,24	12,46
Série PWX	16 octobre 2017	— <sup>2)</sup>	— <sup>2)</sup>	11,52	10,29
Série PWX8	16 octobre 2017	— <sup>2)</sup>	— <sup>2)</sup>	14,00	13,02
Série T5	16 octobre 2017	1,85 %	0,24 %	14,38	13,32
Série T8	16 octobre 2017	1,85 %	0,24 %	13,09	12,32
Série LB	9 décembre 2019	1,85 %	0,24 %	10,36	9,36
Série LF	9 décembre 2019	0,70 %	0,15 %	10,48	9,41
Série LF5	9 décembre 2019	0,70 %	0,15 %	15,16	13,94
Série LW	9 décembre 2019	1,70 %	0,15 %	10,38	9,37
Série LW5	9 décembre 2019	1,70 %	0,15 %	15,01	13,89
Série LX	9 décembre 2019	1,85 %	0,24 %	14,97	13,87

\* Sans objet.

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

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



**MACKENZIE**  
Placements

# FONDS ÉQUILIBRÉ DE DURABILITÉ MONDIALE ET D'IMPACT MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

## NOTES ANNEXES

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

#### b) Placements détenus par Mackenzie et des sociétés affiliées

Au 30 septembre 2020, Mackenzie détenait un placement de 30 \$ (27 \$ au 31 mars 2020) dans le Fonds.

#### c) Reports prospectifs de pertes

À la fin de la dernière année d'imposition, le Fonds avait des pertes en capital de 66 \$ qui peuvent être reportées prospectivement indéfiniment afin de réduire les gains réalisés au cours d'exercices futurs. Aucune perte autre qu'en capital n'était disponible pour un report prospectif aux fins de l'impôt.

#### d) Prêt de titres

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

	30 septembre 2020	31 mars 2020
	(\$)	(\$)
Valeur des titres prêtés	3 711	2 037
Valeur des biens reçus en garantie	3 899	2 280

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

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

	2020		2019	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
Revenus de prêts de titres bruts	1	100,0	1	100,0
Impôt retenu à la source	-	-	-	-
	1	100,0	1	100,0
Paiements à l'agent de prêt de titres	-	-	-	-
Revenu tiré du prêt de titres	1	100,0	1	100,0

#### e) Commissions

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

	(\$)
30 septembre 2020	2
30 septembre 2019	-

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

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

	30 septembre 2020			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	29	(27)	-	2
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(55)	27	118	90
Obligation pour options vendues	-	-	-	-
Total	(26)	-	118	92



**MACKENZIE**  
Placements

# FONDS ÉQUILIBRÉ DE DURABILITÉ MONDIALE ET D'IMPACT MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

## NOTES ANNEXES

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

#### f) Compensation d'actifs et de passifs financiers (suite)

31 mars 2020

	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	112	(64)	–	48
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(192)	64	121	(7)
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	(80)	–	121	41

#### g) Risques découlant des instruments financiers

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

Le Fonds cherche à obtenir une croissance du capital et un revenu en investissant principalement dans une combinaison de titres de participation et de titres à revenu fixe d'émetteurs situés 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. Le Fonds applique une méthode de placements qui met l'accent sur des émetteurs durables et responsables.

##### ii. Risque de change

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

30 septembre 2020

Devise	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)
Dollar américain	22 571	866	(8 308)	15 129
Euro	4 533	42	(160)	4 415
Yen japonais	2 058	–	(75)	1 983
Couronne suédoise	1 306	–	(96)	1 210
Dollar de Hong Kong	364	–	–	364
Livre sterling	379	–	(27)	352
Dollar de Singapour	208	–	–	208
Won sud-coréen	195	–	–	195
Franc suisse	367	–	(202)	165
Dollar néo-zélandais	133	–	19	152
Couronne danoise	142	–	–	142
Dollar australien	1 365	7	(1 324)	48
Shekel israélien	205	–	(205)	–
Couronne norvégienne	143	–	(182)	(39)
Riyal saoudien	–	–	(1 278)	(1 278)
Total	33 969	915	(11 838)	23 046
% de l'actif net	75,8	2,0	(26,4)	51,4



**MACKENZIE**  
Placements

# FONDS ÉQUILIBRÉ DE DURABILITÉ MONDIALE ET D'IMPACT MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

## NOTES ANNEXES

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

g) Risques découlant des instruments financiers (suite)

ii. Risque de change (suite)

Devise	31 mars 2020			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)
Dollar américain	18 629	142	(6 967)	11 804
Yen japonais	2 781	32	(131)	2 682
Euro	1 478	122	378	1 978
Franc suisse	351	–	1 197	1 548
Dollar de Hong Kong	580	13	–	593
Won sud-coréen	–	–	352	352
Couronne suédoise	306	–	15	321
Livre sterling	312	(91)	(4)	217
Dollar australien	153	2	(4)	151
Rupiah indonésienne	90	4	–	94
Shekel israélien	209	–	(211)	(2)
Dollar néo-zélandais	246	–	(326)	(80)
Livre égyptienne	–	–	(116)	(116)
Couronne norvégienne	531	1	(718)	(186)
Peso philippin	–	–	(987)	(987)
Zloty polonais	–	–	(1 054)	(1 054)
Riyal saoudien	–	–	(1 353)	(1 353)
Total	25 666	225	(9 929)	15 962
% de l'actif net	84,9	0,7	(32,9)	52,7

\* Comprend les instruments financiers monétaires et non monétaires.

Au 30 septembre 2020, si le dollar canadien avait connu une hausse ou une baisse de 5 % relativement à toutes les devises, toute autre variable demeurant constante, l'actif net aurait diminué ou augmenté d'environ 1 152 \$ ou 2,6 % du total de l'actif net (798 \$ ou 2,6 % au 31 mars 2020). En pratique, les résultats réels de négociation peuvent différer et l'écart pourrait être important.

iii. Risque de taux d'intérêt

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

Durée jusqu'à l'échéance	30 septembre 2020 (\$)		31 mars 2020 (\$)	
	Obligations	Instruments dérivés	Obligations	Instruments dérivés
Moins de 1 an	909	1 544	921	187
1 an à 5 ans	3 812	–	4 579	–
5 ans à 10 ans	8 639	–	6 472	–
Plus de 10 ans	4 193	–	2 576	–
Total	17 553	1 544	14 548	187



**MACKENZIE**  
Placements

# FONDS ÉQUILIBRÉ DE DURABILITÉ MONDIALE ET D'IMPACT MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

## NOTES ANNEXES

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

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

##### iii. Risque de taux d'intérêt (suite)

Au 30 septembre 2020, si les taux d'intérêt en vigueur avaient connu une hausse de 1 %, la courbe des taux évoluant en parallèle et toute autre variable demeurant constante, l'actif net aurait diminué d'environ 1 443 \$ ou 3,2 % du total de l'actif net (1 046 \$ ou 3,5 % au 31 mars 2020). De même, si les taux d'intérêt en vigueur avaient connu une baisse de 1 %, toute autre variable demeurant constante, l'actif net aurait augmenté d'environ 1 443 \$ ou 3,2 % du total de l'actif net (1 046 \$ ou 3,5 % au 31 mars 2020). En pratique, les résultats réels de négociation peuvent différer et l'écart pourrait être important.

##### iv. Autre risque de prix

Pour ce Fonds, le risque le plus important découlant du risque de prix provient de ses placements dans des titres de participation et des fonds/billets négociés en bourse. Au 30 septembre 2020, si les cours des Bourses où se négocient ces titres avaient augmenté ou diminué de 10 %, toute autre variable demeurant constante, l'actif net aurait augmenté ou diminué d'environ 2 221 \$ ou 5,0 % du total de l'actif net (1 375 \$ ou 4,6 % au 31 mars 2020). En pratique, les résultats réels de négociation peuvent différer et l'écart pourrait être important.

##### v. Risque de crédit

Pour ce Fonds, la plus forte concentration du risque de crédit se trouve dans les titres de créance, tels que les obligations. La juste valeur des titres de créance tient compte de la solvabilité de l'émetteur de ces titres. L'exposition maximale à tout émetteur de titres de créance au 30 septembre 2020 était de 7,4 % de l'actif net du Fonds (22,8 % au 31 mars 2020).

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

Note des obligations*	30 septembre 2020	31 mars 2020
	% de l'actif net	% de l'actif net
AAA	5,9	4,2
AA	9,8	26,2
A	4,4	5,7
BBB	8,0	5,6
Inférieure à BBB	5,9	4,6
Sans note	5,1	1,8
Total	39,1	48,1

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



**MACKENZIE**  
Placements

# FONDS ÉQUILIBRÉ DE DURABILITÉ MONDIALE ET D'IMPACT MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2020

FONDS ÉQUILIBRÉ

## NOTES ANNEXES

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

#### h) Classement de la juste valeur

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

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

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

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

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

	30 septembre 2020				31 mars 2020			
	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	–	17 553	–	17 553	–	14 548	–	14 548
Actions	13 323	8 679	–	22 002	8 268	5 302	–	13 570
Options	–	1	–	1	–	38	–	38
Fonds/billets négociés en bourse	205	–	–	205	178	–	–	178
Actifs dérivés	6	112	–	118	49	191	–	240
Passifs dérivés	(7)	(62)	–	(69)	(1)	(668)	–	(669)
Placements à court terme	–	3 365	–	3 365	–	1 206	–	1 206
Total	13 527	29 648	–	43 175	8 494	20 617	–	29 111

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

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

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



**MACKENZIE**  
Placements