

États financiers intermédiaires non audités

Pour la période de six mois close le 30 septembre 2024

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

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

AVIS DE NON-AUDIT DES ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES

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

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



FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

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

	30 sept. 2024	31 mars 2024 (Audité)
	\$	\$
ACTIF		
Actifs courants		
Placements à la juste valeur	334 012	328 085
Trésorerie et équivalents de trésorerie	11 349	2 510
Intérêts courus à recevoir	3 203	3 151
Dividendes à recevoir	–	3
Sommes à recevoir pour placements vendus	443	3 449
Sommes à recevoir pour titres émis	165	221
Sommes à recevoir du gestionnaire	6	6
Marge sur instruments dérivés	960	1 575
Actifs dérivés	686	85
Total de l'actif	350 824	339 085
PASSIF		
Passifs courants		
Sommes à payer pour placements achetés	3 819	3 541
Sommes à payer pour titres rachetés	161	598
Sommes à payer au gestionnaire	20	20
Obligation pour options vendues	20	–
Passifs dérivés	6	357
Total du passif	4 026	4 516
Actif net attribuable aux porteurs de titres	346 798	334 569

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

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

	2024 \$	2023 \$
Revenus		
Dividendes	154	408
Revenus d'intérêts aux fins de distribution	7 406	7 578
Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets		
Profit (perte) net(te) réalisé(e)	(2 574)	(13 001)
Profit (perte) net(te) latent(e)	13 522	(12 427)
Revenu tiré du prêt de titres	6	15
Revenu provenant des rabais sur les frais	13	25
Total des revenus (pertes)	18 527	(17 402)
Charges (note 6)		
Frais de gestion	983	1 054
Frais d'administration	191	207
Intérêts débiteurs	1	1
Commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille	8	14
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Charges avant les montants absorbés par le gestionnaire	1 184	1 277
Charges absorbées par le gestionnaire	–	–
Charges nettes	1 184	1 277
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, avant impôt	17 343	(18 679)
Charge (économie) d'impôt étranger retenu à la source	1	(5)
Charge d'impôt étranger sur le résultat (recouvrée)	–	–
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation	17 342	(18 674)

Actif net attribuable aux porteurs de titres (note 3)

	par titre		par série	
	30 sept. 2024	31 mars 2024 (Audité)	30 sept. 2024	31 mars 2024 (Audité)
Série A	9,35	9,05	3 325	3 363
Série AR	9,67	9,36	4 795	4 577
Série D	9,47	9,16	598	591
Série F	9,39	9,09	81 938	84 860
Série F5	9,77	9,51	147	54
Série F8	9,59	9,49	25	25
Série FB	9,21	8,91	88	92
Série O	9,45	9,14	114 723	105 304
Série PW	9,61	9,30	69 673	67 283
Série PWFB	9,15	8,86	577	606
Série PWR	9,16	8,87	3 332	2 832
Série PWT5	10,54	10,29	702	543
Série PWX	9,45	9,15	401	282
Série R	9,35	9,04	4 340	3 414
Série S	9,35	9,05	2 195	2 070
Série SC	9,35	9,05	40 458	40 700
Série S5	9,38	9,17	432	501
Série T5	8,85	8,66	1	1
Série LB	9,25	8,95	3 101	3 099
Série LF	9,42	9,12	4 580	4 158
Série LW	9,19	8,89	11 367	10 214
			346 798	334 569

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

	par titre		par série	
	2024	2023	2024	2023
Série A	0,42	(0,45)	152	(265)
Série AR	0,44	(0,48)	219	(225)
Série CL	–	(0,39)	–	(1 989)
Série D	0,48	(0,39)	30	(22)
Série F	0,47	(0,41)	4 176	(4 419)
Série F5	0,54	(0,36)	3	(10)
Série F8	0,49	(0,45)	1	(2)
Série FB	0,46	(0,39)	4	(6)
Série O	0,51	(0,39)	5 993	(4 132)
Série PW	0,47	(0,45)	3 344	(3 444)
Série PWFB	0,46	(0,33)	28	(43)
Série PWR	0,45	(0,44)	154	(105)
Série PWT5	0,50	(0,51)	27	(29)
Série PWX	0,56	(0,39)	20	(14)
Série R	0,54	(0,45)	235	(889)
Série S	0,51	(0,39)	115	(92)
Série SC	0,44	(0,44)	1 922	(2 213)
Série S5	0,43	(0,45)	20	(31)
Série T5	0,42	(0,21)	–	(2)
Série LB	0,43	(0,44)	146	(146)
Série LF	0,48	(0,45)	218	(150)
Série LW	0,45	(0,43)	535	(446)
			17 342	(18 674)

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE LA SITUATION FINANCIÈRE

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

	Total		Série A		Série AR		Série CL		Série D	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	334 569	436 141	3 363	6 109	4 577	4 324	–	41 495	591	651
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	17 342	(18 674)	152	(265)	219	(225)	–	(1 989)	30	(22)
Distributions versées aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(6 366)	(6 379)	(45)	(54)	(64)	(44)	–	(872)	(11)	(8)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(10)	(20)	–	–	–	–	–	–	–	–
Total des distributions versées aux porteurs de titres	(6 376)	(6 399)	(45)	(54)	(64)	(44)	–	(872)	(11)	(8)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	40 373	38 663	812	69	597	565	–	8 490	41	118
Réinvestissement des distributions	5 729	4 643	43	51	64	44	–	–	10	6
Paiements au rachat de titres	(44 839)	(91 822)	(1 000)	(1 547)	(598)	(397)	–	(787)	(63)	(345)
Total des opérations sur les titres	1 263	(48 516)	(145)	(1 427)	63	212	–	7 703	(12)	(221)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	12 229	(73 589)	(38)	(1 746)	218	(57)	–	4 842	7	(251)
À la clôture	346 798	362 552	3 325	4 363	4 795	4 267	–	46 337	598	400
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :										
Titres en circulation, à l'ouverture			Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres
Émis			371	667	489	456	–	4 536	64	70
Réinvestissement des distributions			90	7	64	62	–	947	5	13
Rachetés			5	6	7	5	–	–	1	1
Titres en circulation, à la clôture			(110)	(173)	(64)	(43)	–	(89)	(7)	(38)
			356	507	496	480	–	5 394	63	46

	Série F		Série F5		Série F8		Série FB		Série O	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	84 860	96 663	54	415	25	28	92	177	105 304	96 139
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	4 176	(4 419)	3	(10)	1	(2)	4	(6)	5 993	(4 132)
Distributions versées aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(1 563)	(1 512)	(1)	(5)	–	–	(2)	(2)	(2 429)	(1 835)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	–	(3)	(1)	(1)	–	–	–	–
Total des distributions versées aux porteurs de titres	(1 563)	(1 512)	(1)	(8)	(1)	(1)	(2)	(2)	(2 429)	(1 835)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	10 806	13 788	90	–	–	–	9	9	7 510	3 218
Réinvestissement des distributions	1 042	1 024	1	1	–	–	2	2	2 429	1 835
Paiements au rachat de titres	(17 383)	(19 769)	–	(303)	–	–	(17)	(68)	(4 084)	(2 740)
Total des opérations sur les titres	(5 535)	(4 957)	91	(302)	–	–	(6)	(57)	5 855	2 313
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	(2 922)	(10 888)	93	(320)	–	(3)	(4)	(65)	9 419	(3 654)
À la clôture	81 938	85 775	147	95	25	25	88	112	114 723	92 485
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :										
Titres en circulation, à l'ouverture			Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres
Émis			9 338	10 516	6	42	10	20	11 521	10 400
Réinvestissement des distributions			1 181	1 526	9	–	2	1	814	356
Rachetés			114	115	–	–	–	–	264	204
Titres en circulation, à la clôture			(1 907)	(2 221)	–	(32)	(2)	(8)	(453)	(307)
			8 726	9 936	15	10	3	3	12 146	10 653

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

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

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

	Série PW		Série PWFB		Série PWR		Série PWT5		Série PWX	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	67 283	73 586	606	1 734	2 832	1 952	543	606	282	317
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	3 344	(3 444)	28	(43)	154	(105)	27	(29)	20	(14)
Distributions versées aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(1 107)	(920)	(11)	(18)	(50)	(27)	(9)	(8)	(8)	(6)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	–	–	–	–	(5)	(7)	–	–
Total des distributions versées aux porteurs de titres	(1 107)	(920)	(11)	(18)	(50)	(27)	(14)	(15)	(8)	(6)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	8 007	4 402	27	92	496	362	163	36	104	1
Réinvestissement des distributions	1 017	850	11	18	50	27	10	9	8	6
Paiements au rachat de titres	(8 871)	(9 512)	(84)	(996)	(150)	(99)	(27)	(48)	(5)	(5)
Total des opérations sur les titres	153	(4 260)	(46)	(886)	396	290	146	(3)	107	2
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	2 390	(8 624)	(29)	(947)	500	158	159	(47)	119	(18)
À la clôture	69 673	64 962	577	787	3 332	2 110	702	559	401	299
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :										
Titres en circulation, à l'ouverture	7 237	7 822	68	194	319	217	53	57	31	34
Émis	856	476	4	9	56	41	16	3	11	–
Réinvestissement des distributions	109	93	1	2	6	3	1	1	1	1
Rachetés	(950)	(1 038)	(10)	(112)	(17)	(11)	(3)	(5)	(1)	(1)
Titres en circulation, à la clôture	7 252	7 353	63	93	364	250	67	56	42	34

	Série R		Série S		Série SC		Série S5		Série T5	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	3 414	46 320	2 070	1 929	40 700	47 323	501	701	1	66
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	235	(889)	115	(92)	1 922	(2 213)	20	(31)	–	(2)
Distributions versées aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(90)	(280)	(46)	(40)	(622)	(539)	(7)	(8)	–	–
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	–	–	–	–	(4)	(9)	–	–
Total des distributions versées aux porteurs de titres	(90)	(280)	(46)	(40)	(622)	(539)	(11)	(17)	–	–
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	996	1 184	224	450	7 665	3 832	198	3	–	–
Réinvestissement des distributions	90	–	46	40	596	519	9	10	–	–
Paiements au rachat de titres	(305)	(44 484)	(214)	(308)	(9 803)	(7 875)	(285)	(105)	–	(64)
Total des opérations sur les titres	781	(43 300)	56	182	(1 542)	(3 524)	(78)	(92)	–	(64)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	926	(44 469)	125	50	(242)	(6 276)	(69)	(140)	–	(66)
À la clôture	4 340	1 851	2 195	1 979	40 458	41 047	432	561	1	–
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :										
Titres en circulation, à l'ouverture	378	5 064	229	211	4 499	5 169	55	73	–	7
Émis	109	130	25	48	843	427	21	–	–	–
Réinvestissement des distributions	10	–	5	5	66	58	1	1	–	–
Rachetés	(33)	(4 979)	(24)	(34)	(1 080)	(880)	(31)	(11)	–	(7)
Titres en circulation, à la clôture	464	215	235	230	4 328	4 774	46	63	–	–

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

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

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

	Série LB		Série LF		Série LW	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES						
À l'ouverture	3 099	3 120	4 158	2 783	10 214	9 703
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	146	(146)	218	(150)	535	(446)
Distributions versées aux porteurs de titres :						
Revenu de placement	(47)	(35)	(80)	(48)	(174)	(118)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	–	–	–	–
Total des distributions versées aux porteurs de titres	(47)	(35)	(80)	(48)	(174)	(118)
Opérations sur les titres :						
Produit de l'émission de titres	516	369	726	1 024	1 386	651
Réinvestissement des distributions	47	35	80	48	174	118
Paievements au rachat de titres	(660)	(678)	(522)	(311)	(768)	(1 381)
Total des opérations sur les titres	(97)	(274)	284	761	792	(612)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	2	(455)	422	563	1 153	(1 176)
À la clôture	3 101	2 665	4 580	3 346	11 367	8 527
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :						
Titres						
Titres en circulation, à l'ouverture	346	344	456	302	1 149	1 079
Émis	58	42	78	113	155	74
Réinvestissement des distributions	5	4	9	5	19	13
Rachetés	(74)	(77)	(57)	(34)	(86)	(157)
Titres en circulation, à la clôture	335	313	486	386	1 237	1 009

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

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

	2024	2023
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation	17 342	(18 674)
Ajustements pour :		
Perte (profit) net(te) réalisé(e) sur les placements	2 383	11 434
Variation de la perte (du profit) net(te) latent(e) sur les placements	(13 522)	12 427
Achat de placements	(126 719)	(163 921)
Produit de la vente et de l'échéance de placements	134 247	205 808
(Augmentation) diminution des sommes à recevoir et autres actifs	566	1 633
Augmentation (diminution) des sommes à payer et autres passifs	–	(2)
Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités d'exploitation	14 297	48 705
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de titres	34 044	35 571
Paievements au rachat de titres	(38 891)	(88 600)
Distributions versées, déduction faite des réinvestissements	(647)	(1 756)
Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités de financement	(5 494)	(54 785)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie	8 803	(6 080)
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à l'ouverture	2 510	7 087
Incidence des fluctuations des taux de change sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie	36	8
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture	11 349	1 015
Trésorerie	9 131	1 015
Équivalents de trésorerie	2 218	1 325
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture	11 349	1 015
Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :		
Dividendes reçus	157	338
Impôt étranger payé (recouvré)	1	(5)
Intérêts reçus	7 354	7 682
Intérêts versés	1	1

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES PLACEMENTS

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS					
407 International Inc. 4,22 % 14-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	328 000	328	335
407 International Inc. 3,14 % 06-03-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	446 000	499	440
407 International Inc. 3,43 % 01-06-2033, série MTN	Canada	Sociétés – Non convertibles	599 000	631	581
407 International Inc. 3,60 % 21-05-2047, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	579 000	567	502
407 International Inc. 3,67 % 08-03-2049, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	571 000	488	498
407 International Inc. 4,86 % 31-07-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	111 000	111	117
407 International Inc. 4,68 % 07-10-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000	102	102
AerCap Ireland Capital DAC 3,00 % 29-10-2028	Irlande	Sociétés – Non convertibles	348 000 USD	402	445
Aéroports de Montréal 6,55 % 11-10-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	41 000	48	48
Aéroports de Montréal 3,92 % 12-06-2045, rachetables 2044	Canada	Sociétés – Non convertibles	58 000	54	54
Aéroports de Montréal 3,36 % 24-04-2047, rachetables 2046	Canada	Sociétés – Non convertibles	344 000	269	290
Aéroports de Montréal 3,03 % 21-04-2050, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000	39	39
AES Andes SA 6,30 % 15-03-2029	Chili	Sociétés – Non convertibles	292 000 USD	394	410
AIMCo Realty Investors LP 2,20 % 04-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	294 000	294	287
AIMCo Realty Investors LP 2,71 % 01-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	666 000	647	638
Air Lease Corp. 5,40 % 01-06-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	695 000	697	728
Alectra Inc. 3,24 % 21-11-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	147 000	154	147
Alectra Inc. 1,75 % 11-02-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	197 000	173	176
Alectra Inc. 4,63 % 13-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	142 000	142	149
Algonquin Power & Utilities Corp. 4,09 % 17-02-2027, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	800 000	820	809
Algonquin Power & Utilities Corp. 2,85 % 15-07-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	720 000	588	709
Algonquin Power & Utilities Corp., taux variable 18-01-2082 (\$ US)	Canada	Sociétés – Non convertibles	462 000 USD	579	586
Algonquin Power & Utilities Corp., taux variable 18-01-2082 (\$ CA)	Canada	Sociétés – Non convertibles	528 000	504	499
Alimentation Couche-Tard inc. 5,59 % 25-09-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	380 000	380	410
AltaGas Ltd., taux variable 11-01-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	224 000	224	208
AltaGas Ltd., taux variable 10-11-2083	Canada	Sociétés – Non convertibles	154 000	154	169
AltaLink, L.P. 4,74 % 22-05-2054	Canada	Sociétés – Non convertibles	136 000	136	141
AltaLink, L.P. 5,46 % 11-10-2055	Canada	Sociétés – Non convertibles	141 000	141	163
Altice International SARL 5,00 % 15-01-2028 144A	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	227	229
Amazon.com Inc. 4,70 % 01-12-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	492 000 USD	668	692
American Tower Corp. 1,88 % 15-10-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	138 000 USD	184	161
Anglian Water Services Financing PLC 4,53 % 26-08-2032	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	224 000	224	222
ARC Resources Ltd. 3,47 % 10-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	76 000	73	73
Ascend Wellness Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 27-08-2025	États-Unis	Prêts à terme	45 818 USD	58	61
AT&T Inc. 4,85 % 25-05-2047	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	207 000	185	198
ATCO Ltd., taux variable 01-11-2078, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	660 000	649	673
Athene Global Funding 3,13 % 10-03-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	259 000	259	258
Athene Global Funding 2,10 % 24-09-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	466 000	465	458
Athene Global Funding 2,47 % 09-06-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	127 000	114	121
Athene Global Funding 5,11 % 07-03-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	220 000	220	230
Avolon Holdings Funding Ltd. 5,75 % 01-03-2029 144A	Irlande	Sociétés – Non convertibles	420 000 USD	562	585
Bank of America Corp., taux variable 15-09-2027 (taux variable différé)	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	465 000	457	450
Bank of America Corp., taux variable 16-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 518 000	1 461	1 516
Banque de Montréal 3,65 % 01-04-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	289 000	284	290
Banque de Montréal 4,31 % 01-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 202 000	1 191	1 226
Banque de Montréal 4,71 % 07-12-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 775 000	1 765	1 836
Banque de Montréal 3,19 % 01-03-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	656 000	649	654
Banque de Montréal 4,54 % 18-12-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	511 000	511	529
Banque de Montréal 4,42 % 17-07-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	669 000	669	691
Banque de Montréal, taux variable 27-10-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	506 000	516	545
Banque de Montréal, taux variable 07-09-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	931 000	928	999
Banque de Montréal, taux variable 03-07-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	322 000	322	334
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 431 000	1 403	1 413
Banque de Montréal, taux variable 26-05-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	606 000	589	606
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 045 000	1 046	1 094
La Banque de Nouvelle-Écosse 5,50 % 29-12-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	469 000	469	479
La Banque de Nouvelle-Écosse 5,50 % 08-05-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	59 000	60	61
La Banque de Nouvelle-Écosse 4,68 % 01-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	431 000	431	449
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 26-09-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	305 000	305	306

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 03-05-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	318 000	318	319
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 02-08-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	224 000	224	237
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 01-08-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	277 000	276	287
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 27-07-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	578 000	574	598
Baytex Energy Corp. 8,50 % 30-04-2030 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	122 000 USD	172	171
BCE Inc. 2,20 % 29-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	176 000	175	168
BCE Inc. 3,00 % 17-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	300 000	266	284
bclMC Realty Corp. 1,07 % 04-02-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	148 000	148	143
Becle SAB de CV 2,50 % 14-10-2031	Mexique	Sociétés – Non convertibles	430 000 USD	539	484
Bell Canada 4,45 % 27-02-2047, rachetables 2046	Canada	Sociétés – Non convertibles	374 000	414	341
Bell Canada 5,15 % 14-11-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	617 000	621	649
Bell Canada 5,25 % 15-03-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	345 000	345	365
Compagnie de téléphone Bell du Canada 5,15 % 24-08-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	285 000	284	301
Compagnie de téléphone Bell du Canada 5,15 % 09-02-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	183 000	177	185
Bimbo Bakeries USA Inc. 6,05 % 15-01-2029	Mexique	Sociétés – Non convertibles	280 000 USD	387	400
BP Capital Markets PLC 3,47 % 15-05-2025	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	397 000	400	396
British Columbia Investment Management 4,90 % 02-06-2033	Canada	Gouvernements provinciaux	1 122 000	1 172	1 234
Broadcast Media Partners Holdings Inc. 4,50 % 01-05-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	95 000 USD	115	115
Broadcom Inc. 4,11 % 15-09-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	212 000 USD	270	286
Brookfield Infrastructure Finance ULC 5,62 % 14-11-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	414 000	414	436
Brookfield Infrastructure Finance ULC 4,20 % 11-09-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	616 000	627	625
Brookfield Infrastructure Finance ULC 2,86 % 01-09-2032, rachetables 2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	73 000	73	66
Brookfield Renewable Energy Partners ULC 3,63 % 15-01-2027, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 293 000	2 402	2 294
Brookfield Renewable Partners ULC 5,29 % 28-10-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	115 000	121	123
Brookfield Renewable Partners ULC 4,96 % 20-10-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	190 000	190	197
Bruce Power L.P. 4,00 % 21-06-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	531 000	508	534
CAE Inc. 5,54 % 12-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	233 000	233	245
Administration aéroportuaire de Calgary 3,55 % 07-10-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	121 000	98	103
Corporation Cameco 4,94 % 24-05-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	213 000	213	223
Investissements RPC 2,25 % 01-12-2031	Canada	Gouvernement fédéral	751 000	744	702
Canadian Core Real Estate LP 3,30 % 02-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	291 000	291	285
Banque Canadienne Impériale de Commerce 1,10 % 19-01-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	93 000	92	90
Banque Canadienne Impériale de Commerce 5,00 % 07-12-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	399 000	399	411
Banque Canadienne Impériale de Commerce 4,95 % 29-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 134 000	1 144	1 175
Banque Canadienne Impériale de Commerce 5,05 % 07-10-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	228 000	227	238
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 21-04-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	342 000	342	333
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 07-04-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	245 000	242	247
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 20-01-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	294 000	294	306
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 20-04-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	181 000	181	189
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 16-01-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	346 000	346	363
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 12-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	342 000	341	354
Banque Canadienne Impériale de Commerce 4,38 % 28-10-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	997 000	985	986
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 28-07-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	234 000	233	243
Fonds hypothécaire Canada 3,84 % 01-11-2028	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	1 354 316	1 315	1 377
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada 4,40 % 10-05-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000	250	260
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 2,54 % 28-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 276 000	1 209	1 242
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 3,15 % 13-03-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	314 000	305	310
Canadian Utilities Ltd. 4,85 % 03-06-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	297 000	295	303
Banque canadienne de l'Ouest 3,86 % 21-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	216 000	216	216
Banque canadienne de l'Ouest 5,26 % 20-12-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	128 000	128	130
Banque canadienne de l'Ouest 1,93 % 16-04-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	432 000	432	422
Banque canadienne de l'Ouest 5,15 % 02-09-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	751 000	752	785
Banque canadienne de l'Ouest 4,57 % 11-07-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	83 000	83	86

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Banque canadienne de l'Ouest, taux variable 22-12-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	121 000	121	128
Banque canadienne de l'Ouest 5,95 % 29-01-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	166 000	166	177
Banque canadienne de l'Ouest, taux variable 31-07-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	134 000	134	131
Cannabist Co. Holdings Inc. 6,00 % 29-06-2025	Canada	Sociétés – Convertibles	46 000 USD	57	53
Cannabist Co. Holdings Inc. 9,50 % 03-02-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000 USD	50	41
Capital Power Corp. 4,99 % 23-01-2026, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	173 000	174	175
Capital Power Corp. 4,83 % 16-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	244 000	244	247
Cascades inc. 5,13 % 15-01-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	35 000	35	35
Cascades inc. 5,13 % 15-01-2026 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	90 000 USD	119	120
CCL Industries Inc. 3,86 % 13-04-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	259 000	259	259
CDP Financière inc. 4,20 % 02-12-2030	Canada	Gouvernements provinciaux	782 000	790	824
Enovus Energy Inc. 3,50 % 07-02-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 126 000	1 113	1 120
Central 1 Credit Union 5,88 % 10-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	169 000	169	176
CES Energy Solutions Corp. 6,88 % 24-05-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	123 000	124	125
CGI inc. 3,99 % 07-09-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	241 000	241	244
CGI inc. 4,15 % 05-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	171 000	171	174
Charter Communications Operating LLC 4,50 % 01-05-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	397 000 USD	546	465
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 2,46 % 30-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	164 000	164	160
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 2,85 % 21-05-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	243 000	249	239
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 3,53 % 11-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	967 000	995	951
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 5,40 % 01-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	550 000	551	584
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 5,70 % 28-02-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	138 000	137	149
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 5,03 % 28-02-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	80 000	80	84
CIFI Holdings (Group) Co. Ltd. 6,00 % 16-07-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	64	26
Ville de Toronto 2,60 % 24-09-2039	Canada	Administrations municipales	328 000	326	271
Clydesdale Acquisition Holdings Inc. 8,75 % 15-04-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	7 000 USD	9	10
Coast Capital Savings Federal Credit Union, taux variable 02-05-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	501 000	501	527
Coastal GasLink Pipeline LP 4,69 % 30-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	174 000	174	182
Coastal GasLink Pipeline LP 4,91 % 30-06-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000	250	264
Coastal GasLink Pipeline LP 5,19 % 30-09-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	208 000	208	222
Cogeco Communications inc. 6,13 % 27-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000	250	257
Cogeco Communications inc. 2,99 % 22-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	436 000	434	401
Cogeco Communications inc. 5,30 % 16-02-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	121 000	121	127
Cologix Data Centers Issuer LLC 4,94 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	16 000	16	16
Cologix Data Centers Issuer LLC 5,68 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	35 000	35	33
Comber Wind Financial Corp. 5,13 % 15-11-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	190 167	195	193
Constellation Software Inc. 5,16 % 16-02-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	49 000 USD	66	68
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	141 536	142	138
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-09-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	149 387	149	146
Corus Entertainment Inc. 5,00 % 11-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	111 000	111	54
Country Garden Holdings Co. Ltd. 2,70 % 12-07-2026	Chine	Sociétés – Non convertibles	300 000 USD	259	31
Country Garden Holdings 5,63 % 14-01-2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	220 000 USD	63	23
CPPIB Capital Inc. 3,95 % 02-06-2032	Canada	Gouvernement fédéral	354 000	352	368
Fonds de placement immobilier Crombie 3,92 % 21-06-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	56 000	61	56
Fonds de placement immobilier Crombie 2,69 % 31-03-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	259 000	261	248
Fonds de placement immobilier Crombie 3,21 % 09-10-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	154 000	155	145
Fonds de placement immobilier Crombie 3,13 % 12-08-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000	120	111
CU Inc. 4,09 % 02-09-2044, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	59 000	57	55
CU Inc. 4,77 % 14-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	284 000	284	294
CU Inc. 5,09 % 20-09-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000	250	272
Curaleaf Holdings Inc. 8,00 % 15-12-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	360 000 USD	461	459
Dollarama inc. 5,08 % 27-10-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	267 000	266	270
Dollarama inc. 5,53 % 26-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	268 000	268	286
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 1,66 % 22-12-2025 (A)	Canada	Sociétés – Non convertibles	380 000	380	370

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,54 % 07-12-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	219 000	219	213
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,06 % 17-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	348 000	335	332
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 5,38 % 22-03-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	267 000	268	279
Électricité de France SA 5,38 % 17-05-2034	France	Sociétés – Non convertibles	586 000	586	612
L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie 5,50 % 13-01-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	173 000	173	180
L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie 3,63 % 17-04-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	173 000	173	149
Enbridge Gas Inc. 2,37 % 09-08-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	181 000	182	172
Enbridge Gas Inc. 2,35 % 15-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	144 000	120	132
Enbridge Gas Inc. 5,70 % 06-10-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	367 000	379	412
Enbridge Gas Inc. 3,20 % 15-09-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	509 000	467	398
Enbridge Gas Inc. 4,55 % 17-08-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	506 000	477	500
Enbridge Inc. 4,90 % 26-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	319 000	319	333
Enbridge Inc. 6,10 % 09-11-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	299 000	319	335
Enbridge Inc. 3,10 % 21-09-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	300 000	299	274
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 567 000	3 583	3 572
Enbridge Inc., taux variable 12-04-2078, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 039 000	1 074	1 087
Enbridge Inc., taux variable 15-01-2084, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	66 000	69	73
Enbridge Inc., taux variable 15-01-2084, rachetables 2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	786 000	822	917
Pipelines Enbridge Inc. 4,55 % 29-09-2045, rachetables 2045	Canada	Sociétés – Non convertibles	91 000	82	85
Pipelines Enbridge Inc. 4,33 % 22-02-2049, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	217 000	212	194
Pipelines Enbridge Inc. 5,82 % 17-08-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	78 000	84	87
Énergir inc. 2,10 % 16-04-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	242 000	242	234
Énergir inc. 4,67 % 27-09-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	207 000	207	217
EPCOR Utilities Inc. 3,55 % 27-11-2047, rachetables 2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	319 000	317	274
EPCOR Utilities Inc. 3,11 % 08-07-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	477 000	446	376
EPCOR Utilities Inc. 4,73 % 02-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	285 000	285	293
EPCOR Utilities Inc. 5,33 % 03-10-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	526 000	545	592
EPCOR Utilities Inc. 4,99 % 31-05-2054	Canada	Sociétés – Non convertibles	297 000	297	319
Banque Équitable 1,88 % 26-11-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	48 000	43	47
Banque Équitable 3,36 % 02-03-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	228 000	228	226
Banque Équitable 5,16 % 11-01-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	319 000	319	328
Banque Équitable 3,99 % 24-03-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000	200	200
Fairfax Financial Holdings Ltd. 8,30 % 15-04-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	950 000 USD	1 435	1 353
Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,23 % 14-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	138 000	138	140
Fairfax Financial Holdings Ltd. 3,95 % 03-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	398 000	385	394
Fédération des caisses Desjardins du Québec 5,20 % 01-10-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	359 000	359	364
Fédération des caisses Desjardins du Québec 1,59 % 10-09-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	434 000	408	420
Fédération des caisses Desjardins du Québec 4,41 % 19-05-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	300 000	300	307
Fédération des caisses Desjardins du Québec 5,47 % 17-11-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	531 000	538	568
Fédération des caisses Desjardins du Québec 3,80 % 24-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	252 000	252	253
Fédération des caisses Desjardins du Québec, taux variable 23-08-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	596 000	596	615
Fédération des caisses Desjardins du Québec, taux variable 15-05-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	317 000	317	333
Fonds de placement immobilier First Capital 3,45 % 01-03-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	190 000	168	187
Fonds de placement immobilier First Capital 5,46 % 12-06-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	122 000	122	128
First Capital Realty Inc. 5,57 % 01-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	810 000	824	861
First West Credit Union 9,19 % 09-08-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	199 000	199	221
Compagnie Crédit Ford du Canada 7,00 % 10-02-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	704 000	704	729
Compagnie Crédit Ford du Canada 7,38 % 12-05-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	376 000	376	394
Compagnie Crédit Ford du Canada 2,96 % 16-09-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	164 000	164	161
Compagnie Crédit Ford du Canada 6,33 % 10-11-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	207 000	207	216
Compagnie Crédit Ford du Canada 5,58 % 22-02-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	179 000	179	184
Compagnie Crédit Ford du Canada 5,24 % 23-05-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	230 000	230	236
Compagnie Crédit Ford du Canada 4,79 % 12-09-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	180 000	180	181
Ford Motor Credit Co. LLC 6,78 % 15-09-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	483 000	483	494
Fortis Inc. 4,43 % 31-05-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	501 000	501	516
Fortis Inc. 4,17 % 09-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	370 000	370	373
Fortis Inc. 5,68 % 08-11-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	302 000	302	334
FortisBC Energy Inc. 4,67 % 28-11-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	76 000	77	78
Location d'équipements Cooper Itée 7,45 % 04-07-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	497 000	497	508
Financière General Motors du Canada Ltée 5,20 % 09-02-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	190 000	190	197
Financière General Motors du Canada Ltée 5,10 % 14-07-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	218 000	218	226
Financière General Motors du Canada Ltée 5,00 % 09-02-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	222 000	222	230

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
George Weston Itée 4,19 % 05-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	202 000	202	205
GFL Environmental Inc. 3,50 % 01-09-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	491 000 USD	587	633
GFL Environmental Inc. 6,75 % 15-01-2031 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	209 000 USD	284	297
Gibson Energy Inc. 5,75 % 12-07-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	282 000	283	308
Gibson Energy Inc., taux variable 22-12-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	129 000	130	123
Gibson Energy Inc., taux variable 12-07-2083	Canada	Sociétés – Non convertibles	127 000	129	138
Glencore Funding LLC 5,34 % 04-04-2027 144A	Australie	Sociétés – Non convertibles	140 000 USD	190	194
Glencore Funding LLC 5,70 % 08-05-2033 144A	Australie	Sociétés – Non convertibles	250 000 USD	345	355
GoDaddy Operating Co. LLC 3,50 % 01-03-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000 USD	12	13
The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 30-11-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	656 000	656	642
The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 28-02-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	271 000	271	257
Gouvernement des Bahamas 8,95 % 15-10-2032	Bahamas	Gouvernements étrangers	440 000 USD	569	607
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2027	Brésil	Gouvernements étrangers	400 000 BRL	1 020	950
Gouvernement du Canada 3,25 % 01-09-2028	Canada	Gouvernement fédéral	27 000	27	28
Gouvernement du Canada 3,50 % 01-03-2034	Canada	Gouvernement fédéral	1 775 000	1 768	1 860
Gouvernement du Canada 3,00 % 01-06-2034	Canada	Gouvernement fédéral	7 820 000	7 693	7 853
Gouvernement du Canada 0,50 % 01-12-2050, rendement réel	Canada	Gouvernement fédéral	2 578 000	3 086	2 528
Obligations du gouvernement du Canada indexées sur l'inflation 0,25 % 01-12-2054	Canada	Gouvernement fédéral	825 000	663	685
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-12-2055	Canada	Gouvernement fédéral	26 750 000	23 583	24 727
Fiducie de placement immobilier Granite 3,06 % 04-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	181 000	169	178
Fiducie de placement immobilier Granite 2,19 % 30-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	544 000	519	511
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 1,54 % 03-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	477 000	421	449
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 7,05 % 12-06-2030, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	268 000	306	311
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 7,10 % 04-06-2031, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	268 000	311	317
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 6,47 % 02-02-2034, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	58 000	67	69
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 2,75 % 17-10-2039	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 057 000	850	870
Fonds de placement immobilier H&R 4,07 % 16-06-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	400 000	404	400
HCA Healthcare Inc. 3,50 % 01-09-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	85 000 USD	113	109
Heathrow Funding Ltd. 3,25 % 21-05-2025	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	666 000	693	663
Heathrow Funding Ltd. 2,69 % 13-10-2027	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	269 000	269	262
Heathrow Funding Ltd. 3,40 % 08-03-2028	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	587 000	595	582
Heathrow Funding Ltd. 3,79 % 04-09-2030, rachetables 2030	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	928 000	964	915
Heathrow Funding Ltd. 3,73 % 13-04-2033	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	531 000	528	505
Hydro One Inc. 4,91 % 27-01-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	753 000	760	789
Hydro One Inc. 7,35 % 03-06-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	534 000	612	630
Hydro One Inc. 2,23 % 17-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	375 000	343	344
Hydro One Inc. 6,93 % 01-06-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	348 000	405	415
Hydro One Inc. 4,16 % 27-01-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	182 000	182	187
Hydro One Inc. 4,39 % 01-03-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	340 000	340	353
Hydro One Inc. 4,89 % 13-03-2037	Canada	Sociétés – Non convertibles	482 000	469	506
Hydro One Inc. 4,85 % 30-11-2054	Canada	Sociétés – Non convertibles	975 000	992	1 031
Hyundai Capital Canada Inc. 4,90 % 31-01-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	331 000	331	344
iA Société financière inc., taux variable 20-06-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	164 000	164	174
L'Ordre Indépendant des Forestiers, taux variable 15-10-2035, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	285 000	285	256
Intact Corporation financière 5,46 % 22-09-2032 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	230 000 USD	305	319
Intact Corporation financière, taux variable 16-05-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	134 000	134	139
Intact Corporation financière 5,28 % 14-09-2054	Canada	Sociétés – Non convertibles	295 000	318	328
Intact Corporation financière, taux variable 31-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	99 000	99	96
Inter Pipeline Ltd. 3,48 % 16-12-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	657 000	674	652
Inter Pipeline Ltd. 3,98 % 25-11-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	155 000	155	147
Inter Pipeline Ltd., taux variable 26-03-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	129 000	129	131
Inter Pipeline Ltd., taux variable 19-11-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	48 000	46	48
Banque internationale pour la reconstruction et le développement 0 % 31-03-2027	Supranationales	s.o.	440 000 USD	539	542
The J.M. Smucker Co. 2,38 % 15-03-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	147 000 USD	172	180
Jazz Pharmaceuticals PLC 4,38 % 15-01-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	250	262
John Deere Financial Inc. 5,17 % 15-09-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	121 000	119	128
JPMorgan Chase & Co. 1,90 % 05-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	898 000	898	864
Kaisa Group Holdings 9,38 % 10-12-2024	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	186	13

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Kaisa Group Holdings 8,65 % 10-12-2024	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	91	9
Kaisa Group Holdings 10,50 % 10-12-2024	Chine	Sociétés – Non convertibles	500 000 USD	360	20
Keyera Corp. 3,96 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	794 000	844	790
Keyera Corp., taux variable 13-06-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	164 000	164	169
Keyera Corp., taux variable 10-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	345 000	345	340
Knight Health Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 17-12-2028	États-Unis	Prêts à terme	123 784 USD	148	96
Produits Kruger S.E.C. 5,38 % 09-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	60 000	60	57
LABL Escrow Issuer LLC 6,75 % 15-07-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	23 000 USD	31	31
LABL Inc. 8,25 % 01-11-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000 USD	23	24
LABL Inc. 8,63 % 01-10-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	22 000 USD	30	30
Banque Laurentienne du Canada, taux variable 15-06-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	575 000	575	564
LGI Homes Inc. 8,75 % 15-12-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000 USD	27	29
Liberty Utilities (Canada) LP 3,32 % 14-02-2050, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	155 000	155	118
Les Compagnies Loblaw ltée 2,28 % 07-05-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	165 000	166	154
Les Compagnies Loblaw ltée 5,34 % 13-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	190 000	190	204
Les Compagnies Loblaw ltée 5,12 % 04-03-2054	Canada	Sociétés – Non convertibles	350 000	350	365
Logan Group Co. Ltd. 4,70 % 06-07-2026	Chine	Sociétés – Non convertibles	440 000 USD	334	52
Lower Mattagami Energy LP 2,43 % 14-05-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	328 000	328	305
Lower Mattagami Energy LP 4,85 % 31-10-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	114 000	114	122
Lower Mattagami Energy LP 4,69 % 07-06-2054	Canada	Sociétés – Non convertibles	150 000	150	156
LSF10 XL Bidco SCA, prêt à terme B de premier rang, taux variable 30-03-2028	Luxembourg	Prêts à terme	196 298 EUR	289	270
Banque Manuvie du Canada 1,54 % 14-09-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	281 000	281	271
Banque Manuvie du Canada 2,86 % 16-02-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	501 000	501	495
Société Financière Manuvie, taux variable 10-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	605 000	621	635
Société Financière Manuvie, taux variable 23-02-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	317 000	317	331
Société Financière Manuvie, taux variable 19-06-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	418 000	415	432
Mattamy Group Corp. 4,63 % 01-03-2030, rachetables 2025 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	52 000 USD	57	67
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 9,25 % 15-04-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	9 000 USD	12	12
Mauser Packaging 7,88 % 15-04-2027, nom.	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	8 000 USD	11	11
MEG Energy Corp. 7,13 % 01-02-2027 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	22 000 USD	29	30
MEG Energy Corp. 5,88 % 01-02-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	182 000 USD	236	241
Metro inc. 4,66 % 07-02-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	162 000	160	168
Micron Technology Inc. 5,38 % 15-04-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	212 000 USD	285	295
Banque Nationale du Canada 5,30 % 03-11-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	311 000	312	316
Banque Nationale du Canada 1,53 % 15-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	284 000	273	276
Banque Nationale du Canada, taux variable 18-08-2026, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	337 000	337	330
Banque Nationale du Canada 5,22 % 14-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	483 000	482	511
Banque Nationale du Canada 5,02 % 01-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	503 000	509	531
Banque Nationale du Canada, taux variable 16-08-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	587 000	587	612
Banque Nationale du Canada 5,28 % 15-02-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	170 000	170	178
Banque Nationale du Canada, taux variable 15-08-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	397 000	398	352
NAV CANADA 2,06 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	216 000	216	200
Nestlé Holdings Inc. 2,19 % 26-01-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	354 000	354	338
NextEra Energy Capital Holdings Inc. 1,90 % 15-06-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	224 000 USD	269	279
NextEra Energy Capital Holdings Inc. 2,25 % 01-06-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	242 000 USD	340	293
NextEra Energy Capital Holdings Inc. 4,85 % 30-04-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	782 000	785	816
North West Redwater Partnership 3,20 % 24-04-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	347 000	332	345
North West Redwater Partnership 2,80 % 01-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	436 000	433	429
North West Redwater Partnership 4,25 % 01-06-2029, rachetables, série F	Canada	Sociétés – Non convertibles	207 000	207	212
North West Redwater Partnership 2,80 % 01-06-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 265 000	1 232	1 185
North West Redwater Partnership 4,15 % 01-06-2033, série H	Canada	Sociétés – Non convertibles	720 000	650	722
North West Redwater Partnership 4,85 % 01-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	198 000	198	207
North West Redwater Partnership 3,65 % 01-06-2035, rachetables 2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	396 000	344	374
North West Redwater Partnership 3,70 % 23-02-2043, rachetables 2042	Canada	Sociétés – Non convertibles	139 000	130	122
Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc. 4,11 % 31-03-2042	Canada	Sociétés – Non convertibles	257 662	258	238
NXP BV 2,65 % 15-02-2032	Chine	Sociétés – Non convertibles	121 000 USD	151	142
Ontario Power Generation Inc. 2,89 % 08-04-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	557 000	560	554
Ontario Power Generation Inc. 1,17 % 22-04-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	321 000	286	309

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Ontario Power Generation Inc. 4,83 % 28-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	228 000	228	240
Ontario Teachers' Finance Trust 1,10 % 19-10-2027	Canada	Gouvernements provinciaux	289 000	288	273
Ontario Teachers' Finance Trust 4,30 % 02-06-2034	Canada	Gouvernements provinciaux	892 000	905	932
Régime de retraite des enseignantes et des enseignants de l'Ontario 4,45 % 02-06-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	656 000	656	698
Corporation Parkland du Canada 3,88 % 16-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	906 000	906	892
Corporation Parkland du Canada 4,38 % 26-03-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	164 000	154	158
Corporation Pétroles Parkland 6,00 % 23-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	570 000	567	574
Pembina Pipeline Corp. 5,72 % 22-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	117 000	117	117
Pembina Pipeline Corp. 4,02 % 27-03-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 208 000	1 290	1 222
Pembina Pipeline Corp. 5,22 % 28-06-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	260 000	260	274
Pembina Pipeline Corp. 5,21 % 12-01-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	310 000	310	326
Pembina Pipeline Corp. 4,81 % 25-03-2044	Canada	Sociétés – Non convertibles	698 000	746	661
Pembina Pipeline Corp. 4,74 % 21-01-2047, rachetables 2046, série MTN	Canada	Sociétés – Non convertibles	211 000	207	197
Pembina Pipeline Corp. 5,67 % 12-01-2054	Canada	Sociétés – Non convertibles	260 000	260	276
Pembina Pipeline Corp., taux variable 25-01-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	466 000	466	436
Perrigo Co. PLC 3,15 % 15-06-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	17 000 USD	21	22
Petróleos de Venezuela 6,00 % 06-12-2024	Venezuela	Sociétés – Non convertibles	220 000 USD	70	29
Petróleos Mexicanos 6,70 % 16-02-2032	Mexique	Sociétés – Non convertibles	13 000 USD	17	16
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 4,65 % 19-05-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	800 000 USD	1 077	1 108
Prologis Inc. 4,70 % 01-03-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	310 000	309	321
Prologis Inc. 5,25 % 15-01-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	95 000	93	101
Province de l'Alberta 4,15 % 01-06-2033	Canada	Gouvernements provinciaux	859 000	844	900
Province de l'Alberta 3,05 % 01-12-2048	Canada	Gouvernements provinciaux	1 364 000	1 414	1 137
Province de l'Alberta 3,10 % 01-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	8 786 000	8 961	7 372
Province de l'Alberta 2,95 % 01-06-2052	Canada	Gouvernements provinciaux	1 587 000	1 435	1 286
Province de l'Alberta 4,45 % 01-12-2054	Canada	Gouvernements provinciaux	328 000	349	347
Province de la Colombie-Britannique 4,15 % 18-06-2034	Canada	Gouvernements provinciaux	1 989 000	1 979	2 071
Province de la Colombie-Britannique 2,95 % 18-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	1 755 000	1 943	1 432
Province de la Colombie-Britannique 4,45 % 18-12-2055	Canada	Gouvernements provinciaux	1 515 000	1 574	1 607
Province du Manitoba 3,20 % 05-03-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	2 361 000	2 526	1 987
Province du Manitoba 2,05 % 05-09-2052	Canada	Gouvernements provinciaux	1 150 000	868	745
Province du Manitoba 3,80 % 05-09-2053	Canada	Gouvernements provinciaux	776 000	721	722
Province de l'Ontario 4,05 % 02-02-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	2 104 000	2 101	2 203
Province de l'Ontario 4,10 % 04-03-2033	Canada	Gouvernements provinciaux	1 118 000	1 114	1 169
Province de l'Ontario 4,15 % 02-06-2034	Canada	Gouvernements provinciaux	21 746 000	21 480	22 668
Province de l'Ontario 4,15 % 02-12-2054	Canada	Gouvernements provinciaux	2 236 000	2 222	2 265
Province de l'Ontario 4,60 % 02-12-2055	Canada	Gouvernements provinciaux	2 839 000	3 049	3 103
Province de Québec 3,65 % 20-05-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	596 000	596	608
Province de Québec 3,90 % 22-11-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	449 000	442	465
Province de Québec 4,45 % 01-09-2034	Canada	Gouvernements provinciaux	6 674 000	6 771	7 110
Province de Québec 4,40 % 01-12-2055	Canada	Gouvernements provinciaux	10 255 000	10 533	10 799
Province de la Saskatchewan 2,15 % 02-06-2031	Canada	Gouvernements provinciaux	156 000	137	146
Province de la Saskatchewan 3,10 % 02-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	1 733 000	1 624	1 456
Province de la Saskatchewan 2,80 % 02-12-2052	Canada	Gouvernements provinciaux	1 728 000	1 710	1 356
Province de la Saskatchewan 4,20 % 02-12-2054	Canada	Gouvernements provinciaux	676 000	691	686
PSP Capital Inc. 0,90 % 15-06-2026	Canada	Gouvernement fédéral	197 000	197	190
PSP Capital Inc. 2,60 % 01-03-2032	Canada	Gouvernement fédéral	1 174 000	1 171	1 115
PSP Capital Inc. 4,15 % 01-06-2033	Canada	Gouvernement fédéral	104 000	105	109
Reliance LP 2,68 % 01-12-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	268 000	269	259
Reliance LP 2,67 % 01-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	354 000	354	337
Reliance LP 5,25 % 15-05-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	309 000	309	324
Renasas Electronics Corp. 1,54 % 26-11-2024	Japon	Sociétés – Non convertibles	300 000 USD	378	404
Fonds de placement immobilier RioCan 2,83 % 08-11-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	495 000	449	472
Rogers Communications Inc. 3,10 % 15-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 447 000	1 385	1 439
Rogers Communications Inc. 5,70 % 21-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	517 000	516	551
Rogers Communications Inc. 3,75 % 15-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	565 000	562	561
Rogers Communications Inc. 2,90 % 09-12-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	365 000	356	341
Rogers Communications Inc. 5,25 % 15-04-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	244 000	237	246
Rogers Communications Inc., taux variable 17-12-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 787 000	3 532	3 744
Rogers Communications Inc., taux variable 15-03-2082 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	764 000 USD	977	1 015
Banque Royale du Canada 5,24 % 02-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	372 000	373	385
Banque Royale du Canada 2,33 % 28-01-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	473 000	426	462
Banque Royale du Canada 4,61 % 26-07-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	282 000	279	291

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Banque Royale du Canada 4,64 % 17-01-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	622 000	622	644
Banque Royale du Canada 4,63 % 01-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	173 000	173	180
Banque Royale du Canada, taux variable 03-05-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	229 000	216	225
Banque Royale du Canada, taux variable 03-04-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	357 000	357	373
Banque Royale du Canada, taux variable 08-08-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	641 000	641	662
Banque Royale du Canada, taux variable 24-11-2080, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 103 000	2 054	2 084
Royal Caribbean Cruises Ltd. 6,00 % 01-02-2033 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	167 000 USD	231	232
S&P Global Inc. 1,25 % 15-08-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	173 000 USD	230	200
Sagen MI Canada Inc., taux variable 24-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	233 000	233	216
Saputo inc. 5,49 % 20-11-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	285 000	285	307
Sea to Sky Highway Investment LP 2,63 % 31-08-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	299 178	303	287
Sienna Senior Living Inc. 3,11 % 04-11-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	121 000	121	121
Sienna Senior Living Inc. 3,45 % 27-02-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	181 000	181	179
Sienna Senior Living Inc. 2,82 % 31-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	121 000	121	117
Sienna Senior Living Inc. 4,44 % 17-10-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	61 000	61	61
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 2,70 % 13-01-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	350 000 USD	153	34
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 4,75 % 05-08-2029	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	104	20
South Bow Canadian Infrastructure Holdings Ltd. 4,32 % 01-02-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	93 000	93	94
South Bow Canadian Infrastructure Holdings Ltd. 4,62 % 01-02-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	153 000	153	155
Sprint Spectrum Co. LLC 4,74 % 20-03-2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	28 750 USD	37	39
Spy Hill Power LP 4,14 % 31-03-2036	Canada	Sociétés – Non convertibles	123 951	127	122
Stella-Jones Inc. 4,31 % 01-10-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	154 000	154	155
Financière Sun Life inc., taux variable 10-05-2032, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	492 000	492	480
Financière Sun Life inc., taux variable 21-11-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	477 000	477	460
Financière Sun Life inc., taux variable 10-08-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	817 000	813	849
Financière Sun Life inc., taux variable 04-07-2035	Canada	Sociétés – Non convertibles	87 000	87	94
Financière Sun Life inc., taux variable 01-10-2035	Canada	Sociétés – Non convertibles	483 000	483	435
Financière Sun Life inc., taux variable 15-05-2036	Canada	Sociétés – Non convertibles	392 000	392	414
Sunac China Holdings Ltd. 6,00 % 30-09-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	16 053 USD	6	3
Sunac China Holdings Ltd. 6,25 % 30-09-2026	Chine	Sociétés – Non convertibles	16 073 USD	6	2
Sunac China Holdings Ltd. 6,50 % 30-09-2027	Chine	Sociétés – Non convertibles	31 153 USD	10	4
Sunac China Holdings Ltd. 6,75 % 30-09-2028	Chine	Sociétés – Non convertibles	47 303 USD	14	6
Sunac China Holdings Ltd. 7,00 % 30-09-2029	Chine	Sociétés – Non convertibles	47 360 USD	12	5
Sunac China Holdings Ltd. 7,25 % 30-09-2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	22 575 USD	5	2
Sunac China Holdings Ltd. 1,00 % 30-09-2032	Chine	Sociétés – Non convertibles	18 832 USD	5	2
Suncor Énergie Inc. 5,40 % 17-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	396 000	395	411
Suncor Énergie Inc. 3,95 % 04-03-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	354 000	348	303
Tamarack Valley Energy Ltd. 7,25 % 10-05-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	63 000	59	64
TELUS Corp. 4,80 % 15-12-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	88 000	88	92
TELUS Corp. 3,15 % 19-02-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	677 000	717	653
TELUS Corp. 4,95 % 18-02-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	169 000	169	177
TELUS Corp. 4,65 % 13-08-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	209 000	209	215
TELUS Corp. 4,95 % 28-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	164 000	164	171
Teranet Holdings LP 3,72 % 23-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	665 000	665	647
T-Mobile USA Inc. 3,75 % 15-04-2027, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	785 000 USD	1 097	1 049
T-Mobile USA Inc. 4,95 % 15-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	195 000 USD	262	270
T-Mobile USA Inc. 4,85 % 15-01-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	60 000 USD	80	83
T-Mobile USA Inc. 5,20 % 15-01-2033	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	406 000 USD	525	569
T-Mobile USA Inc. 5,15 % 15-04-2034	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	80 000 USD	107	111
Groupe TMX Ltée 2,30 % 11-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	708 000	733	706
Groupe TMX Ltée 3,78 % 05-06-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	164 000	165	165
Groupe TMX Ltée 4,68 % 16-08-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	132 000	132	138
Groupe TMX Ltée 2,02 % 12-02-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	207 000	207	187
Toronto Hydro Corp. 4,61 % 14-06-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	337 000	337	356
Toronto Hydro Corp. 4,95 % 13-10-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	392 000	405	421
La Banque Toronto-Dominion 2,67 % 09-09-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	182 000	177	180
La Banque Toronto-Dominion 4,34 % 27-01-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	637 000	628	642
La Banque Toronto-Dominion 5,42 % 10-07-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	345 000	345	356
La Banque Toronto-Dominion 2,26 % 07-01-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	283 000	283	276
La Banque Toronto-Dominion 4,21 % 01-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 213 000	1 191	1 235
La Banque Toronto-Dominion 5,38 % 21-10-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	551 000	556	580
La Banque Toronto-Dominion 4,48 % 18-01-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	460 000	457	474
La Banque Toronto-Dominion 5,49 % 08-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	466 000	466	499
La Banque Toronto-Dominion 4,68 % 08-01-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	197 000	197	205

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 22-04-2030, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 073 000	1 045	1 067
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 26-01-2032, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	289 000	283	285
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 09-04-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	303 000	303	317
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-10-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	149 000	151	156
Tourmaline Oil Corp. 2,53 % 12-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	181 000	181	173
Crédit Toyota Canada Inc. 4,44 % 27-06-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	170 000	170	176
Crédit Toyota Canada Inc. 3,73 % 02-10-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	233 000	233	234
TransCanada PipeLines Ltd. 3,80 % 05-04-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	460 000	488	463
TransCanada PipeLines Ltd. 5,28 % 15-07-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	553 000	553	589
TransCanada PipeLines Ltd. 4,33 % 16-09-2047, rachetables 2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	196 000	164	177
TransCanada PipeLines Ltd. 4,34 % 15-10-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	396 000	334	357
TransCanada PipeLines Ltd. 5,92 % 12-05-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	90 000	96	101
TransCanada PipeLines Ltd. 5,30 % 15-03-2077	Canada	Sociétés – Non convertibles	46 000 USD	55	61
TransCanada PipeLines Ltd. 4,20 % 04-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	729 000	729	672
TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 332 000	4 046	4 261
Transcontinental inc. 2,67 % 03-02-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	121 000	114	120
Transurban Finance Co. Pty. Ltd. 4,56 % 14-11-2028, rachetables 2028	Australie	Sociétés – Non convertibles	805 000	852	817
Trillium Windpower LP 5,80 % 15-02-2033	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	64 859	67	68
Trulieve Cannabis Corp. 8,00 % 06-10-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	53 000 USD	65	70
Uber Technologies Inc. 8,00 % 01-11-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	165 000 USD	214	224
Union Gas Ltd. 4,20 % 02-06-2044, rachetables 2043	Canada	Sociétés – Non convertibles	138 000	129	130
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,12 % 15-04-2025	États-Unis	Gouvernements étrangers	5 429 000 USD	8 901	8 785
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052	États-Unis	Gouvernements étrangers	1 795 000 USD	2 361	1 704
Obligations du Trésor des États-Unis 2,13 % 15-02-2054	États-Unis	Gouvernements étrangers	1 457 000 USD	2 090	2 098
Administration de l'aéroport de Vancouver 1,76 % 20-09-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	275 000	241	249
Ventas Canada Finance Ltd. 5,40 % 21-04-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	371 000	371	390
Ventas Canada Finance Ltd. 5,10 % 05-03-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	272 000	272	284
Ventas Realty LP 4,00 % 01-03-2028, rachetables 2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	276 000 USD	352	368
Veren Inc. 4,97 % 21-06-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	233 000	233	241
Verizon Communications Inc. 2,38 % 22-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	114 000	101	110
Vermilion Energy Inc. 6,88 % 01-05-2030 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	45 000 USD	58	61
Vidéotron Itée 4,65 % 15-07-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	271 000	271	278
Vidéotron Itée 3,63 % 15-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 359 000	1 300	1 346
Vidéotron Itée 4,50 % 15-01-2030, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	839 000	811	851
Vidéotron Itée 3,13 % 15-01-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 790 000	1 761	1 682
Crédit VW Canada Inc. 4,21 % 19-08-2027	Allemagne	Sociétés – Non convertibles	65 000	66	66
Crédit VW Canada Inc. 5,73 % 20-09-2028	Allemagne	Sociétés – Non convertibles	200 000	213	213
Crédit VW Canada Inc. 4,42 % 20-08-2029	Allemagne	Sociétés – Non convertibles	450 000	455	457
The Walt Disney Co. 3,06 % 30-03-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	484 000	512	480
Waste Management of Canada Corp. 2,60 % 23-09-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	422 000	421	415
Wells Fargo & Co. 2,57 % 01-05-2026, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	704 000	715	697
Wells Fargo & Co. 2,98 % 19-05-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	28 000	28	28
Welltower Inc. 2,95 % 15-01-2027, rachetables 2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	163 000	148	159
Welltower Inc. 4,25 % 15-04-2028, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	268 000 USD	350	363
Welltower Inc. 4,13 % 15-03-2029, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	216 000 USD	285	290
Groupe WSP Global Inc. 2,41 % 19-04-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	312 000	314	298
Groupe WSP Global Inc. 4,12 % 12-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	176 000	176	177
Zoetis Inc. 2,00 % 15-05-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	371 000 USD	408	443
Total des obligations				310 534	309 701
ACTIONS					
BCE Inc., priv., série AA	Canada	Services de communication	5 998	93	103
BCE Inc., priv., série AI	Canada	Services de communication	1 083	17	17
BCE Inc. 4,54 %, à div. cumulatif rachetable, priv. de premier rang, série R, rachetables	Canada	Services de communication	338	6	5
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 46	Canada	Biens immobiliers	6 945	175	159
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 48	Canada	Biens immobiliers	2 937	73	68

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
ACTIONS (suite)					
Brookfield Renewable Partners L.P., priv., série 13	Canada	Services publics	2 677	66	60
Emera Inc., priv., série J	Canada	Services publics	347	9	7
Emera Inc., priv., série L	Canada	Services publics	2 975	74	58
Les Compagnies Loblaw Itée 5,30 %, à div. cumulatif rachetable, priv. de second rang, série B	Canada	Consommation de base	1 338	35	31
Source Energy Services Ltd.	Canada	Énergie	175	20	2
TransAlta Corp., perpétuelles, priv., série C	Canada	Services publics	1 062	20	21
TransAlta Corp., priv., série A	Canada	Services publics	10 734	140	160
Total des actions				728	691
OPTIONS					
Options achetées (se reporter au tableau des options achetées)				360	163
Total des options				360	163
FONDS/BILLETS NÉGOCIÉS EN BOURSE					
¹ FINB Obligations à long terme du gouvernement canadien Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	27 850	2 791	2 986
¹ FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	183 000	3 676	3 294
Total des fonds/billets négociés en bourse				6 467	6 280
FONDS COMMUNS DE PLACEMENT					
² Fonds à rendement absolu de titres de créance Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	799 362	7 987	6 998
² Fonds de titres à revenu fixe de sociétés mondiales Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	337 793	3 379	3 473
² Fonds de titres à taux variable de qualité Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	327 730	3 277	3 283
Total des fonds communs de placement				14 643	13 754
FONDS PRIVÉS					
³ Northleaf Private Credit II LP	Canada	Services financiers	225	2 298	2 231
⁴ Sagard Credit Partners II LP	Canada	Services financiers	225	1 149	1 192
Total des fonds privés				3 447	3 423
Coûts de transaction				(9)	–
Total des placements				336 170	334 012
Instruments dérivés (se reporter au tableau des instruments dérivés)					680
Obligation pour options vendues (se reporter au tableau des options vendues)					(20)
Trésorerie et équivalents de trésorerie					11 349
Autres éléments d'actif moins le passif					777
Actif net attribuable aux porteurs de titres					346 798

¹ Ce fonds négocié en bourse est géré par Mackenzie.

² Ce fonds est géré par Mackenzie.

³ Ce fonds est géré par Northleaf Capital Partners (Canada) Ltd., une société affiliée à Mackenzie.

⁴ Ce fonds est géré par Sagard Holdings Inc., une société affiliée à Mackenzie.

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

APERÇU DU PORTEFEUILLE

30 SEPTEMBRE 2024

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	97,1
<i>Obligations</i>	94,2
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)</i>	2,9
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)</i>	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,3
Fonds privés	1,0
Autres éléments d'actif (de passif)	0,4
Actions	0,2
Options sur swaps achetées	–
Options sur devises achetées	–
Options sur swaps vendues	–

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	81,1
États-Unis	13,0
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,3
Royaume-Uni	1,1
Australie	0,5
Autre	0,5
Autres éléments d'actif (de passif)	0,4
Irlande	0,3
Brésil	0,3
Allemagne	0,3
Mexique	0,3
France	0,2
Luxembourg	0,2
Bahamas	0,2
Chili	0,1
Japon	0,1
Îles Caïmans	0,1

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	53,0
Obligations provinciales	23,0
Obligations fédérales	14,4
Obligations d'État étrangères	4,8
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,3
Prêts à terme	1,0
Fonds privés	1,0
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,6
Autres éléments d'actif (de passif)	0,4
Services financiers	0,2
Obligations supranationales	0,2
Obligations municipales	0,1

31 MARS 2024

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	100,0
<i>Obligations</i>	92,7
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)</i>	7,3
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)</i>	–
Autres éléments d'actif (de passif)	1,3
Fonds privés	1,1
Actions	0,2
Options sur swaps achetées	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(2,6)

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	81,7
États-Unis	14,2
Mexique	1,9
Autres éléments d'actif (de passif)	1,3
Royaume-Uni	1,0
Brésil	0,5
Australie	0,5
Autre	0,3
Irlande	0,3
Luxembourg	0,2
Bahamas	0,2
Chine	0,1
Chili	0,1
Japon	0,1
Allemagne	0,1
Colombie	0,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(2,6)

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	53,1
Obligations provinciales	23,6
Obligations fédérales	14,5
Obligations d'État étrangères	7,8
Autres éléments d'actif (de passif)	1,3
Fonds privés	1,1
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,4
Prêts à terme	0,3
Services financiers	0,2
Obligations supranationales	0,2
Obligations municipales	0,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(2,6)

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

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES OPTIONS ACHETÉES

Au 30 septembre 2024

Élément sous-jacent	Nombre de contrats	Type d'option	Date d'échéance	Prix d'exercice \$	Prime payée (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
Option de vente sur devises CAD/USD	2 135 000	Vente	22 juillet 2025	1,36 USD	62	68
Indice Markit North American Investment Grade CDX	30 632 066	Vente	20 novembre 2024	72,50 USD	123	8
Option d'achat sur devises CAD/USD	2 562 000	Achat	22 juillet 2025	1,36 USD	75	50
Indice Markit North American Investment Grade CDX	43 468 000	Vente	16 octobre 2024	62,50 USD	45	2
Indice Markit North American Investment Grade CDX	41 396 000	Vente	18 décembre 2024	65,00 USD	55	35
Total des options					360	163

TABLEAU DES OPTIONS VENDUES

Au 30 septembre 2024

Élément sous-jacent	Nombre de contrats	Type d'option	Date d'échéance	Prix d'exercice \$	Prime reçue (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
Indice Markit North American Investment Grade CDX	(30 632 066)	Option de vente vendue	20 novembre 2024	87,50 USD	(76)	(4)
Indice Markit North American Investment Grade CDX	(43 468 000)	Option de vente vendue	16 octobre 2024	80,00 USD	(19)	–
Indice Markit North American Investment Grade CDX	(41 396 000)	Option de vente vendue	18 décembre 2024	80,00 USD	(28)	(16)
Total des options					(123)	(20)

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS

Au 30 septembre 2024

Tableau des contrats à terme standardisés

Type de contrat	Nombre de contrats	Date d'échéance	Prix moyen des contrats (\$)	Montant notionnel* (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 10 ans, décembre 2024	25	18 décembre 2024	124,89 CAD	3 125	3	–
Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 5 ans, décembre 2024	50	18 décembre 2024	114,55 CAD	5 772	45	–
Contrats à terme standardisés à très long terme sur obligations du Trésor américain, décembre 2024	(104)	19 décembre 2024	133,83 USD	(18 719)	164	–
Total des contrats à terme standardisés				(9 822)	212	–

* Le montant notionnel représente l'exposition aux instruments sous-jacents au 30 septembre 2024.

Tableau des contrats de change à terme de gré à gré

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	2 104 CAD	(1 541) USD	11 octobre 2024	(2 104)	(2 083)	21	–
A	2 104 CAD	(1 541) USD	11 octobre 2024	(2 104)	(2 083)	21	–
A	9 058 CAD	(6 594) USD	18 octobre 2024	(9 058)	(8 912)	146	–
A	58 CAD	(42) USD	18 octobre 2024	(58)	(57)	1	–
A	550 CAD	(400) USD	18 octobre 2024	(550)	(541)	9	–
A	273 CAD	(182) EUR	25 octobre 2024	(273)	(274)	–	(1)
A	8 EUR	(12) CAD	25 octobre 2024	12	12	–	–
A	1 615 CAD	(1 185) USD	25 octobre 2024	(1 615)	(1 602)	13	–
A	1 717 CAD	(1 260) USD	25 octobre 2024	(1 717)	(1 703)	14	–
A	5 290 CAD	(3 839) USD	8 novembre 2024	(5 290)	(5 188)	102	–
A	2 833 CAD	(2 056) USD	8 novembre 2024	(2 833)	(2 779)	54	–
A	1 514 CAD	(1 099) USD	8 novembre 2024	(1 514)	(1 485)	29	–
A	4 CAD	(3) EUR	15 novembre 2024	(4)	(4)	–	–
A	3 CAD	(2) EUR	15 novembre 2024	(3)	(3)	–	–
A	1 502 CAD	(1 114) USD	15 novembre 2024	(1 502)	(1 505)	–	(3)
A	809 CAD	(600) USD	15 novembre 2024	(809)	(811)	–	(2)
A	1 175 CAD	(858) USD	22 novembre 2024	(1 175)	(1 159)	16	–
A	6 402 CAD	(4 717) USD	22 novembre 2024	(6 402)	(6 371)	31	–
A	3 280 CAD	(2 415) USD	22 novembre 2024	(3 280)	(3 263)	17	–
Total des contrats de change à terme de gré à gré						474	(6)

Total des actifs dérivés

686

Total des passifs dérivés

(6)

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

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 2024 et 2023 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 2024. Pour l'exercice au cours duquel un fonds ou une série est établi(e) ou rétabli(e), l'information fournie se rapporte à la période commençant à la date d'établissement ou de rétablissement. Lorsqu'une série d'un fonds a été dissoute au cours de l'une ou l'autre des périodes, l'information concernant la série est fournie jusqu'à la fermeture des bureaux à la date de dissolution. Se reporter à la note 10 a) pour la date de constitution du Fonds et la date d'établissement de chacune des séries.

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

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

2. Base d'établissement et mode de présentation

Les présents états financiers intermédiaires non audités (les « états financiers ») ont été établis conformément aux normes IFRS de comptabilité (« 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 établis selon les mêmes méthodes comptables, les mêmes jugements comptables critiques et les mêmes estimations que ceux qui ont été utilisés pour établir les états financiers annuels audités les plus récents du Fonds, soit ceux de l'exercice clos le 31 mars 2024. La note 3 présente un résumé des méthodes comptables significatives du Fonds en vertu des IFRS.

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

Les présents états financiers ont été approuvés aux fins de publication par le conseil d'administration de Corporation Financière Mackenzie le 12 novembre 2024.

3. Méthodes comptables significatives

a) Instruments financiers

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

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

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

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

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

Le Fonds comptabilise ses placements dans des fonds de placement à capital variable non cotés, des fonds privés (« Fonds sous-jacents ») et des fonds négociés en bourse (« FNB »), le cas échéant, à la juste valeur par le biais du résultat net. Pour les fonds privés, le gestionnaire aura recours aux évaluations fournies par les gestionnaires des fonds privés, ce qui représente la quote-part du Fonds de l'actif net de ces fonds privés. Les placements du Fonds dans des Fonds sous-jacents et des FNB, le cas échéant, sont présentés dans le tableau des placements à la juste valeur, ce qui représente l'exposition maximale du Fonds en lien avec ces placements.

Les titres rachetables du Fonds comportent de multiples obligations contractuelles différentes et confèrent aux porteurs de titres le droit de faire racheter leur participation dans le Fonds contre un montant de trésorerie égal à leur part proportionnelle de la valeur liquidative du Fonds, faisant en sorte qu'ils respectent le critère de classification à titre de passifs financiers, conformément à l'IAS 32 *Instruments financiers : Présentation*. L'obligation du Fonds à l'égard de l'actif net attribuable aux porteurs de titres est présentée au prix de rachat.

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

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

NOTES ANNEXES

3. Méthodes comptables significatives (suite)

b) Évaluation de la juste valeur

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

Les placements dans des titres cotés à une Bourse des valeurs mobilières ou négociés sur un marché hors cote, y compris les FNB, 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 significatifs disponibles, sont évalués à leur juste valeur, laquelle sera déterminée par Mackenzie à l'aide de techniques d'évaluation appropriées et acceptées par le secteur, y compris des modèles d'évaluation. La juste valeur d'un titre déterminée à l'aide de modèles d'évaluation exige l'utilisation de facteurs et d'hypothèses fondés sur les données observables sur le marché, notamment la volatilité et les autres taux ou prix applicables. Dans des cas limités, la juste valeur d'un titre peut être déterminée grâce à des techniques d'évaluation qui ne sont pas appuyées par des données observables sur le marché.

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

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

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

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

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

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

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

Se reporter au tableau des instruments dérivés et au tableau des options achetées/vendues, le cas échéant, compris dans le tableau des placements pour la liste des instruments dérivés et des options au 30 septembre 2024.

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

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

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

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

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

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

NOTES ANNEXES

3. Méthodes comptables significatives (suite)

b) Évaluation de la juste valeur (suite)

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

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

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

c) Comptabilisation des produits

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

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

d) Commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille

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

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

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

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

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

f) Compensation

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

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

g) Devise

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

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

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

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

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

i) Valeur liquidative par titre

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

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

NOTES ANNEXES

3. Méthodes comptables significatives (suite)

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

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

k) Fusions

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

l) Modifications comptables futures

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

4. Estimations et jugements comptables critiques

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

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

Utilisation d'estimations

Juste valeur des titres non cotés sur un marché actif

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

Utilisation de jugements

Classement et évaluation des placements

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

Monnaie fonctionnelle

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

Intérêts dans des entités structurées non consolidées

Afin de déterminer si un Fonds sous-jacent ou un FNB dans lequel le Fonds investit, mais qu'il ne consolide pas, respecte la définition d'une entité structurée, Mackenzie doit exercer des jugements importants visant à établir si ces fonds sous-jacents possèdent les caractéristiques typiques d'une entité structurée. Ces Fonds sous-jacents respectent la définition d'une entité structurée, car :

- I. les droits de vote dans les Fonds sous-jacents ne sont pas des facteurs dominants pour décider qui les contrôle;
- II. les activités des Fonds sous-jacents sont assujetties à des restrictions aux termes de leurs documents de placement;
- III. les Fonds sous-jacents ont des objectifs de placement précis et bien définis visant à offrir des occasions de placement aux investisseurs tout en leur transférant les risques et avantages connexes.

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

5. Impôts sur le résultat

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

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

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

NOTES ANNEXES

6. Frais de gestion et frais d'exploitation

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

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

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

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 ou taxe applicable.

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

7. Capital du Fonds

Le capital du Fonds, qui comprend l'actif net attribuable aux porteurs de titres, est réparti entre les différentes séries, lesquelles comportent chacune un nombre illimité de titres. Les titres en circulation du Fonds aux 30 septembre 2024 et 2023 ainsi que les titres qui ont été émis, réinvestis et rachetés au cours de ces périodes sont présentés dans l'état de l'évolution de la situation financière. Mackenzie gère le capital du Fonds conformément aux objectifs de placement décrits à la note 10.

8. Risques découlant des instruments financiers

i. Exposition au risque et gestion du risque

Les activités de placement du Fonds l'exposent à divers risques financiers, tels qu'ils sont définis dans l'IFRS 7, *Instruments financiers : Informations à fournir* (« IFRS 7 »). L'exposition du Fonds aux risques financiers est concentrée dans ses placements, lesquels sont présentés dans le tableau des placements au 30 septembre 2024, regroupés par type d'actif, région géographique et secteur.

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

ii. Risque de liquidité

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

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

iii. Risque de change

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

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

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

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

NOTES ANNEXES

8. Risques découlant des instruments financiers (suite)

iv. Risque de taux d'intérêt

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

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

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

v. Autre risque de prix

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

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

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

vi. Risque de crédit

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

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

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

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

vii. Fonds sous-jacents

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

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

NOTES ANNEXES

9. Autres informations

Abréviations

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

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

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

NOTES ANNEXES

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

a) Constitution du Fonds et renseignements sur les séries

Date de constitution : 30 avril 2013

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

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

Les titres des séries A et T5 sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$ (5 000 \$ pour la série T5) selon le mode de souscription avec frais de rachat ou le mode de souscription avec frais modérés. Les investisseurs de série T5 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année.

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

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

Les titres des séries F et F5 sont offerts aux investisseurs qui participent à un programme de services rémunérés à l'acte ou de comptes intégrés parrainé par le courtier, qui sont assujettis à des frais établis en fonction de l'actif plutôt qu'à des commissions pour chaque opération et qui investissent un minimum de 500 \$ (5 000 \$ pour la série F5); ils sont également proposés aux employés de Mackenzie et de ses filiales, et aux administrateurs de Mackenzie. Les investisseurs de série F5 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année.

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

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

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

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

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

Les titres de série R sont offerts exclusivement à d'autres fonds gérés par Mackenzie et non visés par un prospectus relativement à des ententes de fonds de fonds.

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

Les titres des séries SC et S5 sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$ (5 000 \$ pour la série S5) selon le mode de souscription avec frais d'acquisition. Les investisseurs de série S5 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année.

Les titres des séries CL et F8 ne sont plus offerts à la vente.

Séries distribuées par BLC Services Financiers inc. (1360, boul. René-Lévesque Ouest, 13^e étage, Montréal (Québec) H3G 0A9; 1-800-252-1846; www.banquelaurentienne.ca/mackenzie)

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

Les titres de série LF sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$, qui participent à un programme de services rémunérés à l'acte parrainé par Gestion privée Banque Laurentienne.

Les titres de série LW sont offerts à certains investisseurs à valeur nette élevée du programme de tarification préférentielle qui investissent un minimum de 100 000 \$.

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

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

NOTES ANNEXES

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

c) Prêt de titres

	30 septembre 2024		31 mars 2024	
	(\$)		(\$)	
Valeur des titres prêtés	16 553		11 883	
Valeur des biens reçus en garantie	17 453		12 487	

	30 septembre 2024		30 septembre 2023	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
Revenus de prêts de titres bruts	7	100,0	18	100,0
Impôt retenu à la source	–	–	–	–
	7	100,0	18	100,0
Paiements à l'agent de prêt de titres	(1)	(14,3)	(3)	(16,7)
Revenu tiré du prêt de titres	6	85,7	15	83,3

d) Commissions

Pour les périodes closes les 30 septembre 2024 et 2023, les commissions versées par le Fonds n'ont pas généré de services de tiers fournis ou payés par les courtiers.

e) Risques découlant des instruments financiers

i. Exposition au risque et gestion du risque

Le Fonds vise un revenu et la préservation du capital en investissant principalement dans des titres à revenu fixe et des titres adossés à des créances de sociétés et du gouvernement du Canada. Le Fonds peut consacrer jusqu'à 30 % de son actif aux placements étrangers.

ii. Risque de change

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

Devise	30 septembre 2024				Incidence sur l'actif net			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Renforcement de 5 %		Affaiblissement de 5 %	
					(\$)	%	(\$)	%
USD	35 737	8 379	(39 974)	4 142				
BRL	950	–	–	950				
EUR	270	6	(269)	7				
Total	36 957	8 385	(40 243)	5 099				
% de l'actif net	10,7	2,4	(11,6)	1,5				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					(150)	–	483	0,1

Devise	31 mars 2024				Incidence sur l'actif net			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Renforcement de 5 %		Affaiblissement de 5 %	
					(\$)	%	(\$)	%
MXN	4 893	–	1	4 894				
BRL	1 076	–	–	1 076				
USD	42 623	2 287	(43 849)	1 061				
CNY	–	361	–	361				
EUR	390	–	(395)	(5)				
JPY	–	(67)	(18)	(85)				
Total	48 982	2 581	(44 261)	7 302				
% de l'actif net	14,6	0,8	(13,2)	2,2				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					(389)	(0,1)	389	0,1

* Comprend les instruments financiers monétaires et non monétaires.

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

NOTES ANNEXES

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

e) Risques découlant des instruments financiers (suite)

iii. Risque de taux d'intérêt

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

	Obligations (\$)	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
			Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
30 septembre 2024			(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	15 660	(9 822)				
1 an à 5 ans	79 132	–				
5 ans à 10 ans	103 149	–				
Plus de 10 ans	111 760	–				
Total	309 701	(9 822)				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt			(23 538)	(6,8)	23 543	6,8

	Obligations (\$)	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
			Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
31 mars 2024			(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	14 252	(17 164)				
1 an à 5 ans	82 293	–				
5 ans à 10 ans	91 430	–				
Plus de 10 ans	106 097	–				
Total	294 072	(17 164)				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt			(23 375)	(7,0)	23 407	7,0

iv. Autre risque de prix

Au 30 septembre 2024 et au 31 mars 2024, le Fonds n'avait aucune exposition importante à l'autre risque de prix.

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 2024 était de 11,6 % de l'actif net du Fonds (11,0 % au 31 mars 2024).

Au 30 septembre 2024 et au 31 mars 2024, les titres de créance par note de crédit étaient les suivants :

Note des obligations*	30 septembre 2024	31 mars 2024
	% de l'actif net	% de l'actif net
AAA	12,7	7,3
AA	15,5	16,9
A	22,5	26,0
BBB	25,2	23,8
Inférieure à BBB	4,5	5,7
Sans note	8,9	8,2
Total	89,3	87,9

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

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

NOTES ANNEXES

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

f) Classement de la juste valeur

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

	30 septembre 2024				31 mars 2024			
	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	–	309 648	53	309 701	–	294 019	53	294 072
Actions	691	–	–	691	645	–	–	645
Options	–	163	–	163	–	23	–	23
Fonds/billets négociés en bourse	6 280	–	–	6 280	11 664	–	–	11 664
Fonds communs de placement	13 754	–	–	13 754	6 637	–	–	6 637
Fonds privés	–	–	3 423	3 423	–	–	3 573	3 573
Actifs dérivés	212	474	–	686	31	54	–	85
Passifs dérivés	–	(26)	–	(26)	(34)	(323)	–	(357)
Placements à court terme	–	2 218	–	2 218	–	11 471	–	11 471
Total	20 937	312 477	3 476	336 890	18 943	305 244	3 626	327 813

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

Au cours des périodes, aucun transfert n'a eu lieu entre le niveau 1 et le niveau 2.

Au cours de la période close le 30 septembre 2024, des placements d'une juste valeur de néant (54 \$ au 31 mars 2024) ont été transférés du niveau 2 au niveau 3 en raison de changements en matière de données utilisées pour l'évaluation.

Le tableau ci-après présente un rapprochement des instruments financiers évalués à la juste valeur à l'aide de données non observables (niveau 3) pour les périodes closes le 30 septembre 2024 et le 31 mars 2024 :

	30 septembre 2024			31 mars 2024		
	Fonds privés (\$)	Obligations (\$)	Total (\$)	Fonds privés (\$)	Obligations (\$)	Total (\$)
Solde, à l'ouverture	3 573	53	3 626	3 540	–	3 540
Achats	62	–	62	65	–	65
Ventes	(98)	–	(98)	–	–	–
Transferts entrants	–	–	–	–	54	54
Transferts sortants	–	–	–	–	–	–
Profits (pertes) au cours de la période :						
Réalisé(e)s	9	–	9	–	–	–
Latent(e)s	(123)	–	(123)	(32)	(1)	(33)
Solde, à la clôture	3 423	53	3 476	3 573	53	3 626
Variation des profits (pertes) latent(e)s au cours de la période attribuables aux titres détenus à la clôture de la période	(123)	–	(123)	(32)	(1)	(33)

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

g) Placements détenus par le gestionnaire et des sociétés affiliées

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

	30 septembre 2024	31 mars 2024
	(\$)	(\$)
Gestionnaire	102	97
Autres fonds gérés par le gestionnaire	4 340	3 414
Fonds gérés par des sociétés affiliées au gestionnaire	2 195	2 070

FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

NOTES ANNEXES

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

h) Compensation d'actifs financiers et de passifs financiers

Les tableaux ci-après présentent les actifs financiers 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 2024			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	509	(4)	–	505
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(4)	4	960	960
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	505	–	960	1 465

	31 mars 2024			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	85	(85)	–	–
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(291)	85	1 575	1 369
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	(206)	–	1 575	1 369

i) Intérêts dans des entités structurées non consolidées

Les détails des placements du Fonds dans des fonds sous-jacents au 30 septembre 2024 et au 31 mars 2024 sont les suivants :

30 septembre 2024	% de l'actif net du Fonds sous-jacent	Juste valeur des placements du Fonds (\$)
FINB Obligations à long terme du gouvernement canadien Mackenzie	4,3	2 986
Fonds à rendement absolu de titres de créance Mackenzie, série R	7,0	6 998
Fonds de titres à revenu fixe de sociétés mondiales Mackenzie, série R	2,2	3 473
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	1,7	3 294
Fonds de titres à taux variable de qualité Mackenzie, série R	1,3	3 283
Northleaf Private Credit II LP	0,3	2 231
Sagard Credit Partners II LP	0,2	1 192

31 mars 2024	% de l'actif net du Fonds sous-jacent	Juste valeur des placements du Fonds (\$)
FINB Obligations canadiennes totales Mackenzie	0,6	5 594
FINB Obligations à long terme du gouvernement canadien Mackenzie	4,3	2 860
Fonds à rendement absolu de titres de créance Mackenzie, série R	6,9	6 637
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	1,7	3 210
Northleaf Private Credit II LP	0,3	2 371
Sagard Credit Partners II LP	0,2	1 202

j) Engagement

	30 septembre 2024		31 mars 2024	
	Montant appelé (\$ US)	Engagement d'investissement total (\$ US)	Montant appelé (\$ US)	Engagement d'investissement total (\$ US)
Northleaf Private Credit II LP ¹⁾	1 817	2 249	1 817	2 249
Sagard Credit Partners II LP ²⁾	757	2 249	796	2 249

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

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