

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## RAPPORT DE LA DIRECTION

### Responsabilité de la direction en matière d'information financière

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

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

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

Au nom de Corporation Financière Mackenzie,  
gestionnaire du Fonds

Le président et chef de la direction,

Le chef des finances, Fonds,



Luke Gould



Terry Rountes

Le 4 juin 2024

## RAPPORT DE L'AUDITEUR INDÉPENDANT

Aux porteurs de titres du Fonds de revenu stratégique mondial Mackenzie (le « Fonds »),

### Opinion

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

- les états de la situation financière au 31 mars 2024 et au 31 mars 2023;
- les états du résultat global pour les périodes closes à ces dates, comme il est indiqué à la note 1;
- les états de l'évolution de la situation financière pour les périodes closes à ces dates, comme il est indiqué à la note 1;
- les tableaux des flux de trésorerie pour les périodes closes à ces dates, comme il est indiqué à la note 1;
- ainsi que les notes annexes, y compris le résumé des méthodes comptables significatives; (ci-après, les « états financiers »).

À notre avis, les états financiers ci-joints donnent, dans tous leurs aspects significatifs, une image fidèle de la situation financière du Fonds au 31 mars 2024 et au 31 mars 2023, ainsi que de sa performance financière et de ses flux de trésorerie pour les périodes closes à ces dates, comme il est indiqué à la note 1, conformément aux normes IFRS de comptabilité.

### Fondement de l'opinion

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

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

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



**MACKENZIE**  
Placements

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## RAPPORT DE L'AUDITEUR INDÉPENDANT (suite)

### Autres informations

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

– des informations contenues dans le rapport annuel de la direction sur le rendement du fonds déposé auprès des commissions des valeurs mobilières canadiennes compétentes.

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

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

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

Nous n'avons rien à signaler à cet égard.

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

La direction est responsable de la préparation et de la présentation fidèle des états financiers conformément aux normes IFRS de comptabilité, ainsi que du contrôle interne qu'elle considère comme nécessaire pour permettre la préparation d'états financiers exempts d'anomalies significatives, que celles-ci résultent de fraudes ou d'erreurs.

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

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

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

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

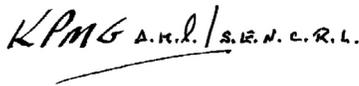
L'assurance raisonnable correspond à un niveau élevé d'assurance, qui ne garantit toutefois pas qu'un audit réalisé conformément aux normes d'audit généralement reconnues du Canada permettra toujours de détecter toute anomalie significative qui pourrait exister.

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

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

En outre :

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

  
KPMG A.R.L. / S.E.N.C.R.L.

Comptables professionnels agréés, experts-comptables autorisés  
Toronto, Canada  
Le 4 juin 2024

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

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

	2024 \$	2023 \$	Actif net attribuable aux porteurs de titres (note 3)						
			par titre		par série				
			2024	2023	2024	2023			
<b>ACTIF</b>									
<b>Actifs courants</b>									
Placements à la juste valeur	2 103 763	1 884 531	Série A	13,64	13,15	433 591	460 461		
Trésorerie et équivalents de trésorerie	22 151	95 659	Série AR	14,29	13,21	78 991	71 327		
Intérêts courus à recevoir	8 195	5 672	Série B	23,45	21,68	4 317	4 707		
Dividendes à recevoir	1 847	1 284	Série D	15,04	14,35	5 867	4 343		
Sommes à recevoir pour placements vendus	440	1 583	Série F	13,70	13,05	453 351	415 435		
Sommes à recevoir pour titres émis	979	581	Série F8	12,37	12,15	5 440	5 315		
Sommes à recevoir du gestionnaire	23	4	Série FB	10,51	10,04	1 999	2 080		
Marge sur instruments dérivés	3 341	23 200	Série G	12,73	11,77	13	14		
Actifs dérivés	2 610	3 964	Série GF	15,83	–	27 212	–		
<b>Total de l'actif</b>	<b>2 143 349</b>	<b>2 016 478</b>	Série GF8	15,43	–	1 131	–		
			Série GLF	15,82	–	4 962	–		
			Série GO	15,93	–	28	–		
<b>PASSIF</b>			Série GPW	15,70	–	32 152	–		
<b>Passifs courants</b>			Série GPWFB	15,83	–	3 598	–		
Sommes à payer pour placements achetés	2 065	4 804	Série GPWT8	15,30	–	145	–		
Sommes à payer pour titres rachetés	2 413	1 871	Série GPWX	15,93	–	2 446	–		
Distributions à verser	–	1	Série GPWX8	15,52	–	3	–		
Sommes à payer au gestionnaire	498	313	Série GW	15,70	–	685	–		
Obligation pour options vendues	–	204	Série I	15,32	14,16	99	92		
Passifs dérivés	3 634	14 501	Série OJ	12,77	11,80	91	92		
<b>Total du passif</b>	<b>8 610</b>	<b>21 694</b>	Série O	15,48	14,63	52 522	48 455		
<b>Actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>2 134 739</b>	<b>1 994 784</b>	Série O5	15,43	14,59	73	3		
			Série PW	11,65	11,20	849 470	809 851		
			Série PWFB	9,87	9,40	21 413	21 798		
			Série PWR	11,66	10,78	36 197	26 500		
			Série PWT5	13,57	13,05	59 965	59 395		
			Série PWT8	10,72	10,63	5 948	6 458		
			Série PWX	16,43	15,53	9 389	10 232		
			Série PWX8	11,91	11,60	297	482		
			Série R	10,86	–	1	–		
			Série S	12,07	11,17	2	1		
			Série T5	11,50	11,09	42 244	46 669		
			Série T8	12,40	12,33	1 094	1 074		
			Série LB	15,69	–	1	–		
			Série LF	15,85	–	1	–		
			Série LW	15,68	–	1	–		
						<b>2 134 739</b>	<b>1 994 784</b>		

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

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

	2024 \$	2023 \$	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	2024	2023
<b>Revenus</b>						
Dividendes	29 097	29 337				
Revenus d'intérêts aux fins de distribution	43 445	41 149				
Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets						
Profit (perte) net(te) réalisé(e)	26 081	(33 525)				
Profit (perte) net(te) latent(e)	135 838	(21 394)				
Revenu tiré du prêt de titres	257	128				
Revenu provenant des rabais sur les frais	163	163				
<b>Total des revenus (pertes)</b>	<b>234 881</b>	<b>15 858</b>				
<b>Charges (note 6)</b>						
Frais de gestion	32 722	32 074				
Rabais sur les frais de gestion	(31)	(29)				
Frais d'administration	3 867	3 792				
Intérêts débiteurs	20	40				
Commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille	742	744				
Frais du comité d'examen indépendant	8	7				
Autre	20	3				
<b>Charges avant les montants absorbés par le gestionnaire</b>	<b>37 348</b>	<b>36 631</b>				
Charges absorbées par le gestionnaire	–	–				
<b>Charges nettes</b>	<b>37 348</b>	<b>36 631</b>				
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, avant impôt</b>	<b>197 533</b>	<b>(20 773)</b>				
Impôt étranger retenu à la source	3 314	3 427				
Charge d'impôt étranger sur le résultat (recouvrée)	(16)	(118)				
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation</b>	<b>194 235</b>	<b>(24 082)</b>				
Série A	1,14	(0,26)	38 211	(9 640)		
Série AR	1,22	(0,15)	6 694	(801)		
Série B	1,91	(0,41)	381	(95)		
Série D	1,57	0,02	557	5		
Série F	1,36	(0,03)	44 062	(803)		
Série F8	1,22	(0,05)	527	(23)		
Série FB	1,02	(0,03)	197	(7)		
Série G	1,08	(0,10)	1	–		
Série GF	1,44	–	2 620	–		
Série GF8	1,46	–	107	–		
Série GLF	1,51	–	463	–		
Série GO	1,42	–	4	–		
Série GPW	1,25	–	2 867	–		
Série GPWFB	1,34	–	342	–		
Série GPWT8	1,17	–	12	–		
Série GPWX	1,52	–	253	–		
Série GPWX8	1,60	–	1	–		
Série GW	1,22	–	75	–		
Série I	1,39	(0,10)	9	(1)		
Série OJ	1,09	(0,16)	9	(2)		
Série O	1,67	0,13	5 587	414		
Série O5	2,37	0,15	7	–		
Série PW	1,03	(0,15)	74 468	(10 514)		
Série PWFB	0,94	0,03	2 119	74		
Série PWR	1,08	(0,01)	2 942	(25)		
Série PWT5	1,19	(0,14)	5 239	(610)		
Série PWT8	0,93	(0,16)	528	(98)		
Série PWX	1,71	(0,77)	1 076	(733)		
Série PWX8	1,15	(0,03)	44	(2)		
Série R	4,13	–	1 018	–		
Série S	1,29	0,11	1	–		
Série T5	0,95	(0,26)	3 719	(1 201)		
Série T8	1,14	(0,26)	94	(20)		
Série LB	1,35	–	–	–		
Série LF	1,53	–	–	–		
Série LW	1,74	–	1	–		
			<b>194 235</b>	<b>(24 082)</b>		

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE LA SITUATION FINANCIÈRE

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

	Total		Série A		Série AR		Série B		Série D	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	<b>1 994 784</b>	<b>2 133 614</b>	<b>460 461</b>	<b>536 000</b>	<b>71 327</b>	<b>68 722</b>	<b>4 707</b>	<b>5 490</b>	<b>4 343</b>	<b>2 732</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	194 235	(24 082)	38 211	(9 640)	6 694	(801)	381	(95)	557	5
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(30 792)	(31 091)	(4 254)	(5 416)	(670)	(788)	(46)	(63)	(112)	(87)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(72 368)	(77 193)	(18 430)	(21 441)	–	–	–	–	(162)	(151)
Rabais sur les frais de gestion	(31)	(29)	(1)	(1)	–	–	(2)	(1)	–	–
<b>Total des distributions aux porteurs de titres</b>	<b>(103 191)</b>	<b>(108 313)</b>	<b>(22 685)</b>	<b>(26 858)</b>	<b>(670)</b>	<b>(788)</b>	<b>(48)</b>	<b>(64)</b>	<b>(274)</b>	<b>(238)</b>
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	399 568	309 791	73 716	76 677	12 656	12 378	7	7	2 529	2 368
Titres émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	92 800	96 467	21 895	25 875	670	788	43	58	247	213
Paiements au rachat de titres	(443 457)	(412 693)	(138 007)	(141 593)	(11 686)	(8 972)	(773)	(689)	(1 535)	(737)
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>48 911</b>	<b>(6 435)</b>	<b>(42 396)</b>	<b>(39 041)</b>	<b>1 640</b>	<b>4 194</b>	<b>(723)</b>	<b>(624)</b>	<b>1 241</b>	<b>1 844</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>139 955</b>	<b>(138 830)</b>	<b>(26 870)</b>	<b>(75 539)</b>	<b>7 664</b>	<b>2 605</b>	<b>(390)</b>	<b>(783)</b>	<b>1 524</b>	<b>1 611</b>
<b>À la clôture</b>	<b>2 134 739</b>	<b>1 994 784</b>	<b>433 591</b>	<b>460 461</b>	<b>78 991</b>	<b>71 327</b>	<b>4 317</b>	<b>4 707</b>	<b>5 867</b>	<b>4 343</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>			<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>
Titres en circulation, à l'ouverture			35 021	37 992	5 401	5 071	217	247	303	179
Émis			5 639	5 880	941	967	–	–	177	162
Émis et rachetés à la fusion (note 10)			–	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions			1 684	2 005	51	62	2	3	17	15
Rachetés			(10 555)	(10 856)	(866)	(699)	(35)	(33)	(107)	(53)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>			<b>31 789</b>	<b>35 021</b>	<b>5 527</b>	<b>5 401</b>	<b>184</b>	<b>217</b>	<b>390</b>	<b>303</b>

	Série F		Série F8		Série FB		Série G		Série GF	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	<b>415 435</b>	<b>431 789</b>	<b>5 315</b>	<b>5 262</b>	<b>2 080</b>	<b>1 935</b>	<b>14</b>	<b>14</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	44 062	(803)	527	(23)	197	(7)	1	–	2 620	–
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(10 077)	(9 566)	(124)	(117)	(41)	(40)	–	–	(487)	–
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(12 649)	(13 817)	(310)	(339)	(62)	(69)	–	–	(723)	–
Rabais sur les frais de gestion	(3)	(3)	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>Total des distributions aux porteurs de titres</b>	<b>(22 729)</b>	<b>(23 386)</b>	<b>(434)</b>	<b>(456)</b>	<b>(103)</b>	<b>(109)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(1 210)</b>	<b>–</b>
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	82 602	69 372	586	1 235	702	1 339	–	–	–	–
Titres émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	–	–	–	–	–	–	–	29 198	–
Réinvestissement des distributions	17 529	17 584	53	45	102	109	–	–	1 153	–
Paiements au rachat de titres	(83 548)	(79 121)	(607)	(748)	(979)	(1 187)	(2)	–	(4 549)	–
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>16 583</b>	<b>7 835</b>	<b>32</b>	<b>532</b>	<b>(175)</b>	<b>261</b>	<b>(2)</b>	<b>–</b>	<b>25 802</b>	<b>–</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>37 916</b>	<b>(16 354)</b>	<b>125</b>	<b>53</b>	<b>(81)</b>	<b>145</b>	<b>(1)</b>	<b>–</b>	<b>27 212</b>	<b>–</b>
<b>À la clôture</b>	<b>453 351</b>	<b>415 435</b>	<b>5 440</b>	<b>5 315</b>	<b>1 999</b>	<b>2 080</b>	<b>13</b>	<b>14</b>	<b>27 212</b>	<b>–</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>			<b>Titres</b>	<b>Titres</b>						
Titres en circulation, à l'ouverture			31 838	31 237	437	395	1	1	–	–
Émis			6 319	5 394	50	100	–	–	–	–
Émis et rachetés à la fusion (note 10)			–	–	–	–	–	–	1 947	–
Réinvestissement des distributions			1 349	1 381	4	4	–	–	77	–
Rachetés			(6 405)	(6 174)	(51)	(62)	–	–	(305)	–
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>			<b>33 101</b>	<b>31 838</b>	<b>440</b>	<b>437</b>	<b>1</b>	<b>1</b>	<b>1 719</b>	<b>–</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

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

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

	Série GF8		Série GLF		Série GO		Série GPW		Série GPWFB	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	107	-	463	-	4	-	2 867	-	342	-
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(19)	-	(81)	-	(1)	-	(304)	-	(69)	-
Gains en capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	(57)	-	(123)	-	(1)	-	(1 185)	-	(100)	-
Rabais sur les frais de gestion	-	-	-	-	-	-	(2)	-	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de titres</b>	<b>(76)</b>	<b>-</b>	<b>(204)</b>	<b>-</b>	<b>(2)</b>	<b>-</b>	<b>(1 491)</b>	<b>-</b>	<b>(169)</b>	<b>-</b>
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	-	-	-	-	-	-	9	-	-	-
Titres émis et rachetés à la fusion (note 10)	1 106	-	4 503	-	63	-	38 384	-	4 796	-
Réinvestissement des distributions	11	-	204	-	2	-	1 468	-	169	-
Paiements au rachat de titres	(17)	-	(4)	-	(39)	-	(9 085)	-	(1 540)	-
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>1 100</b>	<b>-</b>	<b>4 703</b>	<b>-</b>	<b>26</b>	<b>-</b>	<b>30 776</b>	<b>-</b>	<b>3 425</b>	<b>-</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>1 131</b>	<b>-</b>	<b>4 962</b>	<b>-</b>	<b>28</b>	<b>-</b>	<b>32 152</b>	<b>-</b>	<b>3 598</b>	<b>-</b>
<b>À la clôture</b>	<b>1 131</b>	<b>-</b>	<b>4 962</b>	<b>-</b>	<b>28</b>	<b>-</b>	<b>32 152</b>	<b>-</b>	<b>3 598</b>	<b>-</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>	<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>	
Titres en circulation, à l'ouverture	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Émis	-	-	-	-	1	-	1	-	-	-
Émis et rachetés à la fusion (note 10)	74	-	300	-	4	-	2 559	-	320	-
Réinvestissement des distributions	1	-	14	-	-	-	98	-	11	-
Rachetés	(2)	-	-	-	(3)	-	(611)	-	(104)	-
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>73</b>	<b>-</b>	<b>314</b>	<b>-</b>	<b>2</b>	<b>-</b>	<b>2 047</b>	<b>-</b>	<b>227</b>	<b>-</b>

	Série GPWT8		Série GPWX		Série GPWX8		Série GW		Série I	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	-	-	-	-	-	-	-	-	92	93
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	12	-	253	-	1	-	75	-	9	(1)
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(1)	-	(63)	-	-	-	(8)	-	(2)	(2)
Gains en capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	(9)	-	(50)	-	-	-	(32)	-	-	-
Rabais sur les frais de gestion	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de titres</b>	<b>(10)</b>	<b>-</b>	<b>(113)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(40)</b>	<b>-</b>	<b>(2)</b>	<b>(2)</b>
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Titres émis et rachetés à la fusion (note 10)	166	-	2 712	-	2	-	1 138	-	-	-
Réinvestissement des distributions	10	-	113	-	-	-	40	-	2	2
Paiements au rachat de titres	(33)	-	(519)	-	-	-	(528)	-	(2)	-
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>143</b>	<b>-</b>	<b>2 306</b>	<b>-</b>	<b>2</b>	<b>-</b>	<b>650</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>2</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>145</b>	<b>-</b>	<b>2 446</b>	<b>-</b>	<b>3</b>	<b>-</b>	<b>685</b>	<b>-</b>	<b>7</b>	<b>(1)</b>
<b>À la clôture</b>	<b>145</b>	<b>-</b>	<b>2 446</b>	<b>-</b>	<b>3</b>	<b>-</b>	<b>685</b>	<b>-</b>	<b>99</b>	<b>92</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>	<b>Titres</b>									
Titres en circulation, à l'ouverture	-	-	-	-	-	-	-	-	6	6
Émis	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Émis et rachetés à la fusion (note 10)	11	-	181	-	-	-	76	-	-	-
Réinvestissement des distributions	1	-	8	-	-	-	3	-	-	-
Rachetés	(3)	-	(35)	-	-	-	(35)	-	-	-
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>9</b>	<b>-</b>	<b>154</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>44</b>	<b>-</b>	<b>6</b>	<b>6</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.



# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

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

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

	Série R		Série S		Série T5		Série T8	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>								
<b>À l'ouverture</b>	–	–	1	1	46 669	58 158	1 074	1 144
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	1 018	–	1	–	3 719	(1 201)	94	(20)
Distributions aux porteurs de titres :								
Revenu de placement	(251)	–	–	–	(410)	(568)	(9)	(10)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	–	–	(1 821)	(2 293)	(73)	(78)
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	(251)	–	–	–	(2 231)	(2 861)	(82)	(88)
Opérations sur les titres :								
Produit de l'émission de titres	87 213	–	–	–	6 216	6 396	243	736
Titres émis et rachetés à la fusion (note 10)	(82 068)	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	251	–	–	–	1 581	1 944	26	30
Paiements au rachat de titres	(6 162)	–	–	–	(13 710)	(15 767)	(261)	(728)
Total des opérations sur les titres	(766)	–	–	–	(5 913)	(7 427)	8	38
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>1</b>	<b>–</b>	<b>1</b>	<b>–</b>	<b>(4 425)</b>	<b>(11 489)</b>	<b>20</b>	<b>(70)</b>
<b>À la clôture</b>	<b>1</b>	<b>–</b>	<b>2</b>	<b>1</b>	<b>42 244</b>	<b>46 669</b>	<b>1 094</b>	<b>1 074</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>	<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>	
Titres en circulation, à l'ouverture	–	–	–	–	4 208	4 886	87	83
Émis	8 777	–	–	–	565	581	20	61
Émis et rachetés à la fusion (note 10)	(8 187)	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	25	–	–	–	144	179	2	2
Rachetés	(615)	–	–	–	(1 244)	(1 438)	(21)	(59)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>3 673</b>	<b>4 208</b>	<b>88</b>	<b>87</b>

	Série LB		Série LF		Série LW	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>						
<b>À l'ouverture</b>	–	–	–	–	–	–
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	–	–	–	–	1	–
Distributions aux porteurs de titres :						
Revenu de placement	–	–	–	–	–	–
Gains en capital	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	–	–	–	–
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	–	–	–	–	–	–
Opérations sur les titres :						
Produit de l'émission de titres	1	–	1	–	8	–
Titres émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	–	–	–	–	–	–
Paiements au rachat de titres	–	–	–	–	(8)	–
Total des opérations sur les titres	1	–	1	–	–	–
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>1</b>	<b>–</b>	<b>1</b>	<b>–</b>	<b>1</b>	<b>–</b>
<b>À la clôture</b>	<b>1</b>	<b>–</b>	<b>1</b>	<b>–</b>	<b>1</b>	<b>–</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>	<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>	
Titres en circulation, à l'ouverture	–	–	–	–	–	–
Émis	–	–	–	–	1	–
Émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	–	–	–	–	–	–
Rachetés	–	–	–	–	(1)	–
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

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

	2024	2023
	\$	\$
<b>Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation	194 235	(24 082)
Ajustements pour :		
Perte (profit) net(te) réalisé(e) sur les placements	(30 476)	37 884
Variation de la perte (du profit) net(te) latent(e) sur les placements	(135 753)	22 296
Distributions en nature reçues de fonds sous-jacents	(25)	(86)
Achat de placements	(1 043 536)	(765 478)
Produit de la vente et de l'échéance de placements	979 091	831 211
(Augmentation) diminution des sommes à recevoir et autres actifs	16 754	(23 386)
Augmentation (diminution) des sommes à payer et autres passifs	185	(132)
<b>Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités d'exploitation</b>	<b>(19 525)</b>	<b>78 227</b>
<b>Flux de trésorerie liés aux activités de financement</b>		
Produit de l'émission de titres	329 376	233 590
Paiements au rachat de titres	(373 122)	(335 251)
Distributions versées, déduction faite des réinvestissements	(10 392)	(11 846)
<b>Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités de financement</b>	<b>(54 138)</b>	<b>(113 507)</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>	<b>(73 663)</b>	<b>(35 280)</b>
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à l'ouverture	95 659	131 141
Incidence des fluctuations des taux de change sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie	155	(202)
<b>Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture</b>	<b>22 151</b>	<b>95 659</b>
Trésorerie	22 151	25 570
Équivalents de trésorerie	–	70 089
<b>Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture</b>	<b>22 151</b>	<b>95 659</b>
<b>Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :</b>		
Dividendes reçus	28 534	29 434
Impôts étrangers payés	3 298	3 309
Intérêts reçus	40 922	40 852
Intérêts versés	20	40

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS

au 31 mars 2024

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N <sup>bre</sup> d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS</b>					
407 International Inc. 1,80 % 22-05-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 036 000	1 045	1 002
407 International Inc. 4,22 % 14-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	790 000	790	782
407 International Inc. 3,14 % 06-03-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	300 000	303	284
407 International Inc. 3,43 % 01-06-2033, série MTN	Canada	Sociétés – Non convertibles	256 000	278	236
407 International Inc. 4,19 % 25-04-2042, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	154 000	172	143
407 International Inc. 3,60 % 21-05-2047, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 147 000	1 046	964
407 International Inc. 4,86 % 31-07-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	313 000	313	319
AbbVie Inc. 4,95 % 15-03-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	690 000 USD	929	943
AerCap Ireland Capital DAC 3,00 % 29-10-2028	Irlande	Sociétés – Non convertibles	450 000 USD	518	552
Aéroports de Montréal 3,92 % 12-06-2045, rachetables 2044	Canada	Sociétés – Non convertibles	54 000	50	48
AIMCo Realty Investors LP 2,20 % 04-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	630 000	630	593
AIMCo Realty Investors LP 2,71 % 01-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000	90	91
Air Lease Corp. 5,40 % 01-06-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	4 148 000	4 146	4 226
Algonquin Power & Utilities Corp. 4,60 % 29-01-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	350 000	343	344
Algonquin Power & Utilities Corp. 2,85 % 15-07-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 198 000	3 594	3 652
Algonquin Power & Utilities Corp., taux variable 18-01-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	780 000	780	675
Alimentation Couche-Tard inc. 4,60 % 25-01-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	670 000	670	671
Alimentation Couche-Tard inc. 2,95 % 25-01-2030, rachetables 2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	55 000 USD	72	67
Alimentation Couche-Tard inc. 5,59 % 25-09-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 610 000	1 610	1 691
AltaGas Ltd. 4,64 % 15-05-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	147 000	147	146
AltaGas Ltd. 2,17 % 16-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	410 000	410	381
AltaGas Ltd., taux variable 11-01-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	490 000	490	423
AltaGas Ltd., taux variable 17-08-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	119 000	119	121
Altice International SARL 5,00 % 15-01-2028 144A	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	227	223
Amaggi Luxembourg International SARL 5,25 % 28-01-2028	Bésil	Sociétés – Non convertibles	830 000 USD	1 048	1 070
América Móvil SAB de CV 9,50 % 27-01-2031	Mexique	Sociétés – Non convertibles	99 110 000 MXN	7 629	7 800
American Tower Corp. 1,88 % 15-10-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	500 000 USD	666	550
Anglian Water Services Financing PLC 4,53 % 26-08-2032	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	550 000	550	529
ARD Finance SA 6,50 % 30-06-2027 144A	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	133	45
Ardagh Packaging Finance PLC 5,25 % 15-08-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	144 000 USD	164	122
Ascend Wellness Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 27-08-2025	États-Unis	Prêts à terme	390 000 USD	490	502
Athene Global Funding, taux variable 09-04-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 540 000	1 540	1 549
Athene Global Funding 3,13 % 10-03-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	590 000	590	578
Athene Global Funding 2,10 % 24-09-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	840 000	839	802
Athene Global Funding 5,11 % 07-03-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	630 000	630	633
Avolon Holdings Funding Ltd. 5,75 % 01-03-2029 144A	Irlande	Sociétés – Non convertibles	1 160 000 USD	1 552	1 566
Bank of America Corp., taux variable 15-09-2027 (taux variable différé)	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	259 000	247	242
Bank of America Corp., taux variable 16-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	6 499 000	6 201	6 285
Bank of America Corp., taux variable 04-04-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	611 000	611	564
Banque de Montréal 2,70 % 11-09-2024, série DPNT	Canada	Sociétés – Non convertibles	160 000	164	158
Banque de Montréal 4,71 % 07-12-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	48 000	49	48
Banque de Montréal, taux variable 27-10-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	41 000	42	43
Banque de Montréal, taux variable 07-09-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	19 000	19	20
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 327 000	2 328	2 348
La Banque de Nouvelle-Écosse 2,16 % 03-02-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	761 000	725	743
La Banque de Nouvelle-Écosse 5,50 % 08-05-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 470 000	1 458	1 491
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 27-07-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 543 000	1 528	1 541
BCE Inc. 2,20 % 29-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	870 000	869	795
BCE Inc. 3,00 % 17-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	766 000	679	688
BCE Inc. 5,85 % 10-11-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	460 000	469	490
BCI QuadReal Realty 2,55 % 24-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 340 000	1 340	1 283
bclMC Realty Corp. 1,07 % 04-02-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	558 000	558	523
Becla SAB de CV 2,50 % 14-10-2031	Mexique	Sociétés – Non convertibles	2 370 000 USD	2 970	2 561
Bell Canada 5,25 % 15-03-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	980 000	979	1 006
Bimbo Bakeries USA Inc. 6,05 % 15-01-2029	Mexique	Sociétés – Non convertibles	680 000 USD	939	954
BP Capital Markets PLC 3,47 % 15-05-2025	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	110 000	114	108
Broadcast Media Partners Holdings Inc. 4,50 % 01-05-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	170 000 USD	206	207
Broadcom Inc. 4,11 % 15-09-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	910 000 USD	1 160	1 192
Brookfield Infrastructure Finance ULC 4,20 % 11-09-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	522 000	518	510
Brookfield Infrastructure Finance ULC 2,86 % 01-09-2032, rachetables 2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	133 000	133	113

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2024

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Brookfield Renewable Energy Partners ULC 3,63 % 15-01-2027, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 199 000	2 235	2 135
Brookfield Renewable Partners ULC 4,25 % 15-01-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	676 000	676	662
Brookfield Residential Properties Inc. 5,13 % 15-06-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	134 000	134	120
Bruce Power L.P. 2,68 % 21-12-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	355 000	355	327
Bruce Power L.P. 4,00 % 21-06-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	677 000	664	653
Bruce Power L.P. 4,70 % 21-06-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	680 000	679	679
Obligation fédérale 2,10 % 12-04-2029	Allemagne	Gouvernements étrangers	12 709 000 EUR	18 405	18 378
CAE Inc. 5,54 % 12-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	540 000	540	551
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 3,00 % 25-05-2028	France	Gouvernements étrangers	3 300 000 EUR	4 851	4 843
Canadian Core Real Estate LP 3,30 % 02-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	670 000	670	627
Obligation du gouvernement du Canada 3,50 % 01-03-2034	Canada	Gouvernement fédéral	4 508 000	4 491	4 527
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 21-04-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 232 000	1 232	1 158
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 28-07-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	54 000	54	54
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada 4,40 % 10-05-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	600 000	599	595
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 2,54 % 28-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 905 000	1 842	1 781
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 3,15 % 13-03-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 830 000	3 008	2 675
Cannabist Co. Holdings Inc. 6,00 % 29-06-2025	Canada	Sociétés – Convertibles	170 000 USD	209	196
Cannabist Co. Holdings Inc. 9,50 % 03-02-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000 USD	151	138
CAP SA 3,90 % 27-04-2031	Chili	Sociétés – Non convertibles	800 000 USD	1 000	852
Capital Power Corp. 4,28 % 18-09-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 052 000	2 099	2 041
Capital Power Corp. 4,99 % 23-01-2026, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	700 000	700	697
Capital Power Corp. 5,97 % 25-01-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	331 000	331	342
Capital Power Corp., taux variable 09-09-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	311 000	311	312
CCO Holdings LLC 4,25 % 01-02-2031, rachetables 2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	4 806 000 USD	5 439	5 313
Celulosa Arauco y Constitución SA 4,20 % 29-01-2030, rachetables 2029	Chili	Sociétés – Non convertibles	2 100 000 USD	2 758	2 598
Cemex SAB de CV, taux variable 08-09-2169	Mexique	Sociétés – Non convertibles	600 000 USD	726	785
Cenovus Energy Inc. 3,50 % 07-02-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 330 000	1 326	1 277
Cenovus Energy Inc. 3,75 % 15-02-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 228 000 USD	2 241	2 217
Centrais Elétricas Brasileiras SA 3,63 % 04-02-2025	Brésil	Sociétés – Non convertibles	530 000 USD	699	704
Charter Communications Operating LLC 2,80 % 01-04-2031, rachetables 2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	520 000 USD	727	577
Charter Communications Operating LLC 2,30 % 01-02-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	630 000 USD	821	659
Chesapeake Energy Corp. 6,75 % 15-04-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	851 000 USD	1 169	1 168
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 2,46 % 30-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	350 000	350	330
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 5,40 % 01-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 260 000	1 260	1 279
CIFI Holdings (Group) Co. Ltd. 6,00 % 16-07-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	1 066 000 USD	344	122
Citadel Securities LP, prêt à terme de premier rang, taux variable 29-07-2030	États-Unis	Prêts à terme	1 990 223 USD	2 686	2 696
Clearway Energy LLC 3,75 % 15-01-2032 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 022 000 USD	1 093	1 166
Clydesdale Acquisition Holdings Inc. 8,75 % 15-04-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	288 000 USD	368	384
Cogeco Communications inc. 2,99 % 22-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	530 000	530	461
Coinbase Global Inc. 3,63 % 01-10-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	4 387 000 USD	4 621	4 838
Colbún SA 3,15 % 19-01-2032	Chili	Sociétés – Non convertibles	660 000 USD	815	755
Cologix Data Centers Issuer LLC 4,94 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	200 000	200	186
Cologix Data Centers Issuer LLC 5,68 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	160 000	160	147
CommScope Inc. 4,75 % 01-09-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	125	99
CommScope Technologies Finance LLC 8,25 % 01-03-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	316 000 USD	417	201
Constellation Software Inc. 5,16 % 16-02-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	572 000 USD	770	775
Continental Resources Inc. 5,75 % 15-01-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 468 000 USD	4 406	4 687
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	481 298	481	453
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-09-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	482 342	482	452
Corp. Nacional del Cobre de Chile 4,50 % 16-09-2025	Chili	Sociétés – Non convertibles	1 972 000 USD	2 632	2 630
Corus Entertainment Inc. 5,00 % 11-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	207 000	207	151
Country Garden Holdings Co. Ltd. 2,70 % 12-07-2026	Chine	Sociétés – Non convertibles	1 625 000 USD	1 382	152
Country Garden Holdings 5,63 % 14-01-2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	2 349 000 USD	1 948	220
CPIB Capital Inc. 3,95 % 02-06-2032	Canada	Gouvernement fédéral	1 902 000	1 893	1 887
Credicorp Ltd. 2,75 % 17-06-2025, rachetables 2025	Pérou	Sociétés – Non convertibles	300 000 USD	399	392

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2024

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N <sup>bre</sup> d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Fonds de placement immobilier Crombie 3,92 % 21-06-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	116 000	116	112
Fonds de placement immobilier Crombie 3,21 % 09-10-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 280 000	2 342	2 024
Fonds de placement immobilier Crombie 3,13 % 12-08-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	216 000	216	187
Curaleaf Holdings Inc. 8,00 % 15-12-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	680 000 USD	872	840
DIRECTV Holdings LLC 5,88 % 15-08-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	128 000 USD	161	164
Dollarama inc. 5,53 % 26-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	770 000	770	800
Domtar Corp. 6,75 % 01-10-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	369 000 USD	466	455
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 1,66 % 22-12-2025 (A)	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 080 000	3 079	2 914
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,54 % 07-12-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	480 000	480	450
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,06 % 17-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	520 000	520	475
Ecopetrol SA 4,63 % 02-11-2031	Colombie	Sociétés – Non convertibles	1 696 000 USD	1 746	1 912
Electronic Arts Inc. 2,95 % 15-02-2051	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 228 000 USD	2 100	2 021
L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie 3,63 % 17-04-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000	50	40
Empresas CMPC SA 3,00 % 06-04-2031	Chili	Sociétés – Non convertibles	985 000 USD	1 229	1 139
Enbridge Gas Inc. 5,70 % 06-10-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	500 000	500	540
Enbridge Inc. 4,90 % 26-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	430 000	430	434
Enbridge Inc. 3,10 % 21-09-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 130 000	1 128	969
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	12 100 000	11 577	11 581
Enbridge Inc., taux variable 12-04-2078, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 870 000	3 864	3 867
Enel Finance International NV 5,00 % 15-06-2032 144A	Italie	Sociétés – Non convertibles	520 000 USD	634	684
Enel SPA 2,25 % 12-07-2031 144A	Italie	Sociétés – Non convertibles	270 000 USD	290	296
EPCOR Utilities Inc. 3,55 % 27-11-2047, rachetables 2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	750 000	750	626
EPCOR Utilities Inc. 3,11 % 08-07-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	950 000	950	728
EPCOR Utilities Inc. 4,73 % 02-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	700 000	700	703
Exxon Mobil Corp. 3,10 % 16-08-2049	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	4 455 000 USD	4 552	4 308
Fair Isaac Corp. 4,00 % 15-06-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 022 000 USD	1 278	1 295
Fairfax Financial Holdings Ltd. 8,30 % 15-04-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 070 000 USD	1 617	1 525
Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,23 % 14-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	370 000	370	358
Fairfax Financial Holdings Ltd. 3,95 % 03-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	752 000	754	702
Fairfax India Holdings Corp. 5,00 % 26-02-2028 144A	Inde	Sociétés – Non convertibles	1 360 000 USD	1 702	1 630
Fonds de placement immobilier First Capital 3,45 % 01-03-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	440 000	389	412
First Capital Realty Inc. 5,57 % 01-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	644 000	651	652
First West Credit Union 9,19 % 09-08-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	550 000	550	586
Flynn America LP, prêt à terme B de premier rang, taux variable 23-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	500 188 USD	610	666
Compagnie Crédit Ford du Canada 2,96 % 16-09-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	350 000	350	332
Compagnie Crédit Ford du Canada 5,58 % 22-02-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	510 000	510	513
Fortis Inc. 4,43 % 31-05-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 165 000	1 166	1 163
Frontera Generation Holdings LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 28-07-2026	États-Unis	Prêts à terme	24 442 USD	31	8
Frontera Generation Holdings LLC, prêt à terme de second rang, taux variable 26-04-2028	États-Unis	Prêts à terme	23 724 USD	17	1
Financière General Motors du Canada Ltée 5,20 % 09-02-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	420 000	420	425
Financière General Motors du Canada Ltée 5,00 % 09-02-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	630 000	629	633
GFL Environmental Inc. 5,13 % 15-12-2026 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	140 000 USD	185	186
GFL Environmental Inc. 3,50 % 01-09-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	52 000 USD	66	65
GFL Environmental Inc. 6,75 % 15-01-2031 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 304 000 USD	3 133	3 202
Gibson Energy Inc. 2,85 % 14-07-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	320 000	325	302
Gibson Energy Inc., taux variable 22-12-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	225 000	226	199
Glencore Funding LLC 5,70 % 08-05-2033 144A	Australie	Sociétés – Non convertibles	579 000 USD	799	798
GoDaddy Operating Co. LLC 3,50 % 01-03-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	15 000 USD	18	18
The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 28-02-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	567 000	567	512
Gouvernement des Bahamas 6,95 % 20-11-2029	Bahamas	Gouvernements étrangers	1 460 000 USD	2 152	1 764
Gouvernement des Bahamas 8,95 % 15-10-2032	Bahamas	Gouvernements étrangers	1 200 000 USD	1 581	1 575
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2027	Brésil	Gouvernements étrangers	4 100 000 BRL	10 379	11 032
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2029	Brésil	Gouvernements étrangers	5 000 000 BRL	14 599	13 210
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2031	Brésil	Gouvernements étrangers	4 400 000 BRL	11 747	11 435
Gouvernement du Brésil 6,25 % 18-03-2031	Brésil	Gouvernements étrangers	6 900 000 USD	9 385	9 542
Gouvernement du Canada 3,75 % 01-02-2025	Canada	Gouvernement fédéral	100 000	99	99
Gouvernement du Canada 3,75 % 01-05-2025	Canada	Gouvernement fédéral	3 000	3	3
Gouvernement du Canada 1,25 % 01-03-2027	Canada	Gouvernement fédéral	1 204 000	1 108	1 121

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2024

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N <sup>bre</sup> d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Gouvernement du Canada 3,50 % 01-03-2028	Canada	Gouvernement fédéral	31 643 000	31 234	31 542
Gouvernement du Canada 2,00 % 01-12-2051	Canada	Gouvernement fédéral	300 000	237	227
Gouvernement du Canada 1,75 % 01-12-2053	Canada	Gouvernement fédéral	905 000	556	635
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-12-2055	Canada	Gouvernement fédéral	110 000	99	98
Gouvernement de l'Allemagne 0 % 15-08-2052	Allemagne	Gouvernements étrangers	23 760 000 EUR	23 615	17 692
Gouvernement du Mexique 8,50 % 31-05-2029	Mexique	Gouvernements étrangers	211 600 000 MXN	16 290	16 717
Gouvernement du Mexique 2,66 % 24-05-2031	Mexique	Gouvernements étrangers	8 800 000 USD	10 531	9 981
Gouvernement du Mexique 7,75 % 23-11-2034	Mexique	Gouvernements étrangers	310 520 000 MXN	22 535	22 733
Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 4,50 % 15-05-2030	Nouvelle-Zélande	Gouvernements étrangers	7 700 000 NZD	6 329	6 122
Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 3,50 % 14-04-2033	Nouvelle-Zélande	Gouvernements étrangers	43 718 000 NZD	32 886	32 671
Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 4,25 % 15-05-2034	Nouvelle-Zélande	Gouvernements étrangers	15 910 000 NZD	12 823	12 522
Gouvernement de l'Afrique du Sud 8,88 % 28-02-2035	Afrique du Sud	Gouvernements étrangers	256 000 000 ZAR	15 138	14 610
Gouvernement des Bahamas 9,00 % 16-06-2029	Bahamas	Gouvernements étrangers	1 500 000 USD	1 524	1 993
GPS Blue Financing DAC 5,65 % 09-11-2041	Irlande	Sociétés – Non convertibles	4 300 000 USD	6 063	5 596
Fiducie de placement immobilier Granite 3,06 % 04-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	330 000	308	313
Fiducie de placement immobilier Granite 2,19 % 30-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 093 000	2 788	2 762
Fiducie de placement immobilier Granite 2,38 % 18-12-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	760 000	627	645
Gray Escrow Inc. 7,00 % 15-05-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	80 000 USD	97	101
Gray Television Inc. 5,38 % 15-11-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	570 000 USD	706	507
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 1,54 % 03-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 950 000	2 602	2 665
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 6,47 % 02-02-2034, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	128 000	148	146
HCA Healthcare Inc. 3,50 % 01-09-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	228 000 USD	303	280
Heathrow Funding Ltd. 3,25 % 21-05-2025	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	346 000	364	338
Heathrow Funding Ltd. 2,69 % 13-10-2027	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	960 000	960	899
Heathrow Funding Ltd. 3,79 % 04-09-2030, rachetables 2030	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	990 000	990	925
Heathrow Funding Ltd. 3,73 % 13-04-2033	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	510 000	529	457
Hilton Worldwide Finance LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 09-11-2030	États-Unis	Prêts à terme	2 000 000 USD	2 715	2 717
Compagnie Home Trust 5,32 % 13-06-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	720 000	720	719
Honda Canada Finance Inc. 4,87 % 23-09-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 359 000	1 362	1 373
Honda Canada Finance Inc. 5,73 % 28-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	520 000	520	545
Hyundai Capital Canada Inc. 4,90 % 31-01-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	370 000	370	373
iA Société financière inc., taux variable 20-06-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	450 000	450	462
iA Société financière inc., taux variable 25-02-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 490 000	1 490	1 417
L'Ordre Indépendant des Forestiers, taux variable 15-10-2035, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	490 000	490	417
Indy US Bidco LLC, prêt à terme B3 de premier rang, taux variable 05-03-2028	États-Unis	Prêts à terme	250 571 USD	318	328
Intact Corporation financière 5,46 % 22-09-2032 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	470 000 USD	623	638
Intact Corporation financière, taux variable 31-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	180 000	180	166
Inter Pipeline Ltd. 2,73 % 18-04-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	922 000	942	921
Inter Pipeline Ltd. 3,48 % 16-12-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	670 000	656	644
Inter Pipeline Ltd. 4,23 % 01-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 884 000	1 934	1 839
Inter Pipeline Ltd. 5,76 % 17-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	450 000	450	460
Inter Pipeline Ltd. 5,71 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	470 000	470	479
Inter Pipeline Ltd. 3,98 % 25-11-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 580 000	3 580	3 233
Inter Pipeline Ltd., taux variable 26-03-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	380 000	380	368
Inter Pipeline Ltd., taux variable 19-11-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	660 000	660	628
Interconexión Eléctrica SA ESP 3,83 % 26-11-2033	Colombie	Sociétés – Non convertibles	3 650 000 USD	4 414	4 230
Banque internationale pour la reconstruction et le développement 1,75 % 31-01-2031	Supranationales	s.o.	4 600 000 USD	6 221	6 135
Société Financière Internationale 0 % 22-02-2038	Supranationales	s.o.	621 400 000 MXN	13 970	14 921
Ivanhoe Cambridge II Inc. 2,30 % 12-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	379 000	379	372
Jadex Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 12-02-2028	États-Unis	Prêts à terme	545 195 USD	705	701
Jazz Pharmaceuticals PLC 4,38 % 15-01-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 222 000 USD	1 504	1 543
JPMorgan Chase & Co. 1,90 % 05-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 580 000	1 580	1 462
Kaisa Group Holdings Ltd. 9,38 % 30-06-2024	Chine	Sociétés – Non convertibles	400 000 USD	359	17
Kaisa Group Holdings Ltd. 11,70 % 11-11-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	1 200 000 USD	1 447	44
Kaisa Group Holdings 8,65 % 06-04-2024	Chine	Sociétés – Non convertibles	900 000 USD	396	32
Kaisa Group Holdings 10,50 % 06-04-2024	Chine	Sociétés – Non convertibles	1 900 000 USD	1 132	64
Keyera Corp. 3,96 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 270 000	2 466	2 158
Keyera Corp., taux variable 13-06-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	440 000	441	432
Keyera Corp., taux variable 10-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	610 000	610	559

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2024

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Kleopatra Finco SARL 4,25 % 01-03-2026	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	100 000 EUR	121	125
Knight Health Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 17-12-2028	États-Unis	Prêts à terme	518 075 USD	619	319
KP Germany Erste GmbH, prêt à terme B de premier rang, taux variable 04-02-2026	Allemagne	Prêts à terme	320 000 EUR	489	412
Kronos Acquisition Holdings Inc. 5,00 % 31-12-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	30 000 USD	37	40
Produits Kruger S.E.C. 6,00 % 24-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000	200	196
Produits Kruger S.E.C. 5,38 % 09-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	110 000	110	102
LABL Escrow Issuer LLC 6,75 % 15-07-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	136 000 USD	182	182
LABL Escrow Issuer LLC 10,50 % 15-07-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	233 000 USD	310	313
LABL Inc. 8,25 % 01-11-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	246 000 USD	279	285
Lamb Weston Holdings Inc. 4,38 % 31-01-2032 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 022 000 USD	1 197	1 244
LGI Homes Inc. 8,75 % 15-12-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	35 000 USD	48	50
Liberty Utilities (Canada) LP 3,32 % 14-02-2050, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	360 000	360	266
LifeScan Global Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 31-12-2026	États-Unis	Prêts à terme	343 353 USD	436	291
Les Compagnies Loblaw Itée 4,49 % 11-12-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000	44	40
Les Compagnies Loblaw Itée 2,28 % 07-05-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	498 000	501	440
Les Compagnies Loblaw Itée 5,34 % 13-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	470 000	470	490
Logan Group Co. Ltd. 4,70 % 06-07-2026	Chine	Sociétés – Non convertibles	3 483 000 USD	2 636	478
LSF10 XL Bidco SCA, prêt à terme B de premier rang, taux variable 30-03-2028	Luxembourg	Prêts à terme	315 784 EUR	465	427
Luxembourg Investment Co. 428 SARL, prêt à terme B de premier rang, taux variable 22-10-2028	Luxembourg	Prêts à terme	392 899 USD	480	151
Magenta Buyer LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 03-05-2028	États-Unis	Prêts à terme	329 200 USD	402	267
Banque Manuvie du Canada 1,54 % 14-09-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 030 000	1 030	959
Société Financière Manuvie, taux variable 10-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 210 000	1 210	1 233
Société Financière Manuvie, taux variable 23-02-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	900 000	900	905
Société Financière Manuvie, taux variable 19-03-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	780 000	780	623
Société Financière Manuvie, taux variable 19-06-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	800 000	800	804
MARB BondCo PLC 3,95 % 29-01-2031	Brésil	Sociétés – Non convertibles	500 000 USD	515	559
Mattamy Group Corp. 4,63 % 01-03-2030, rachetables 2025 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	161 000 USD	180	199
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 7,88 % 15-08-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	366 000 USD	490	505
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 9,25 % 15-04-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	378 000 USD	513	508
Metro inc. 4,66 % 07-02-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	165 000	162	164
Mexico Remittances Funding Fiduciary Estate Management SARL 4,88 % 15-01-2028	Mexique	Sociétés – Non convertibles	1 544 000 USD	1 953	1 876
Micron Technology Inc. 5,38 % 15-04-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	910 000 USD	1 224	1 245
Minerva Merger Sub Inc. 6,50 % 15-02-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	470 000 USD	599	583
Mozart Debt Merger Sub Inc. 3,88 % 01-04-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	473 000 USD	599	583
Mozart Debt Merger Sub Inc. 5,25 % 01-10-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	700 000 USD	884	897
NAV CANADA 2,06 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	420 000	420	371
Nederlandse Waterschapsbank NV 1,00 % 28-05-2030	Pays-Bas	Gouvernements étrangers	1 200 000 USD	1 655	1 326
Nestlé Holdings Inc. 2,19 % 26-01-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	760 000	760	696
New Red Finance Inc. 4,00 % 15-10-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	130 000 USD	171	157
Nexstar Escrow Inc. 5,63 % 15-07-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	232 000 USD	308	302
NextEra Energy Capital Holdings Inc. 4,85 % 30-04-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 120 000	1 117	1 126
North West Redwater Partnership Co. Ltd. 2,80 % 01-06-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 460 000	1 457	1 299
North West Redwater Partnership 3,20 % 22-07-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	680 000	681	676
North West Redwater Partnership 3,70 % 23-02-2043, rachetables 2042	Canada	Sociétés – Non convertibles	52 000	51	44
Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc. 4,11 % 31-03-2042	Canada	Sociétés – Non convertibles	747 098	747	659
NVIDIA Corp. 3,50 % 01-04-2050, rachetables 2049	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 228 000 USD	2 457	2 408
OMERS Finance Trust 2,60 % 14-05-2029	Canada	Gouvernements provinciaux	852 000	851	797
Ontario Power Generation Inc. 2,89 % 08-04-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	420 000	403	411
Ontario Power Generation Inc. 1,17 % 22-04-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	280 000	249	261
Ontario Power Generation Inc. 2,98 % 13-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	696 000	731	651
Ontario Teachers' Finance Trust 1,10 % 19-10-2027	Canada	Gouvernements provinciaux	490 000	489	443
Régime de retraite des enseignantes et des enseignants de l'Ontario 4,45 % 02-06-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	720 000	718	734
Open Text Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 31-01-2030	Canada	Prêts à terme	1 889 223 USD	2 569	2 566
Corporation Parkland du Canada 3,88 % 16-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 860 000	1 860	1 788

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2024

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Corporation Parkland du Canada 4,38 % 26-03-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	140 000	140	130
Corporation Parkland du Canada 4,50 % 01-10-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	390 000 USD	491	489
Corporation Pétroles Parkland 5,88 % 15-07-2027 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	26 000 USD	34	35
Corporation Pétroles Parkland 6,00 % 23-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 080 000	1 075	1 079
PayPal Holdings Inc. 2,65 % 01-10-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	600 000 USD	794	768
PayPal Holdings Inc. 2,30 % 01-06-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	370 000 USD	518	433
Pembina Pipeline Corp. 4,02 % 27-03-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 470 000	2 590	2 411
Pembina Pipeline Corp. 5,21 % 12-01-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	740 000	739	742
Pembina Pipeline Corp. 4,81 % 25-03-2044	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000	32	27
Pembina Pipeline Corp. 5,67 % 12-01-2054	Canada	Sociétés – Non convertibles	610 000	610	617
Pembina Pipeline Corp., taux variable 25-01-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	810 000	810	701
Petróleos de Venezuela SA 6,00 % 16-05-2024	Venezuela	Sociétés – Non convertibles	480 000 USD	153	63
Petróleos Mexicanos 7,47 % 12-11-2026	Mexique	Sociétés – Non convertibles	68 570 000 MXN	4 743	4 925
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 4,65 % 19-05-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 571 000 USD	2 114	2 107
Pioneer Natural Resources Co. 2,15 % 15-01-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 228 000 USD	2 410	2 545
Prologis Inc. 4,70 % 01-03-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	870 000	868	872
Province de l'Alberta 2,05 % 01-06-2030	Canada	Gouvernements provinciaux	10 264 000	8 788	9 230
Province de l'Alberta 3,10 % 01-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	5 210 000	4 867	4 192
Province du Manitoba 3,80 % 05-09-2053	Canada	Gouvernements provinciaux	70 000	65	63
Province de l'Ontario 4,05 % 02-02-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	5 840 000	5 832	5 862
Province de l'Ontario 4,10 % 04-03-2033	Canada	Gouvernements provinciaux	2 838 000	2 828	2 841
Province de l'Ontario 3,65 % 02-06-2033	Canada	Gouvernements provinciaux	619 000	575	598
Province de l'Ontario 4,15 % 02-06-2034	Canada	Gouvernements provinciaux	170 000	170	170
Province de Québec 3,65 % 20-05-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	1 410 000	1 410	1 376
Province de Québec 4,40 % 01-12-2055	Canada	Gouvernements provinciaux	80 000	85	82
Province de la Saskatchewan 3,10 % 02-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	10 000	10	8
PSP Capital Inc. 2,60 % 01-03-2032	Canada	Gouvernement fédéral	1 320 000	1 316	1 191
PSP Capital Inc. 4,15 % 01-06-2033	Canada	Gouvernement fédéral	120 000	121	120
Quasar Intermediate Holdings Ltd., prêt à terme B de premier rang, taux variable 20-01-2029	États-Unis	Prêts à terme	394 000 USD	488	408
Reliance LP 2,68 % 01-12-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	430 000	430	395
Reliance LP 2,67 % 01-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	650 000	650	586
Renasas Electronics Corp. 1,54 % 26-11-2024	Japon	Sociétés – Non convertibles	560 000 USD	706	737
Renasas Electronics Corp. 2,17 % 25-11-2026	Japon	Sociétés – Non convertibles	650 000 USD	819	805
Fonds de placement immobilier RioCan 5,96 % 01-10-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	513 000	513	530
Rogers Communications Inc. 3,10 % 15-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 709 000	1 635	1 674
Rogers Communications Inc. 5,70 % 21-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 440 000	1 438	1 496
Rogers Communications Inc. 3,75 % 15-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 879 000	1 869	1 797
Rogers Communications Inc. 2,90 % 09-12-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 633 000	1 621	1 454
Rogers Communications Inc. 5,25 % 15-04-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	329 000	327	321
Rogers Communications Inc., taux variable 15-03-2082 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	368 000 USD	467	478
Banque Royale du Canada 4,61 % 26-07-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	101 000	100	101
Banque Royale du Canada, taux variable 03-11-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	301 000	268	281
Banque Royale du Canada, taux variable 03-04-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 020 000	1 020	1 024
Sagen MI Canada Inc. 3,26 % 05-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	570 000	570	485
Sagen MI Canada Inc., taux variable 24-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	420 000	420	371
Saputo inc. 2,88 % 19-11-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	360 000	360	355
Seaspan Corp. 5,50 % 01-08-2029 144A	Hong Kong	Sociétés – Non convertibles	300 000 USD	345	355
Secure Energy Services Inc. 6,75 % 22-03-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	103 000	103	104
Sienna Senior Living Inc. 3,11 % 04-11-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	260 000	260	256
Sienna Senior Living Inc. 3,45 % 27-02-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	330 000	330	317
Sienna Senior Living Inc. 2,82 % 31-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 310 000	2 408	2 145
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 5,95 % 04-02-2027	Chine	Sociétés – Non convertibles	300 000 USD	93	30
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 4,75 % 05-08-2029	Chine	Sociétés – Non convertibles	2 959 000 USD	1 434	313
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 4,75 % 14-01-2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	675 000 USD	217	72
SK Neptune Husky Group SARL, prêt à terme (paiement en nature) bon à ce jour, non garanti, taux variable 30-04-2024	Luxembourg	Prêts à terme	38 926 USD	50	52
Sorenson Communications LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 12-03-2026	États-Unis	Prêts à terme	191 333 USD	236	264
Source Energy Services Canada LP 10,50 % 15-03-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	290 738	300	283
South Coast British Columbia Transportation Authority 1,60 % 03-07-2030	Canada	Administrations municipales	840 000	840	732
Southwestern Energy Co. 4,75 % 01-02-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	851 000 USD	1 035	1 062

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2024

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Spa US HoldCo Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 12-03-2028	États-Unis	Prêts à terme	396 840 USD	492	538
Specialty Pharma III Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 24-02-2028	États-Unis	Prêts à terme	380 250 USD	471	494
Stitch Acquisition Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 27-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	459 425 USD	536	187
Financière Sun Life inc., taux variable 21-11-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 010 000	1 010	929
Financière Sun Life inc., taux variable 10-08-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	879 000	874	879
Financière Sun Life inc., taux variable 04-07-2035	Canada	Sociétés – Non convertibles	291 000	291	301
Financière Sun Life inc., taux variable 01-10-2035	Canada	Sociétés – Non convertibles	860 000	859	728
Sunac China Holdings Ltd. 6,00 % 30-09-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	250 173 USD	106	41
Sunac China Holdings Ltd. 6,25 % 30-09-2026	Chine	Sociétés – Non convertibles	250 173 USD	96	35
Sunac China Holdings Ltd. 6,50 % 30-09-2027	Chine	Sociétés – Non convertibles	500 347 USD	164	63
Sunac China Holdings Ltd. 6,75 % 30-09-2028	Chine	Sociétés – Non convertibles	750 521 USD	218	85
Sunac China Holdings Ltd. 7,00 % 30-09-2029	Chine	Sociétés – Non convertibles	750 521 USD	169	76
Sunac China Holdings Ltd. 7,25 % 30-09-2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	352 552 USD	73	31
Sunac China Holdings Ltd. 1,00 % 30-09-2032	Chine	Sociétés – Non convertibles	309 248 USD	85	28
Suncor Énergie Inc. 5,40 % 17-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 120 000	1 118	1 137
Suncor Énergie Inc. 3,75 % 04-03-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 228 000 USD	2 349	2 234
Suncor Énergie Inc. 3,95 % 04-03-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	460 000	455	374
Supérieur Plus S.E.C. 4,50 % 15-03-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	150 000 USD	191	188
Suzano Austria GmbH 2,50 % 15-09-2028	Brésil	Sociétés – Non convertibles	985 000 USD	1 135	1 177
Suzano SA 3,75 % 15-01-2031	Brésil	Sociétés – Non convertibles	490 000 USD	677	588
TELUS Corp. 4,80 % 15-12-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000	250	252
TELUS Corp. 3,30 % 02-05-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	404 000	391	380
TELUS Corp. 3,15 % 19-02-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	900 000	898	828
TELUS Corp. 2,85 % 13-11-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	610 000	509	533
TELUS Corp. 4,95 % 28-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	370 000	369	370
Tencent Holdings Ltd. 2,39 % 03-06-2030, rachetables 2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	420 000 USD	578	487
Tencent Music Entertainment Group 1,38 % 03-09-2025, rachetables 2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	290 000 USD	381	371
Tencent Music Entertainment Group 2,00 % 03-09-2030, rachetables 2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	210 000 USD	275	233
Tenet Healthcare Corp. 4,38 % 15-01-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	110 000 USD	138	138
Tenet Healthcare 4,25 % 01-06-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	680 000 USD	817	857
Teranet Holdings LP 3,72 % 23-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 520 000	1 520	1 410
TerraForm Power Operating LLC 4,75 % 15-01-2030, rachetables 2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	40 000 USD	53	50
Thomson Reuters Corp. 2,24 % 14-05-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	930 000	930	902
T-Mobile USA Inc. 2,55 % 15-02-2031, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	380 000 USD	516	439
T-Mobile USA Inc. 5,20 % 15-01-2033	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	730 000 USD	942	990
Groupe TMX Ltée 2,30 % 11-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	400 000	401	395
Groupe TMX Ltée 3,78 % 05-06-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	470 000	472	459
Groupe TMX Ltée 4,68 % 16-08-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	370 000	370	374
Groupe TMX Ltée 2,02 % 12-02-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	360 000	360	308
Toronto Hydro Corp. 4,95 % 13-10-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	98 000	101	103
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 25-07-2029, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	42 000	41	42
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-10-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 190 000	1 190	1 203
Tourmaline Oil Corp. 2,53 % 12-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	380 000	380	344
Crédit Toyota Canada Inc. 4,45 % 26-01-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 107 000	1 097	1 102
Toyota Motor Corp. 1,34 % 25-03-2026	Japon	Sociétés – Non convertibles	380 000 USD	476	480
TransCanada PipeLines Ltd. 3,80 % 05-04-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 639 000	5 494	5 503
TransCanada PipeLines Ltd. 5,28 % 15-07-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 240 000	1 240	1 273
TransCanada PipeLines Ltd. 4,33 % 16-09-2047, rachetables 2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	48 000	40	41
TransCanada PipeLines Ltd. 4,20 % 04-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 479 000	1 479	1 262
TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 555 000	3 628	3 336
Trulieve Cannabis Corp. 8,00 % 06-10-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	272 000 USD	336	349
Obligations du Trésor des États-Unis 3,75 % 31-12-2028	États-Unis	Gouvernements étrangers	6 859 500 USD	9 159	9 096
Obligations du Trésor des États-Unis 1,13 % 15-02-2031	États-Unis	Gouvernements étrangers	54 000 USD	63	60
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2032	États-Unis	Gouvernements étrangers	19 400 000 USD	28 862	25 572
Obligations du Trésor des États-Unis 2,75 % 15-08-2032	États-Unis	Gouvernements étrangers	1 318 000 USD	1 643	1 602
Obligations du Trésor des États-Unis 3,50 % 15-02-2033	États-Unis	Gouvernements étrangers	43 457 700 USD	56 982	55 769
Obligations du Trésor des États-Unis 3,88 % 15-08-2033	États-Unis	Gouvernements étrangers	11 500 000 USD	15 304	15 171

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2024

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Obligations du Trésor des États-Unis 2,38 % 15-02-2042	États-Unis	Gouvernements étrangers	2 780 000 USD	3 119	2 803
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052	États-Unis	Gouvernements étrangers	29 600 000 USD	39 563	26 203
UPC Broadband Finco BV 4,88 % 15-07-2031 144A	Pays-Bas	Sociétés – Non convertibles	2 780 000 USD	3 508	3 368
Upfield BV, prêt à terme B de premier rang, taux variable 31-01-2028	Pays-Bas	Prêts à terme	390 000 EUR	618	563
Administration de l'aéroport de Vancouver 1,76 % 20-09-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	213 000	180	183
Ventas Canada Finance Ltd. 5,40 % 21-04-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	830 000	830	844
Ventas Canada Finance Ltd. 5,10 % 05-03-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	770 000	769	774
Verizon Communications Inc., taux variable 20-03-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	224 000 USD	280	305
Verizon Communications Inc. 2,38 % 22-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 288 000	1 259	1 187
Vidéotron ltée 3,63 % 15-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	970 000	970	913
Vidéotron ltée 4,50 % 15-01-2030, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 310 000	1 310	1 252
Visa Inc. 2,00 % 15-08-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	4 455 000 USD	3 799	3 565
VistaJet Malta Finance PLC 6,38 % 01-02-2030 144A	Suisse	Sociétés – Non convertibles	1 831 000 USD	1 709	1 834
VTR Comunicaciones SPA 5,13 % 15-01-2028 144A	Chili	Sociétés – Non convertibles	682 000 USD	929	651
VTR Finance NV 6,38 % 15-07-2028 144A	Chili	Sociétés – Non convertibles	500 000 USD	681	383
Weatherford International Ltd. 6,50 % 15-09-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	340 000 USD	473	476
Weatherford International Ltd. 8,63 % 30-04-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	4 010 000 USD	4 959	5 674
Wells Fargo & Co. 2,57 % 01-05-2026, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	260 000	270	253
Wells Fargo & Co. 2,98 % 19-05-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	231 000	244	222
Groupe WSP Global Inc. 2,41 % 19-04-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	770 000	770	707
Zoetis Inc. 2,00 % 15-05-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 000 000 USD	1 098	1 142
<b>Total des obligations</b>				<b>819 625</b>	<b>773 082</b>
<b>ACTIONS</b>					
AbbVie Inc.	États-Unis	Soins de santé	101 743	15 826	25 091
Air Liquide SA	France	Matériaux	46 529	5 487	13 109
Alphabet Inc., cat. A	États-Unis	Services de communication	141 214	21 366	28 864
Altria Group Inc.	États-Unis	Consommation de base	187 965	11 760	11 104
Amadeus IT Group SA	Espagne	Consommation discrétionnaire	103 762	8 860	9 011
Amazon.com Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	144 588	25 123	35 321
American Tower Corp., cat. A	États-Unis	Biens immobiliers	22 122	4 951	5 920
Analog Devices Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	31 219	7 186	8 362
Aon PLC	Irlande	Services financiers	41 668	12 359	18 832
Apple Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	111 204	12 466	25 825
AstraZeneca PLC	Royaume-Uni	Soins de santé	109 248	19 843	19 941
Atlas Copco AB, A	Suède	Produits industriels	306 800	2 848	7 021
AutoZone Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	2 378	8 604	10 150
BCE Inc., priv., série AA	Canada	Services de communication	16 472	256	283
BCE Inc., priv., série AI	Canada	Services de communication	2 512	38	40
BCE Inc. 4,54 %, à div. cumulatif rachetable, priv. de premier rang, série R, rachetables	Canada	Services de communication	13 980	253	226
Becton, Dickinson and Co.	États-Unis	Soins de santé	38 391	9 983	12 865
Broadcom Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	19 193	8 535	34 451
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 46	Canada	Biens immobiliers	25 630	646	528
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 48	Canada	Biens immobiliers	10 409	260	217
Brookfield Renewable Partners L.P., priv., série 13	Canada	Services publics	7 357	182	147
Cenovus Energy Inc., priv., série 3	Canada	Énergie	4 970	104	118
Cenovus Energy Inc., priv., série 7	Canada	Énergie	28 990	581	665
Chevron Corp.	États-Unis	Énergie	103 063	14 410	22 017
CME Group Inc.	États-Unis	Services financiers	72 158	13 544	21 039
The Coca-Cola Co.	États-Unis	Consommation de base	184 086	12 227	15 252
Colgate-Palmolive Co.	États-Unis	Consommation de base	110 808	11 483	13 513
Compass Group PLC	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	78 648	2 954	3 123
ConocoPhillips	États-Unis	Énergie	71 558	9 916	12 335
CRH PLC	Irlande	Matériaux	122 711	9 050	14 335
DBS Group Holdings Ltd.	Singapour	Services financiers	398 690	12 231	14 409
Deutsche Börse AG	Allemagne	Services financiers	85 898	12 561	23 800
Diageo PLC	Royaume-Uni	Consommation de base	164 964	7 698	8 250
Duke Energy Corp.	États-Unis	Services publics	59 466	7 622	7 788

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2024

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N <sup>bre</sup> d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>ACTIONS (suite)</b>					
Emera Inc., priv., série L	Canada	Services publics	12 875	322	229
Equifax Inc.	États-Unis	Produits industriels	21 903	2 987	7 935
Evolution Gaming Group AB	Suède	Consommation discrétionnaire	9 901	1 760	1 668
Ferguson PLC (\$ US)	États-Unis	Produits industriels	36 603	8 683	10 828
Frontera Generation Holdings LLC	États-Unis	Énergie	1 737	4	4
Glencore PLC	Australie	Matériaux	2 413 912	13 008	17 962
Haleon PLC	Royaume-Uni	Consommation de base	1 489 121	8 536	8 479
Hannover Rueckversicherung SE, nom.	Allemagne	Services financiers	34 072	7 340	12 629
HDFC Bank Ltd.	Inde	Services financiers	447 926	9 643	10 533
Heineken Holding NV, A	Pays-Bas	Consommation de base	70 397	7 534	7 693
Honeywell International Inc.	États-Unis	Produits industriels	47 068	8 413	13 083
Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	Hong Kong	Services financiers	127 809	5 502	5 037
Intelsat Jackson Holdings SA	Luxembourg	Services de communication	9 877	422	358
ITOCHU Corp.	Japon	Produits industriels	277 000	14 871	16 024
Japan Exchange Group Inc.	Japon	Services financiers	392 800	8 127	14 443
Johnson & Johnson	États-Unis	Soins de santé	100 797	18 489	21 594
JPMorgan Chase & Co.	États-Unis	Services financiers	127 415	19 025	34 563
Keyence Corp.	Japon	Technologie de l'information	13 089	4 919	8 143
Kweichow Moutai Co. Ltd., cat. A	Chine	Consommation de base	9 528	354	3 038
Lam Research Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	14 313	10 474	18 833
Linde PLC (Bourse de New York)	Irlande	Matériaux	20 798	4 462	13 078
Les Compagnies Loblaw Ltée					
5,30 %, à div. cumulatif rachetable, priv. de second rang, série B	Canada	Consommation de base	2 273	59	51
London Stock Exchange Group PLC	Royaume-Uni	Services financiers	15 462	2 375	2 508
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	France	Consommation discrétionnaire	7 061	3 956	8 600
McDonald's Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	33 776	6 927	12 897
McKesson Corp.	États-Unis	Soins de santé	21 514	11 062	15 642
Merck & Co. Inc.	États-Unis	Soins de santé	71 040	10 664	12 695
Meta Platforms Inc., cat. A	États-Unis	Services de communication	37 869	16 607	24 903
Microsoft Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	108 740	16 638	61 957
Moody's Corp.	États-Unis	Services financiers	10 468	1 581	5 572
Motorola Solutions Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	49 168	11 191	23 637
Nestlé SA, nom.	Suisse	Consommation de base	71 750	7 536	10 318
Northrop Grumman Corp.	États-Unis	Produits industriels	15 485	10 227	10 038
Novo Nordisk AS, B	Danemark	Soins de santé	130 246	4 524	22 483
Oracle Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	55 105	8 448	9 374
<sup>1</sup> Pernod Ricard SA	France	Consommation de base	24 852	4 464	5 444
Philip Morris International Inc.	États-Unis	Consommation de base	175 014	19 657	21 716
Polymetal International PLC	Russie	Matériaux	393	1	2
Roche Holding AG Genussscheine	Suisse	Soins de santé	39 309	14 534	13 561
S&P Global Inc.	États-Unis	Services financiers	28 384	12 612	16 354
Safran SA	France	Produits industriels	60 271	7 593	18 496
SAP AG	Allemagne	Technologie de l'information	145 578	20 550	38 382
Schlumberger Ltd.	États-Unis	Énergie	109 759	6 096	8 147
Shell PLC (actions en livres sterling)	Pays-Bas	Énergie	482 929	17 699	21 670
The Sherwin-Williams Co.	États-Unis	Matériaux	16 242	2 422	7 640
Siemens AG	Allemagne	Produits industriels	48 739	11 247	12 601
Sika AG	Suisse	Matériaux	14 181	2 615	5 721
Sony Corp.	Japon	Consommation discrétionnaire	108 140	8 124	12 563
Source Energy Services Ltd.	Canada	Énergie	15 480	38	214
Starbucks Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	56 967	4 986	7 051
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	Taiwan	Technologie de l'information	633 120	8 082	20 872
Texas Instruments Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	26 747	3 908	6 310
Thales SA	France	Produits industriels	30 597	6 191	7 065
Thermo Fisher Scientific Inc.	États-Unis	Soins de santé	12 843	9 092	10 109
TransAlta Corp., perpétuelles, priv., série C	Canada	Services publics	3 910	73	73
TransAlta Corp., priv., série A	Canada	Services publics	34 458	450	466
Union Pacific Corp.	États-Unis	Produits industriels	44 355	12 412	14 773
UnitedHealth Group Inc.	États-Unis	Soins de santé	23 320	16 469	15 624
Veolia Environnement	France	Services publics	181 565	7 706	7 992
Visa Inc., cat. A	États-Unis	Services financiers	51 037	8 456	19 290

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 31 mars 2024

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N <sup>bre</sup> d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>ACTIONS (suite)</b>					
The Williams Companies Inc.	États-Unis	Énergie	299 719	12 578	15 818
Wolters Kluwer NV	Pays-Bas	Produits industriels	51 799	5 275	10 988
<b>Total des actions</b>				<b>781 213</b>	<b>1 189 723</b>
<b>OPTIONS</b>					
Options achetées (se reporter au tableau des options achetées)				338	79
<b>Total des options</b>				<b>338</b>	<b>79</b>
<b>FONDS/BILLETS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>					
<sup>2</sup> FNB de revenu à taux variable Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	504 408	8 785	8 802
<sup>2</sup> FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	340 000	6 844	5 964
<sup>2</sup> FINB Obligations américaines totales Mackenzie (couvert en \$ CA)	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	50 000	4 299	4 087
<sup>2</sup> FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	54 435	5 059	4 710
<b>Total des fonds/billets négociés en bourse</b>				<b>24 987</b>	<b>23 563</b>
<b>FONDS COMMUNS DE PLACEMENT</b>					
<sup>3</sup> Fonds international de dividendes Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	389 347	3 987	6 043
<sup>3</sup> Fonds de revenu fixe sans contraintes Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	176 240	1 738	1 536
<b>Total des fonds communs de placement</b>				<b>5 725</b>	<b>7 579</b>
<b>FONDS PRIVÉS</b>					
<sup>4</sup> Northleaf Private Credit II LP	Canada	Services financiers	811	8 536	8 554
<sup>5</sup> Sagard Credit Partners II LP	Canada	Services financiers	811	3 996	4 336
<b>Total des fonds privés</b>				<b>12 532</b>	<b>12 890</b>
<b>BILLETS À COURT TERME</b>					
Gouvernement du Canada 4,95 % 06-06-2024	Canada	Gouvernement fédéral	451 000	445	447
Banque Royale du Canada 4,95 % 01-04-2024	Canada	Obligations de sociétés	6 231 000	6 231	6 234
Obligations du Trésor des États-Unis 5,26 % 28-05-2024	États-Unis	Gouvernements étrangers	13 816 400	18 412	18 558
Obligations du Trésor des États-Unis 5,39 % 08-08-2024	États-Unis	Gouvernements étrangers	53 850 000	69 286	71 608
<b>Total des billets à court terme</b>				<b>94 374</b>	<b>96 847</b>
Coûts de transaction				(1 156)	–
<b>Total des placements</b>				<b>1 737 638</b>	<b>2 103 763</b>
Instruments dérivés (se reporter au tableau des instruments dérivés)					(1 024)
Trésorerie et équivalents de trésorerie					22 151
Autres éléments d'actif moins le passif					9 849
<b>Actif net attribuable aux porteurs de titres</b>					<b>2 134 739</b>

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

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

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

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

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

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## APERÇU DU PORTEFEUILLE

31 MARS 2024

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Actions	55,7
Obligations	40,1
Obligations	36,2
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)	3,9
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)	–
Placements à court terme	1,6
Fonds/billets négociés en bourse	1,1
Fonds privés	0,6
Autres éléments d'actif (de passif)	0,5
Fonds communs de placement	0,4
Options sur swaps achetées	–
Options sur devises achetées	–

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	52,9
Canada	10,4
Allemagne	5,8
Autre	5,3
Royaume-Uni	3,4
Mexique	3,2
France	3,1
Irlande	2,5
Japon	2,5
Nouvelle-Zélande	2,4
Brésil	2,3
Pays-Bas	2,1
Suisse	1,5
Danemark	1,1
Taiwan	1,0
Autres éléments d'actif (de passif)	0,5

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations d'État étrangères	20,2
Obligations de sociétés	15,5
Technologie de l'information	12,0
Services financiers	9,5
Soins de santé	7,9
Produits industriels	6,0
Consommation de base	4,9
Consommation discrétionnaire	4,7
Autre	4,4
Énergie	3,8
Matériaux	3,4
Services de communication	2,5
Obligations fédérales	1,9
Billets à escompte de gouvernements étrangers à court terme	1,6
Obligations provinciales	1,2
Autres éléments d'actif (de passif)	0,5

31 MARS 2023

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Actions	54,8
Obligations	35,8
Obligations	36,3
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)	–
Options achetées	–
Options vendues	–
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)	(0,5)
Trésorerie et placements à court terme	4,8
Fonds/billets négociés en bourse	2,0
Autres éléments d'actif (de passif)	1,2
Fonds communs de placement	0,8
Fonds privés	0,6
Options sur devises achetées	–

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	52,1
Canada	13,3
Autre	5,8
Trésorerie et placements à court terme	4,8
Allemagne	4,5
Pays-Bas	3,1
Mexique	2,9
Japon	2,5
France	2,4
Royaume-Uni	2,4
Suisse	1,5
Autres éléments d'actif (de passif)	1,2
Hong Kong	0,9
Brésil	0,9
Danemark	0,9
Espagne	0,8

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations d'État étrangères	16,3
Obligations de sociétés	15,8
Services financiers	10,0
Technologie de l'information	9,6
Soins de santé	9,2
Consommation de base	6,8
Trésorerie et placements à court terme	4,8
Produits industriels	4,6
Énergie	4,4
Consommation discrétionnaire	4,3
Matériaux	4,0
Autre	2,0
Fonds/billets négociés en bourse	2,0
Obligations fédérales	1,8
Services de communication	1,4
Obligations provinciales	1,2
Autres éléments d'actif (de passif)	1,2
Fonds privés	0,6

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## TABLEAU DES OPTIONS ACHETÉES

au 31 mars 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 \$)
Indice Markit North American Investment Grade CDX	99 076 000	Vente	17 avril 2024	57,50 USD	60	5
Taux CORRA swaps de taux d'intérêt	11 975 000	Achat	30 avril 2024	3,08 CAD	44	2
Option de vente sur devises USD/EUR	82 600 000	Vente	23 mai 2024	1,08 USD	51	48
Indice écart taux plafond/SOFR	95 506 000	Achat	25 mai 2024	0,30 USD	138	1
Taux CORRA swaps de taux d'intérêt	7 909 000	Achat	31 juillet 2024	3,00 CAD	45	23
<b>Total des options</b>					<b>338</b>	<b>79</b>

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS

au 31 mars 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 du gouvernement du Japon à 10 ans, juin 2024	(44)	13 juin 2024	145,78 JPY	(57 425)	–	(45)
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor américain à 10 ans, juin 2024	381	18 juin 2024	110,49 USD	57 169	180	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du Royaume-Uni, juin 2024	154	26 juin 2024	98,28 GBP	26 309	411	–
<b>Total des contrats à terme standardisés</b>				<b>26 053</b>	<b>591</b>	<b>(45)</b>

\* Le montant notionnel représente l'exposition aux instruments sous-jacents au 31 mars 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	2 550 AUD	(1 662) USD	2 avril 2024	2 251	2 251	–	–
A	1 664 USD	(2 550) AUD	2 avril 2024	(2 253)	(2 251)	2	–
A	1 118 CAD	(825) USD	2 avril 2024	(1 118)	(1 117)	1	–
A	826 USD	(1 118) CAD	2 avril 2024	1 118	1 119	1	–
A	1 010 CHF	(1 150) USD	2 avril 2024	1 558	1 517	–	(41)
A	1 121 USD	(1 010) CHF	2 avril 2024	(1 518)	(1 517)	1	–
A	83 USD	(76) EUR	2 avril 2024	(112)	(112)	–	–
A	76 EUR	(82) USD	2 avril 2024	111	111	–	–
A	2 981 GBP	(3 772) USD	2 avril 2024	5 108	5 096	–	(12)
A	3 766 USD	(2 981) GBP	2 avril 2024	(5 100)	(5 096)	4	–
A	286 400 JPY	(1 922) USD	2 avril 2024	2 603	2 563	–	(40)
A	1 893 USD	(286 400) JPY	2 avril 2024	(2 563)	(2 563)	–	–
A	5 345 USD	(56 610) NOK	2 avril 2024	(7 238)	(7 062)	176	–
A	56 610 NOK	(5 218) USD	2 avril 2024	7 067	7 063	–	(4)
A	312 USD	(512) NZD	2 avril 2024	(422)	(414)	8	–
A	512 NZD	(306) USD	2 avril 2024	415	415	–	–
A	4 914 USD	(50 790) SEK	2 avril 2024	(6 655)	(6 429)	226	–
A	50 790 SEK	(4 750) USD	2 avril 2024	6 433	6 430	–	(3)
A	5 263 USD	(7 007) CAD	12 avril 2024	7 007	7 127	120	–
AA	5 205 CAD	(3 910) USD	12 avril 2024	(5 205)	(5 295)	–	(90)
A	2 601 CAD	(1 959) USD	12 avril 2024	(2 601)	(2 653)	–	(52)
A	11 000 USD	(14 803) CAD	12 avril 2024	14 803	14 897	94	–
A	1 959 USD	(2 643) CAD	12 avril 2024	2 643	2 653	10	–
AA	43 605 CAD	(32 695) USD	19 avril 2024	(43 605)	(44 279)	–	(674)
AA	85 245 CAD	(63 366) USD	19 avril 2024	(85 245)	(85 812)	–	(567)
AA	10 138 CAD	(7 523) USD	19 avril 2024	(10 138)	(10 187)	–	(49)
AA	8 180 USD	(11 123) CAD	19 avril 2024	11 123	11 078	–	(45)
AA	1 446 USD	(1 963) CAD	19 avril 2024	1 963	1 958	–	(5)
A	688 USD	(3 440) BRL	22 avril 2024	(932)	(927)	5	–
A	3 440 BRL	(693) USD	22 avril 2024	939	927	–	(12)
A	325 USD	(299 000) CLP	22 avril 2024	(440)	(413)	27	–
A	299 000 CLP	(308) USD	22 avril 2024	417	413	–	(4)
A	614 USD	(218 000) HUF	22 avril 2024	(832)	(807)	25	–
A	218 000 HUF	(605) USD	22 avril 2024	820	808	–	(12)
A	6 930 PEN	(1 849) USD	22 avril 2024	2 504	2 520	16	–
A	1 821 USD	(6 930) PEN	22 avril 2024	(2 466)	(2 520)	–	(54)
A	896 USD	(3 630) PLN	22 avril 2024	(1 213)	(1 230)	–	(17)

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 31 mars 2024

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	3 630 PLN	(906) USD	22 avril 2024	1 227	1 230	3	–
A	33 600 THB	(947) USD	22 avril 2024	1 282	1 248	–	(34)
A	939 USD	(33 600) THB	22 avril 2024	(1 271)	(1 249)	22	–
A	696 USD	(13 310) ZAR	22 avril 2024	(943)	(949)	–	(6)
A	13 310 ZAR	(700) USD	22 avril 2024	948	949	1	–
A	15 430 CAD	(10 500) EUR	26 avril 2024	(15 430)	(15 355)	75	–
AA	4 178 CAD	(2 844) EUR	26 avril 2024	(4 178)	(4 158)	20	–
A	11 EUR	(16) CAD	26 avril 2024	16	16	–	–
AA	450 EUR	(655) CAD	26 avril 2024	655	658	3	–
A	5 086 CAD	(3 490) EUR	26 avril 2024	(5 086)	(5 103)	–	(17)
AA	365 EUR	(536) CAD	26 avril 2024	536	534	–	(2)
A	26 820 CAD	(19 897) USD	26 avril 2024	(26 820)	(26 944)	–	(124)
AA	9 666 CAD	(7 160) USD	26 avril 2024	(9 666)	(9 696)	–	(30)
A	349 CAD	(259) USD	26 avril 2024	(349)	(351)	–	(2)
AA	38 291 CAD	(28 421) USD	26 avril 2024	(38 291)	(38 486)	–	(195)
A	93 837 CAD	(69 682) USD	26 avril 2024	(93 837)	(94 361)	–	(524)
AA	9 843 CAD	(7 320) USD	26 avril 2024	(9 843)	(9 912)	–	(69)
AA	389 USD	(528) CAD	26 avril 2024	528	527	–	(1)
A	132 USD	(202) AUD	2 mai 2024	(179)	(179)	–	–
A	2 480 CAD	(1 833) USD	2 mai 2024	(2 480)	(2 483)	–	(3)
A	10 069 USD	(9 040) CHF	2 mai 2024	(13 636)	(13 624)	12	–
A	2 519 EUR	(2 724) USD	2 mai 2024	3 689	3 685	–	(4)
A	3 799 GBP	(4 800) USD	2 mai 2024	6 500	6 494	–	(6)
A	566 400 JPY	(3 760) USD	2 mai 2024	5 092	5 092	–	–
A	3 490 NOK	(322) USD	2 mai 2024	436	436	–	–
A	704 USD	(1 176) NZD	2 mai 2024	(953)	(952)	1	–
A	6 045 USD	(64 570) SEK	2 mai 2024	(8 187)	(8 178)	9	–
AA	7 260 CAD	(8 800) NZD	3 mai 2024	(7 260)	(7 118)	142	–
A	40 710 CAD	(30 325) USD	3 mai 2024	(40 710)	(41 063)	–	(353)
AA	26 567 CAD	(32 215) NZD	8 mai 2024	(26 567)	(26 055)	512	–
A	18 089 CAD	(21 960) NZD	8 mai 2024	(18 089)	(17 761)	328	–
A	5 256 CAD	(3 910) USD	10 mai 2024	(5 256)	(5 294)	–	(38)
A	6 325 CAD	(4 677) USD	10 mai 2024	(6 325)	(6 333)	–	(8)
AA	35 353 CAD	(26 166) USD	17 mai 2024	(35 353)	(35 423)	–	(70)
A	4 254 CAD	(4 790) AUD	12 juin 2024	(4 254)	(4 232)	22	–
A	2 597 CAD	(2 925) AUD	12 juin 2024	(2 597)	(2 585)	12	–
A	2 925 AUD	(2 602) CAD	12 juin 2024	2 602	2 585	–	(17)
A	4 790 AUD	(4 262) CAD	12 juin 2024	4 262	4 232	–	(30)
A	18 561 CAD	(12 578) EUR	14 juin 2024	(18 561)	(18 420)	141	–
AA	13 071 CAD	(163 915) MXN	14 juin 2024	(13 071)	(13 184)	–	(113)
A	3 229 CAD	(40 523) MXN	14 juin 2024	(3 229)	(3 259)	–	(30)
A	5 760 CAD	(72 280) MXN	24 juin 2024	(5 760)	(5 804)	–	(44)
A	11 460 CAD	(143 750) MXN	24 juin 2024	(11 460)	(11 543)	–	(83)
A	11 463 CAD	(143 750) MXN	24 juin 2024	(11 463)	(11 542)	–	(79)
A	2 550 CAD	(32 090) MXN	24 juin 2024	(2 550)	(2 576)	–	(26)
<b>Total des contrats de change à terme de gré à gré</b>						<b>2 019</b>	<b>(3 589)</b>
<b>Total des actifs dérivés</b>							<b>2 610</b>
<b>Total des passifs dérivés</b>							<b>(3 634)</b>

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 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 périodes closes les 31 mars 2024 et 2023, ou est présentée à ces dates, selon le cas. Pour l'exercice au cours duquel un fonds ou une série est établi(e) ou rétabli(e), l'information fournie se rapporte à la période commençant à la date d'établissement ou de rétablissement. Lorsqu'une série d'un fonds a été dissoute au cours de l'une ou l'autre des périodes, l'information concernant la série est fournie jusqu'à la fermeture des bureaux à la date de dissolution. Se reporter à la note 10 pour la date de constitution du Fonds et la date d'établissement de chacune des séries.

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

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

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

Les présents états financiers annuels audités (les « états financiers ») ont été établis conformément aux normes IFRS de comptabilité (les « IFRS »). 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 4 juin 2024.

### 3. Méthodes comptables significatives

Le Fonds a adopté les modifications à l'IAS 1 et à l'énoncé de pratiques en IFRS 2 de l'exposé-sondage Informations à fournir sur les méthodes comptables le 1<sup>er</sup> avril 2023. Même si les modifications n'ont pas entraîné de changements aux méthodes comptables comme telles, elles ont eu une incidence sur les informations sur les méthodes comptables présentées dans les états financiers. Les modifications font en sorte que l'entité est tenue de fournir des informations sur ses méthodes comptables « significatives » plutôt que des informations sur ses « principales » méthodes comptables. Les modifications fournissent aussi des indications sur la façon d'appliquer le concept d'importance relative aux informations à fournir sur les méthodes comptables. Le gestionnaire a passé en revue les méthodes comptables et a mis à jour les informations présentées dans certains cas conformément aux modifications.

#### a) Instruments financiers

Les instruments financiers comprennent des actifs financiers et des passifs financiers tels que des titres de créance, des titres de capitaux propres, des fonds de placement 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.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## NOTES ANNEXES

### 3. Méthodes comptables significatives (suite)

#### a) Instruments financiers (suite)

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

#### b) Évaluation de la juste valeur

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

Les placements dans des titres cotés à une Bourse des valeurs mobilières ou négociés sur un marché hors cote sont évalués selon le dernier cours de marché ou le cours de clôture enregistré par la Bourse sur laquelle le titre se négocie principalement, le cours se situant à l'intérieur d'un écart acheteur-vendeur pour le placement. Dans certaines circonstances, lorsque le cours ne se situe pas à l'intérieur de l'écart acheteur-vendeur, Mackenzie détermine le point le plus représentatif de la juste valeur dans cet écart en fonction de faits et de circonstances spécifiques. Les titres de fonds communs d'un fonds sous-jacent sont évalués un jour ouvrable au cours calculé par le gestionnaire de ce fonds sous-jacent, conformément à ses actes constitutifs. Les titres non cotés ou non négociés à une Bourse et les titres dont le cours de la dernière vente ou de clôture n'est pas disponible ou les titres pour lesquels les cours boursiers, de l'avis de Mackenzie, sont inexacts ou incertains, ou ne reflètent pas tous les renseignements 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 et les équivalents de trésorerie sont présentés à leur juste valeur, qui se rapproche de leur coût amorti en raison de leur nature très liquide et de leur échéance à court terme. Les découverts bancaires sont présentés dans les passifs courants à titre de dette bancaire dans l'état de la situation financière.

Le Fonds peut avoir recours à des instruments dérivés (comme les options souscrites, les contrats à terme standardisés ou de gré à gré, les swaps ou les instruments dérivés sur mesure) en guise de couverture contre les pertes occasionnées par des fluctuations des cours des titres, des taux d'intérêt ou des taux de change.

Le Fonds peut également avoir recours à des instruments dérivés à des fins autres que de couverture afin d'effectuer indirectement des placements dans des titres ou des marchés financiers, de s'exposer à d'autres devises, de chercher à générer des revenus supplémentaires ou à toute autre fin considérée comme appropriée par le ou les portefeuillistes du Fonds, pourvu que cela soit compatible avec les objectifs de placement du Fonds. Les instruments dérivés doivent être utilisés conformément à la législation canadienne sur les organismes de placement collectif, sous réserve des dispenses accordées au Fonds par les organismes de réglementation, le cas échéant.

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

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

La 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 31 mars 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.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## NOTES ANNEXES

### 3. Méthodes comptables significatives (suite)

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

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

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

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

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

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

#### 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'acquiescer, 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 (« 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.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## NOTES ANNEXES

### 3. Méthodes comptables significatives (suite)

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

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

#### i) Valeur liquidative par titre

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

#### 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.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## NOTES ANNEXES

### 5. Impôts sur le résultat

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

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

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

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

Chaque série du Fonds, exception faite de la série-B, se voit imputer des frais d'administration annuels à taux fixe (les « frais d'administration ») et en retour, Mackenzie prend en charge tous les frais d'exploitation du Fonds autres que certains frais précis associés au Fonds. Les frais d'administration sont calculés 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 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 31 mars 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 31 mars 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).

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## NOTES ANNEXES

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

#### iii. Risque de change

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

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

#### 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 DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## NOTES ANNEXES

### 9. Autres renseignements

#### Abréviations

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

Code de la devise	Description	Code de la devise	Description	Code de la devise	Description
AUD	Dollar australien	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 DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 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 : 29 septembre 2006

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

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

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

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

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

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

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

Les titres des séries O et O5 sont offerts seulement aux investisseurs qui investissent un minimum de 500 000 \$ et qui participent au Service d'architecture de portefeuille ou au Service d'architecture ouverte de Mackenzie; ils sont également proposés à certains investisseurs institutionnels, à certains investisseurs d'un régime collectif admissible et à certains employés admissibles de Mackenzie et de ses filiales. Les investisseurs des séries O et O5 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année.

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

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

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

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

Les titres de série 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 B, GF, GF8, GLF, GO, GPW, GPWFB, GPWT8, GPWX, GPWX8, GW et OJ ont été créés exclusivement afin de mettre en œuvre les fusions touchant le Fonds et ne sont pas offerts à la vente.

Les titres des séries G et I ne sont plus offerts à la vente.

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

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

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## NOTES ANNEXES

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

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

Série	Date d'établissement/ de rétablissement	Frais de gestion	Frais d'administration
Série A	31 mars 2008	1,85 %	0,24 %
Série AR	19 novembre 2014	1,85 %	0,27 %
Série B	24 novembre 2006	1,85 %	0,24 %
Série D	19 mars 2014	0,85 % <sup>3)</sup>	0,16 %
Série F	23 octobre 2006	0,70 %	0,15 %
Série F8	1 <sup>er</sup> juin 2018	0,70 %	0,15 %
Série FB	26 octobre 2015	0,85 %	0,24 %
Série G	25 novembre 2016	1,35 %	0,24 %
Série GF	17 juin 2023	0,65 %	0,15 %
Série GF8	17 juin 2023	0,65 %	0,15 %
Série GLF	17 juin 2023	0,65 %	0,15 %
Série GO	17 juin 2023	— <sup>1)</sup>	s.o.
Série GPW	17 juin 2023	1,65 %	0,15 %
Série GPWFB	17 juin 2023	0,65 %	0,15 %
Série GPWT8	17 juin 2023	1,65 %	0,15 %
Série GPWX	17 juin 2023	— <sup>2)</sup>	— <sup>2)</sup>
Série GPWX8	17 juin 2023	— <sup>2)</sup>	— <sup>2)</sup>
Série GW	17 juin 2023	1,65 %	0,15 %
Série I	24 novembre 2006	1,25 %	0,24 %
Série OJ	25 novembre 2016	1,70 %	0,20 %
Série O	24 novembre 2006	— <sup>1)</sup>	s.o.
Série O5	12 janvier 2016	— <sup>1)</sup>	s.o.
Série PW	30 octobre 2013	1,70 %	0,15 %
Série PWFB	3 avril 2017	0,70 %	0,15 %
Série PWR	1 <sup>er</sup> avril 2019	1,70 %	0,15 %
Série PWT5	3 avril 2017	1,70 %	0,15 %
Série PWT8	16 décembre 2013	1,70 %	0,15 %
Série PWX	30 juin 2014	— <sup>2)</sup>	— <sup>2)</sup>
Série PWX8	10 février 2015	— <sup>2)</sup>	— <sup>2)</sup>
Série R	6 juin 2023	s.o.	s.o.
Série S	31 octobre 2017	— <sup>1)</sup>	0,025 %
Série T5	23 octobre 2006	1,85 %	0,24 %
Série T8	24 octobre 2018	1,85 %	0,24 %
Série LB	17 juin 2023	1,85 %	0,24 %
Série LF	17 juin 2023	0,70 %	0,15 %
Série LW	17 juin 2023	1,70 %	0,15 %

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

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

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

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## NOTES ANNEXES

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

#### b) Reports prospectifs de pertes fiscales

À la fin de la dernière année d'imposition, aucune perte en capital ni autre qu'en capital n'était disponible pour un report prospectif aux fins de l'impôt.

#### c) Prêt de titres

	31 mars 2024	31 mars 2023
	(\$)	(\$)
Valeur des titres prêtés	151 225	38 635
Valeur des biens reçus en garantie	159 260	40 684

	31 mars 2024		31 mars 2023	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
Revenus de prêts de titres bruts	317	100,0	169	100,0
Impôt retenu à la source	(4)	(1,3)	(13)	(7,7)
	313	98,7	156	92,3
Paiements à l'agent de prêt de titres	(56)	(17,7)	(28)	(16,6)
Revenu tiré du prêt de titres	257	81,0	128	75,7

#### d) Commissions

	(\$)
31 mars 2024	196
31 mars 2023	117

#### e) Risques découlant des instruments financiers

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

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

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## NOTES ANNEXES

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

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

##### ii. Risque de change

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

Devise	31 mars 2024				Incidence sur l'actif net			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Renforcement de 5 %		Affaiblissement de 5 %	
					(\$)	%	(\$)	%
USD	1 081 893	109 000	(261 580)	929 313				
GBP	81 935	9	6 905	88 849				
EUR	218 250	(15)	(149 490)	68 745				
JPY	51 173	(169)	5 047	56 051				
BRL	35 677	–	–	35 677				
DKK	22 483	119	–	22 602				
NTD	20 872	–	–	20 872				
MXN	67 096	–	(47 908)	19 188				
CHF	29 600	–	(13 624)	15 976				
ZAR	14 610	–	–	14 610				
SGD	14 409	–	–	14 409				
INR	10 533	–	–	10 533				
HKD	5 037	96	–	5 133				
CNY	3 038	1 946	–	4 984				
SEK	8 689	–	(8 177)	512				
NOK	–	–	437	437				
HUF	–	–	1	1				
THB	–	–	(1)	(1)				
AUD	–	27	(179)	(152)				
NZD	51 315	–	(51 884)	(569)				
<b>Total</b>	<b>1 716 610</b>	<b>111 013</b>	<b>(520 453)</b>	<b>1 307 170</b>				
% de l'actif net	80,4	5,2	(24,4)	61,2				
<b>Total de la sensibilité aux variations des taux de change</b>					<b>(65 359)</b>	<b>(3,1)</b>	<b>65 359</b>	<b>3,1</b>

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## NOTES ANNEXES

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

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

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

Devise	31 mars 2023				Incidence sur l'actif net			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Renforcement de 5 %		Affaiblissement de 5 %	
					(\$)	%	(\$)	%
USD	1 073 062	27 054	(442 180)	657 936				
EUR	198 899	5 470	(30 228)	174 141				
GBP	72 424	459	31 646	104 529				
JPY	47 293	3 777	(7 289)	43 781				
CHF	42 564	436	(8 468)	34 532				
HKD	18 854	–	–	18 854				
DKK	17 731	102	–	17 833				
BRL	13 834	–	(362)	13 472				
SGD	14 409	–	(2 143)	12 266				
NTD	14 369	–	(2 549)	11 820				
INR	7 536	–	1 841	9 377				
CNY	5 698	62	–	5 760				
NZD	11 246	–	(7 994)	3 252				
EGP	–	–	3 009	3 009				
AUD	9 659	32	(7 441)	2 250				
SEK	5 909	–	(3 927)	1 982				
MXN	34 843	157	(33 824)	1 176				
NOK	4 390	–	(3 399)	991				
ZAR	–	–	640	640				
ILS	8 770	–	(8 730)	40				
HUF	–	–	(404)	(404)				
COP	–	–	(423)	(423)				
KOR	–	–	(720)	(720)				
PEN	–	–	(761)	(761)				
IDR	–	–	(1 318)	(1 318)				
<b>Total</b>	<b>1 601 490</b>	<b>37 549</b>	<b>(525 024)</b>	<b>1 114 015</b>				
% de l'actif net	80,3	1,9	(26,3)	55,9				
<b>Total de la sensibilité aux variations des taux de change</b>					<b>(55 701)</b>	<b>(2,8)</b>	<b>55 701</b>	<b>2,8</b>

\* Comprend les instruments financiers monétaires et non monétaires.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 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.

31 mars 2024	Obligations (\$)	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
			Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
			(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	10 814	26 053				
1 an à 5 ans	199 545	–				
5 ans à 10 ans	379 478	–				
Plus de 10 ans	183 245	–				
Total	773 082	26 053				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt			(58 083)	(2,7)	58 083	2,7

31 mars 2023	Obligations (\$)	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
			Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
			(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	21 322	(366 636)				
1 an à 5 ans	170 667	–				
5 ans à 10 ans	290 752	–				
Plus de 10 ans	240 850	–				
Total	723 591	(366 636)				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt			(33 615)	(1,7)	33 751	1,7

##### iv. Autre risque de prix

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

Incidence sur l'actif net	Augmentation de 10 %		Diminution de 10 %	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
31 mars 2024	123 357	5,8	(123 285)	(5,8)
31 mars 2023	116 052	5,8	(116 052)	(5,8)

##### v. Risque de crédit

Pour ce Fonds, la plus forte concentration du risque de crédit se trouve dans les titres de créance, tels que les obligations. La juste valeur des titres de créance tient compte de la solvabilité de l'émetteur de ces titres. L'exposition maximale à tout émetteur de titres de créance au 31 mars 2024 était de 6,4 % de l'actif net du Fonds (10,5 % en 2023).

Aux 31 mars 2024 et 2023, les titres de créance par note de crédit étaient les suivants :

Note des obligations*	31 mars 2024	31 mars 2023
	% de l'actif net	% de l'actif net
AAA	6,2	5,3
AA	7,8	13,4
A	3,0	3,4
BBB	9,7	7,7
Inférieure à BBB	6,0	3,7
Sans note	3,5	2,8
Total	36,2	36,3

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

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 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.

	31 mars 2024				31 mars 2023			
	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	–	772 886	196	773 082	–	723 591	–	723 591
Actions	1 189 359	2	362	1 189 723	677 061	415 174	343	1 092 578
Options	–	79	–	79	–	422	–	422
Fonds/billets négociés en bourse	23 563	–	–	23 563	39 807	–	–	39 807
Fonds communs de placement	7 579	–	–	7 579	15 361	–	–	15 361
Fonds privés	–	–	12 890	12 890	–	–	12 772	12 772
Actifs dérivés	591	2 019	–	2 610	1	3 963	–	3 964
Passifs dérivés	(45)	(3 589)	–	(3 634)	(9 071)	(5 634)	–	(14 705)
Placements à court terme	–	96 847	–	96 847	–	70 089	–	70 089
<b>Total</b>	<b>1 221 047</b>	<b>868 244</b>	<b>13 448</b>	<b>2 102 739</b>	<b>723 159</b>	<b>1 207 605</b>	<b>13 115</b>	<b>1 943 879</b>

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

Au cours de la période close le 31 mars 2024, les actions autres que nord-américaines étaient fréquemment transférées entre le niveau 1 (prix non rajustés cotés) et le niveau 2 (prix rajustés). Au 31 mars 2024, ces titres étaient classés dans le niveau 1 (niveau 2 en 2023).

Au cours de la période close le 31 mars 2024, des placements d'une juste valeur de 200 \$ (12 \$ en 2023) 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 les 31 mars 2024 et 2023 :

	31 mars 2024				31 mars 2023			
	Obligations (\$)	Actions (\$)	Fonds privés (\$)	Total (\$)	Obligations (\$)	Actions (\$)	Fonds privés (\$)	Total (\$)
Solde, à l'ouverture	–	343	12 772	13 115	414	417	5 534	6 365
Achats	209	–	233	233	–	–	7 010	7 010
Ventes	–	(26)	–	(26)	(7 084)	–	–	(7 084)
Transferts entrants	–	–	–	200	–	12	–	12
Transferts sortants	–	–	–	–	–	–	–	–
Profits (pertes) au cours de la période :								
Réalisé(e)s	–	14	–	14	(18 125)	–	–	(18 125)
Latent(e)s	(13)	31	(115)	(88)	24 795	(86)	228	24 937
Solde, à la clôture	196	362	12 890	13 448	–	343	12 772	13 115
Variation des profits (pertes) latent(e)s au cours de la période attribuables aux titres détenus à la clôture de la période	(13)	38	(115)	(81)	–	(86)	228	142

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 :

	31 mars 2024	31 mars 2023
	(\$)	(\$)
Gestionnaire	1 324	1 264
Autres fonds gérés par le gestionnaire	1	–
Fonds gérés par des sociétés affiliées au gestionnaire	2	1

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## NOTES ANNEXES

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

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

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

	31 mars 2024			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	2 459	(1 403)	–	1 056
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(2 358)	1 403	3 341	2 386
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	101	–	3 341	3 442

	31 mars 2023			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	1 210	(764)	–	446
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(12 953)	764	23 200	11 011
Obligation pour options vendues	(204)	–	–	(204)
Total	(11 947)	–	23 200	11 253

#### i) Intérêts dans des entités structurées non consolidées

Les détails des placements du Fonds dans des fonds sous-jacents aux 31 mars 2024 et 2023 sont les suivants :

31 mars 2024	% de l'actif net du Fonds sous-jacent	Juste valeur des placements du Fonds (\$)
FNB de revenu à taux variable Mackenzie	1,5	8 802
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	3,2	5 964
Fonds international de dividendes Mackenzie, série R	1,2	6 043
FINB Obligations américaines totales Mackenzie (couvert en \$ CA)	11,4	4 087
Fonds de revenu fixe sans contraintes Mackenzie, série R	0,1	1 536
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,0	4 710
Northleaf Private Credit II LP	1,0	8 554
Sagard Credit Partners II LP	0,7	4 336

31 mars 2023	% de l'actif net du Fonds sous-jacent	Juste valeur des placements du Fonds (\$)
FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	3,0	13 098
Fonds mondial chinois Mackenzie, série R	18,9	5 560
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	3,2	5 933
Fonds international de dividendes Mackenzie, série R	1,5	8 303
FINB Obligations américaines totales Mackenzie (couvert en \$ CA)	14,7	4 158
Fonds de revenu fixe sans contraintes Mackenzie, série R	0,1	1 498
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,6	8 335
FINB TIPS américains Mackenzie (couvert en \$ CA)	2,1	8 283
Northleaf Private Credit II LP	1,1	9 029
Sagard Credit Partners II LP	1,1	3 743

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## NOTES ANNEXES

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

#### j) Engagement

	31 mars 2024		31 mars 2023	
	Montant appelé (\$ US)	Engagement d'investissement total (\$ US)	Montant appelé (\$ US)	Engagement d'investissement total (\$ US)
Northleaf Private Credit II LP <sup>1)</sup>	6 556	8 114	6 459	8 114
Sagard Credit Partners II LP <sup>2)</sup>	2 873	8 114	2 761	8 114

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

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

#### k) Fusion de fonds

La fusion du Mandat privé équilibré de revenu mondial Mackenzie (le « Fonds dissous ») avec le Fonds a eu lieu le 16 juin 2023. Cette fusion a été réalisée avec report d'impôt. Puisque le Fonds dissous investissait la totalité de son actif net dans la série R du Fonds avant la fusion, la fusion a été effectuée en échangeant 8 187 titres de série R contre d'autres titres du Fonds à la juste valeur de marché, ne donnant lieu à aucun transfert d'actif net au Fonds.

Séries du Fonds dissous	Séries du Fonds	Titres émis
Série LF	Série GLF	300
Série LW	Série GW	76
Série O	Série GO	4
Série PW	Série GPW	2 559
Série PWF	Série GF	1 947
Série PWF8	Série GF8	74
Série PWFB	Série GPWFB	320
Série PWT8	Série GPWT8	11
Série PWX	Série GPWX	181
Série PWX8	Série GPWX8	–

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