

# FONDS MONDIAL MACRO 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 mondial macro 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,



Luke Gould

Le chef des finances, Fonds,



Terry Rountes

Le 4 juin 2024

## RAPPORT DE L'AUDITEUR INDÉPENDANT

Aux porteurs de titres du Fonds mondial macro 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 MONDIAL MACRO 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.

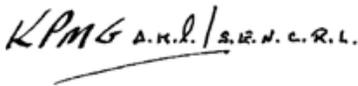
L'assurance raisonnable correspond à un niveau élevé d'assurance, qui ne garantit toutefois pas qu'un audit réalisé conformément aux normes d'audit généralement reconnues du Canada permettra toujours de détecter toute anomalie significative qui pourrait exister.

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.



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

# FONDS MONDIAL MACRO 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
	\$	\$
<b>ACTIF</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements à la juste valeur	41 115	50 520
Trésorerie et équivalents de trésorerie	567 560	397 608
Intérêts courus à recevoir	1	42
Sommes à recevoir pour placements vendus	–	–
Sommes à recevoir pour titres émis	177	83
Marge sur instruments dérivés	49 969	32 090
Actifs dérivés	38 285	33 509
<b>Total de l'actif</b>	<b>697 107</b>	<b>513 852</b>
<b>PASSIF</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Sommes à payer pour placements achetés	1	5
Sommes à payer pour titres rachetés	205	–
Sommes à payer au gestionnaire	5	1
Passifs dérivés	33 970	24 965
<b>Total du passif</b>	<b>34 181</b>	<b>24 971</b>
<b>Actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>662 926</b>	<b>488 881</b>

	Actif net attribuable aux porteurs de titres (note 3)			
	par titre		par série	
	2024	2023	2024	2023
Série A	10,25	9,89	1 925	445
Série F	10,45	10,06	31 307	18 665
Série FB	10,42	10,04	12	1
Série IG	9,90	9,52	426 146	290 331
Série O	10,52	10,11	2 484	746
Série PW	10,32	9,93	5 811	545
Série PWFB	10,45	10,06	30	8
Série PWX	10,51	10,11	392	561
Série R	10,51	10,11	194 819	177 579
			<b>662 926</b>	<b>488 881</b>

## ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

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

	2024	2023
	\$	\$
<b>Revenus</b>		
Dividendes	768	643
Revenus d'intérêts aux fins de distribution	25 521	12 300
Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets		
Profit (perte) net(te) réalisé(e)	45 669	18 124
Profit (perte) net(te) latent(e)	(3 525)	8 374
Revenu tiré du prêt de titres	66	18
Revenu provenant des rabais sur les frais	–	12
<b>Total des revenus (pertes)</b>	<b>68 499</b>	<b>39 471</b>
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	296	116
Frais d'administration	41	16
Intérêts débiteurs	121	108
Commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille	490	234
Frais du comité d'examen indépendant	2	1
Autre	1	1
<b>Charges avant les montants absorbés par le gestionnaire</b>	<b>951</b>	<b>476</b>
Charges absorbées par le gestionnaire	–	–
<b>Charges nettes</b>	<b>951</b>	<b>476</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, avant impôt</b>	<b>67 548</b>	<b>38 995</b>
Charge (économie) d'impôt étranger retenu à la source	108	57
Charge d'impôt étranger sur le résultat (recouvrée)	–	–
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation</b>	<b>67 440</b>	<b>38 938</b>

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation (note 3)			
	par titre		par série	
	2024	2023	2024	2023
Série A	0,78	0,40	79	8
Série F	1,07	0,61	2 288	485
Série FB	0,79	0,67	–	–
Série IG	1,16	0,83	43 005	24 373
Série O	1,12	0,76	111	114
Série PW	0,89	0,76	141	81
Série PWFB	0,95	0,73	–	1
Série PWX	1,27	0,50	57	81
Série R	1,26	0,88	21 759	13 795
			<b>67 440</b>	<b>38 938</b>

# FONDS MONDIAL MACRO 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 F		Série FB		Série IG	
	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>488 881</b>	<b>373 001</b>	<b>445</b>	<b>169</b>	<b>18 665</b>	<b>642</b>	<b>1</b>	<b>1</b>	<b>290 331</b>	<b>263 006</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	67 440	38 938	79	8	2 288	485	–	–	43 005	24 373
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(23 220)	(19 618)	(26)	(9)	(739)	(446)	–	–	(15 083)	(11 911)
Gains en capital	(25 047)	–	(53)	–	(1 110)	–	–	–	(16 255)	–
<b>Total des distributions aux porteurs de titres</b>	<b>(48 267)</b>	<b>(19 618)</b>	<b>(79)</b>	<b>(9)</b>	<b>(1 849)</b>	<b>(446)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(31 338)</b>	<b>(11 911)</b>
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	227 848	142 433	2 186	383	20 089	19 863	11	–	155 230	33 582
Réinvestissement des distributions	44 610	16 778	78	9	1 838	440	–	–	31 338	11 911
Paiements au rachat de titres	(117 586)	(62 651)	(784)	(115)	(9 724)	(2 319)	–	–	(62 420)	(30 630)
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>154 872</b>	<b>96 560</b>	<b>1 480</b>	<b>277</b>	<b>12 203</b>	<b>17 984</b>	<b>11</b>	<b>–</b>	<b>124 148</b>	<b>14 863</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>174 045</b>	<b>115 880</b>	<b>1 480</b>	<b>276</b>	<b>12 642</b>	<b>18 023</b>	<b>11</b>	<b>–</b>	<b>135 815</b>	<b>27 325</b>
<b>À la clôture</b>	<b>662 926</b>	<b>488 881</b>	<b>1 925</b>	<b>445</b>	<b>31 307</b>	<b>18 665</b>	<b>12</b>	<b>1</b>	<b>426 146</b>	<b>290 331</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>										
<b>Titres en circulation, à l'ouverture</b>			<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>
Émis			45	18	1 855	67	–	–	30 508	28 888
Réinvestissement des distributions			211	38	1 897	1 976	1	–	15 666	3 584
Rachetés			8	1	177	44	–	–	3 187	1 256
			(76)	(12)	(933)	(232)	–	–	(6 302)	(3 220)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>			<b>188</b>	<b>45</b>	<b>2 996</b>	<b>1 855</b>	<b>1</b>	<b>–</b>	<b>43 059</b>	<b>30 508</b>

	Série O		Série PW		Série PWFB		Série PWX		Série R	
	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>746</b>	<b>134</b>	<b>545</b>	<b>352</b>	<b>8</b>	<b>7</b>	<b>561</b>	<b>1</b>	<b>177 579</b>	<b>108 689</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	111	114	141	81	–	1	57	81	21 759	13 795
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(51)	(68)	(53)	(20)	–	–	(18)	(41)	(7 250)	(7 123)
Gains en capital	(46)	–	(99)	–	–	–	(18)	–	(7 466)	–
<b>Total des distributions aux porteurs de titres</b>	<b>(97)</b>	<b>(68)</b>	<b>(152)</b>	<b>(20)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(36)</b>	<b>(41)</b>	<b>(14 716)</b>	<b>(7 123)</b>
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	2 304	3 608	5 746	2 507	33	–	91	6 689	42 158	75 801
Réinvestissement des distributions	97	68	152	20	–	–	36	41	11 071	4 289
Paiements au rachat de titres	(677)	(3 110)	(621)	(2 395)	(11)	–	(317)	(6 210)	(43 032)	(17 872)
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>1 724</b>	<b>566</b>	<b>5 277</b>	<b>132</b>	<b>22</b>	<b>–</b>	<b>(190)</b>	<b>520</b>	<b>10 197</b>	<b>62 218</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>1 738</b>	<b>612</b>	<b>5 266</b>	<b>193</b>	<b>22</b>	<b>1</b>	<b>(169)</b>	<b>560</b>	<b>17 240</b>	<b>68 890</b>
<b>À la clôture</b>	<b>2 484</b>	<b>746</b>	<b>5 811</b>	<b>545</b>	<b>30</b>	<b>8</b>	<b>392</b>	<b>561</b>	<b>194 819</b>	<b>177 579</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>										
<b>Titres en circulation, à l'ouverture</b>			<b>Titres</b>	<b>Titres</b>						
Émis			74	14	55	37	1	1	55	–
Réinvestissement des distributions			218	362	553	255	3	–	9	679
Rachetés			9	7	15	2	–	–	3	4
			(65)	(309)	(60)	(239)	(1)	–	(30)	(628)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>			<b>236</b>	<b>74</b>	<b>563</b>	<b>55</b>	<b>3</b>	<b>1</b>	<b>37</b>	<b>55</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS MONDIAL MACRO 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	67 440	38 938
Ajustements pour :		
Perte (profit) net(te) réalisé(e) sur les placements	13 808	3 855
Variation de la perte (du profit) net(te) latent(e) sur les placements	3 525	(8 374)
Distributions en nature reçues de fonds sous-jacents	(268)	–
Achat de placements	(104 757)	(68 029)
Produit de la vente et de l'échéance de placements	101 368	107 450
(Augmentation) diminution des sommes à recevoir et autres actifs	(17 838)	(2 282)
Augmentation (diminution) des sommes à payer et autres passifs	4	1
<b>Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités d'exploitation</b>	<b>63 282</b>	<b>71 559</b>
<b>Flux de trésorerie liés aux activités de financement</b>		
Produit de l'émission de titres	227 120	142 319
Paiements au rachat de titres	(116 747)	(62 620)
Distributions versées, déduction faite des réinvestissements	(3 657)	(2 840)
<b>Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités de financement</b>	<b>106 716</b>	<b>76 859</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>	<b>169 998</b>	<b>148 418</b>
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à l'ouverture	397 608	248 847
Incidence des fluctuations des taux de change sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie	(46)	343
<b>Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture</b>	<b>567 560</b>	<b>397 608</b>
Trésorerie	2 912	2 769
Équivalents de trésorerie	564 648	394 839
<b>Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture</b>	<b>567 560</b>	<b>397 608</b>
<b>Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :</b>		
Dividendes reçus	768	643
Impôts étrangers payés	108	57
Intérêts reçus	25 562	12 272
Intérêts versés	121	108

# FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS

au 31 mars 2024

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OPTIONS</b>					
Options achetées (se reporter au tableau des options achetées)				11 888	7 290
<b>Total des options</b>				<b>11 888</b>	<b>7 290</b>
<b>FONDS/BILLETS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>					
iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	15 500	2 267	2 286
iShares TIPS Bond ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	26 400	3 811	3 840
SPDR Bloomberg High Yield Bond ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	39 100	4 924	5 041
SPDR S&P Oil & Gas Exploration & Production ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	75 300	14 054	15 800
<b>Total des fonds/billets négociés en bourse</b>				<b>25 056</b>	<b>26 967</b>
<b>FONDS COMMUNS DE PLACEMENT</b>					
<sup>1</sup> Fonds de lingots d'or Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	290 057	5 345	6 858
<b>Total des fonds communs de placement</b>				<b>5 345</b>	<b>6 858</b>
Coûts de transaction				(55)	–
<b>Total des placements</b>				<b>42 234</b>	<b>41 115</b>
Instruments dérivés (se reporter au tableau des instruments dérivés)					
<sup>2</sup> Trésorerie et équivalents de trésorerie					4 315
Autres éléments d'actif moins le passif					567 560
<b>Actif net attribuable aux porteurs de titres</b>					<b>49 936</b>
					<b>662 926</b>

<sup>1</sup> Ce fonds est géré par Mackenzie.

<sup>2</sup> Comprend 525 525 \$ détenus dans le Fonds du marché monétaire canadien Mackenzie, série R, un fonds géré par Mackenzie.

# FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## APERÇU DU PORTEFEUILLE

31 MARS 2024

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Autres éléments d'actif (de passif)	(14,1)	83,8	69,7
Obligations	59,2	(44,2)	15,0
<i>Contrats à terme standardisés</i>	57,5	(44,2)	13,3
<i>Obligations</i>	1,7	–	1,7
Actions	52,8	(38,9)	13,9
<i>Contrats à terme standardisés</i>	49,3	(38,9)	10,4
<i>Actions</i>	2,4	–	2,4
<i>Options achetées</i>	1,1	–	1,1
Marchandises	3,0	(1,8)	1,2
<i>Marchandises</i>	1,0	–	1,0
<i>Contrats à terme standardisés</i>	2,0	(1,8)	0,2
Swaps	0,2	–	0,2
Trésorerie et équivalents de trésorerie*	–	–	–

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Autres éléments d'actif (de passif)	(14,1)	83,8	69,7
Royaume-Uni	11,0	–	11,0
États-Unis	34,1	(26,9)	7,2
Italie	3,8	–	3,8
Japon	3,4	–	3,4
Taiwan	3,3	–	3,3
Singapour	2,4	–	2,4
Espagne	2,1	–	2,1
Suisse	1,8	–	1,8
Pologne	1,7	–	1,7
Afrique du Sud	1,5	–	1,5
Allemagne	1,3	–	1,3
Canada	40,0	(40,0)	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie*	–	–	–
Mexique	–	(0,2)	(0,2)
Australie	6,7	(7,1)	(0,4)
Suède	–	(0,7)	(0,7)
Autre	2,1	(2,8)	(0,7)
Chine	–	(2,1)	(2,1)
France	–	(2,3)	(2,3)
Thaïlande	–	(2,8)	(2,8)

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Autres éléments d'actif (de passif)	(14,1)	83,8	69,7
Contrats à terme standardisés sur actions	49,3	(38,9)	10,4
Obligations d'État étrangères	17,5	(10,0)	7,5
Obligations fédérales	40,6	(34,2)	6,4
Énergie	2,4	–	2,4
Autre	1,3	–	1,3
Obligations de sociétés	1,1	–	1,1
Marchandises	1,0	–	1,0
Contrats à terme standardisés sur marchandises	2,0	(1,8)	0,2
Trésorerie et équivalents de trésorerie*	–	–	–

31 MARS 2023

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Autres éléments d'actif (de passif)	10,1	75,9	86,0
Trésorerie et placements à court terme*	41,1	–	41,1
Marchandises	6,5	(1,9)	4,6
<i>Marchandises</i>	5,1	–	5,1
<i>Contrats à terme standardisés</i>	1,4	(1,9)	(0,5)
Swaps	–	–	–
Actions	16,1	(17,6)	(1,5)
<i>Actions</i>	3,6	–	3,6
<i>Options achetées</i>	1,6	–	1,6
<i>Contrats à terme standardisés</i>	10,9	(17,6)	(6,7)
Obligations	28,4	(58,6)	(30,2)
<i>Obligations</i>	21,6	–	21,6
<i>Contrats à terme standardisés</i>	6,8	(58,6)	(51,8)

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Autres éléments d'actif (de passif)	10,1	75,9	86,0
Trésorerie et placements à court terme*	41,1	–	41,1
Canada	21,6	(7,6)	14,0
Australie	7,4	–	7,4
États-Unis	15,5	(12,0)	3,5
Afrique du Sud	1,5	–	1,5
Italie	1,5	–	1,5
Espagne	0,9	–	0,9
France	0,1	–	0,1
Suède	–	(0,3)	(0,3)
Chine	–	(0,4)	(0,4)
Suisse	–	(1,5)	(1,5)
Mexique	–	(1,6)	(1,6)
Royaume-Uni	–	(2,3)	(2,3)
Allemagne	0,6	(9,5)	(8,9)
Autre	1,9	(11,3)	(9,4)
Japon	–	(31,6)	(31,6)

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Autres éléments d'actif (de passif)	10,1	75,9	86,0
Trésorerie et placements à court terme*	41,1	–	41,1
Obligations de sociétés	20,1	–	20,1
Marchandises	5,1	–	5,1
Énergie	3,6	–	3,6
Autre	1,6	–	1,6
Obligations provinciales	1,1	–	1,1
Obligations fédérales	0,4	–	0,4
Contrats à terme standardisés sur marchandises	1,4	(1,9)	(0,5)
Contrats à terme standardisés sur actions	10,9	(17,6)	(6,7)
Obligations – Contrats à terme standardisés	6,8	(58,6)	(51,8)

\* Une portion de la répartition effective de la trésorerie du Fonds est investie dans des titres de série R d'un fonds du marché monétaire géré par Mackenzie. La répartition effective présente l'exposition du Fonds par portefeuille, région ou secteur calculée en combinant les placements directs et indirects du Fonds.

# FONDS MONDIAL MACRO 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 S&P 500	274	Vente	20 décembre 2024	4 300,00 USD	5 249	1 868
Indice S&P 500	300	Vente	21 mars 2025	4 800,00 USD	6 639	5 422
<b>Total des options</b>					<b>11 888</b>	<b>7 290</b>

# FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS

au 31 mars 2024

### Tableau des contrats de swap

Note de crédit de la contrepartie	Nombre de contrats	Échéance	Rendement payé par le Fonds, en fonction de	Rendement reçu par le Fonds, en fonction de	Montant notionnel (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	259 900	22 avril 2024	Indice sur mesure RBC Commodity majoré de 0,68 %	Trésorerie	66 381	1 156	–
<b>Total des contrats de swap</b>					<b>66 381</b>	<b>1 156</b>	<b>–</b>

### 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 le gazole à faible teneur en soufre, avril 2024	9	11 avril 2024	823,28 USD	996	–	(4)
Contrats à terme standardisés sur l'indice CAC 40 (10 euros), avril 2024	(125)	19 avril 2024	8 085,10 EUR	(15 018)	–	(316)
Contrats à terme standardisés sur l'indice IBEX 35, avril 2024	80	19 avril 2024	10 280,50 EUR	12 935	919	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice OMXS30, avril 2024	(139)	19 avril 2024	2 469,20 SEK	(4 442)	–	(108)
Contrats à terme standardisés sur le gaz naturel, mai 2024	9	26 avril 2024	1,79 USD	215	–	(3)
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE China A50, avril 2024	(849)	29 avril 2024	12 133,22 USD	(13 935)	–	(20)
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE Taiwan, avril 2024	232	29 avril 2024	1 723,25 USD	21 679	22	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice MSCI Singapore, avril 2024	544	29 avril 2024	290,70 SGD	15 871	8	–
Contrats à terme standardisés sur le pétrole brut Brent, juin 2024	17	30 avril 2024	85,87 USD	2 003	22	–
Contrats à terme standardisés sur le carburant diesel à très faible teneur en soufre au port de New York, mai 2024	(1)	30 avril 2024	261,64 USD	(149)	–	–
Contrats à terme standardisés sur l'essence RBOB, mai 2024	(9)	30 avril 2024	272,83 USD	(1 393)	4	–
Contrats à terme standardisés sur le sucre n° 11 (monde), mai 2024	25	30 avril 2024	21,64 USD	854	33	–
Contrats à terme standardisés sur le maïs, mai 2024	(5)	14 mai 2024	435,95 USD	(150)	–	(1)
Contrats à terme standardisés sur le blé RVH de KC, mai 2024	28	14 mai 2024	585,78 USD	1 110	–	(2)
Contrats à terme standardisés sur le soja, mai 2024	(1)	14 mai 2024	1 185,44 USD	(81)	–	–
Contrats à terme standardisés sur la farine de soja, mai 2024	27	14 mai 2024	334,56 USD	1 235	15	–
Contrats à terme standardisés sur le blé (CBT), mai 2024	44	14 mai 2024	579,23 USD	1 669	–	(57)
Contrats à terme standardisés sur euro-obligations, juin 2024	6	6 juin 2024	132,71 EUR	1 169	12	–
Contrats à terme standardisés libellés en yens sur l'indice Nikkei 225, juin 2024	122	13 juin 2024	39 381,67 JPY	22 026	538	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor australien à 10 ans, juin 2024	427	17 juin 2024	116,00 AUD	43 933	162	–
Contrats à terme standardisés sur l'aluminium LME, juin 2024	24	17 juin 2024	2 268,62 USD	1 897	54	–
Contrats à terme standardisés sur le cuivre LME, juin 2024	(31)	17 juin 2024	8 788,92 USD	(9 298)	–	(118)
Contrats à terme standardisés sur le plomb LME, juin 2024	(3)	17 juin 2024	2 137,68 USD	(208)	9	–
Contrats à terme standardisés sur le zinc LME, juin 2024	(3)	17 juin 2024	2 562,99 USD	(247)	13	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor américain à 10 ans, juin 2024	(439)	18 juin 2024	110,33 USD	(65 872)	–	(383)
Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 10 ans, juin 2024	(1 881)	19 juin 2024	120,26 CAD	(226 360)	22	–
Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 2 ans, juin 2024	2 574	19 juin 2024	103,26 CAD	265 341	–	(646)
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE/JSE Top 40, juin 2024	197	20 juin 2024	66 181,75 ZAR	9 709	387	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice S&P/TSX 60, juin 2024	(143)	20 juin 2024	1 322,04 CAD	(38 364)	–	(550)
Contrats à terme standardisés sur l'indice SPI 200, juin 2024	(258)	20 juin 2024	7 740,76 AUD	(45 263)	–	(1 196)
Contrats à terme standardisés sur l'indice CME E-mini Standard & Poor's 500, juin 2024	128	21 juin 2024	5 210,54 USD	46 011	978	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice DAX, juin 2024	10	21 juin 2024	18 130,25 EUR	6 858	234	–

# FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 31 mars 2024

Tableau des contrats à terme standardisés (suite)

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 l'indice E-mini Communication Services Select Sector, juin 2024	79	21 juin 2024	421,60 USD	11 564	288	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Consumer Discretionary Select Sector, juin 2024	42	21 juin 2024	1 844,90 USD	10 698	204	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Consumer Staples Select Sector, juin 2024	166	21 juin 2024	771,70 USD	17 497	150	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Energy Select Sector, juin 2024	(79)	21 juin 2024	950,89 USD	(10 703)	–	(693)
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Financials Select Sector, juin 2024	84	21 juin 2024	509,54 USD	14 949	402	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Health Care Select Sector, juin 2024	208	21 juin 2024	1 489,58 USD	42 572	587	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Industrials Select Sector, juin 2024	(26)	21 juin 2024	1 240,68 USD	(4 524)	–	(139)
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Information Technology Select Sector, juin 2024	12	21 juin 2024	2 134,02 USD	3 456	–	(12)
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini NASDAQ 100, juin 2024	(3)	21 juin 2024	18 369,44 USD	(1 501)	24	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Real Estate Select Sector, juin 2024	314	21 juin 2024	194,03 USD	20 763	127	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Russell 2000, juin 2024	105	21 juin 2024	2 083,31 USD	15 257	255	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini S&P Materials Select Sector, juin 2024	(486)	21 juin 2024	964,93 USD	(65 574)	–	(2 080)
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-mini Utilities Select Sector, juin 2024	(284)	21 juin 2024	648,05 USD	(25 719)	–	(850)
Contrats à terme standardisés sur l'indice Euro STOXX 50, juin 2024	(90)	21 juin 2024	4 917,80 EUR	(6 638)	–	(152)
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE 100, juin 2024	10	21 juin 2024	7 848,02 GBP	1 367	54	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE/MIB 100, juin 2024	99	21 juin 2024	33 137,68 EUR	24 747	607	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice Bolsa Mexicana, juin 2024	(26)	21 juin 2024	57 674,31 MXN	(1 231)	–	(10)
Contrats à terme standardisés sur l'indice POLAND WIG 20, juin 2024	676	21 juin 2024	2 382,74 PLN	11 144	217	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice Swiss Market, juin 2024	67	21 juin 2024	11 533,91 CHF	11 708	133	–
Contrats à terme standardisés sur l'or, 100 oz, juin 2024	5	26 juin 2024	2 133,68 USD	1 516	51	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du Royaume-Uni, juin 2024	409	26 juin 2024	98,49 GBP	69 873	1 161	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice SET50, juin 2024	(3 019)	27 juin 2024	837,14 THB	(18 679)	86	–
Contrats à terme standardisés sur le coton n° 2, juillet 2024	7	9 juillet 2024	94,58 USD	436	–	(12)
Contrats à terme standardisés sur l'huile de soja, juillet 2024	(29)	12 juillet 2024	47,18 USD	(1 142)	–	(6)
Contrats à terme standardisés sur le pétrole brut WTI, décembre 2024	8	20 novembre 2024	75,47 USD	843	31	–
<b>Total des contrats à terme standardisés</b>				<b>157 410</b>	<b>7 809</b>	<b>(7 358)</b>

\* Le montant notionnel représente l'exposition aux instruments sous-jacents au 31 mars 2024.

# FONDS MONDIAL MACRO 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

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	11 010	AUD	(7 238)	USD	22 avril 2024	9 802	9 723	–	(79)
A	386	USD	(587)	AUD	22 avril 2024	(523)	(519)	4	–
A	618	AUD	(406)	USD	22 avril 2024	550	545	–	(5)
A	252	AUD	(166)	USD	22 avril 2024	225	222	–	(3)
A	319	USD	(489)	AUD	22 avril 2024	(432)	(431)	1	–
A	811	USD	(1 252)	AUD	22 avril 2024	(1 098)	(1 106)	–	(8)
A	6 640	USD	(10 128)	AUD	22 avril 2024	(8 993)	(8 943)	50	–
A	2 975	AUD	(1 951)	USD	22 avril 2024	2 642	2 627	–	(15)
A	5 352	USD	(8 196)	AUD	22 avril 2024	(7 248)	(7 237)	11	–
A	1 139	AUD	(753)	USD	22 avril 2024	1 020	1 006	–	(14)
A	4 049	USD	(6 196)	AUD	22 avril 2024	(5 483)	(5 471)	12	–
A	3 481	AUD	(2 277)	USD	22 avril 2024	3 084	3 074	–	(10)
A	42 664	BRL	(8 535)	USD	22 avril 2024	11 559	11 496	–	(63)
A	53 642	BRL	(10 731)	USD	22 avril 2024	14 533	14 455	–	(78)
A	17 226	BRL	(3 433)	USD	22 avril 2024	4 649	4 642	–	(7)
A	298	USD	(1 496)	BRL	22 avril 2024	(404)	(403)	1	–
A	4 278	BRL	(857)	USD	22 avril 2024	1 160	1 153	–	(7)
A	4 832	BRL	(964)	USD	22 avril 2024	1 305	1 302	–	(3)
A	1 004	USD	(4 999)	BRL	22 avril 2024	(1 360)	(1 346)	14	–
A	1 141	BRL	(230)	USD	22 avril 2024	311	308	–	(3)
A	833	BRL	(168)	USD	22 avril 2024	227	224	–	(3)
A	4 655	BRL	(932)	USD	22 avril 2024	1 262	1 255	–	(7)
A	16 800	BRL	(3 336)	USD	22 avril 2024	4 518	4 527	9	–
A	6 528	BRL	(1 306)	USD	22 avril 2024	1 769	1 759	–	(10)
A	7 764	USD	(10 482)	CAD	22 avril 2024	10 482	10 513	31	–
A	4 591	USD	(6 199)	CAD	22 avril 2024	6 199	6 218	19	–
A	4 680	USD	(6 302)	CAD	22 avril 2024	6 303	6 338	35	–
A	410	USD	(550)	CAD	22 avril 2024	550	555	5	–
A	616	USD	(832)	CAD	22 avril 2024	832	834	2	–
A	117	USD	(159)	CAD	22 avril 2024	159	159	–	–
A	381	USD	(514)	CAD	22 avril 2024	514	516	2	–
A	1 094	USD	(1 479)	CAD	22 avril 2024	1 479	1 483	4	–
A	8 425	USD	(11 425)	CAD	22 avril 2024	11 426	11 410	–	(16)
A	831	USD	(1 121)	CAD	22 avril 2024	1 121	1 125	4	–
A	9 778	CAD	(7 205)	USD	22 avril 2024	(9 779)	(9 757)	22	–
A	3 032	CAD	(2 235)	USD	22 avril 2024	(3 033)	(3 028)	5	–
A	2 616 266	CLP	(2 840)	USD	22 avril 2024	3 846	3 612	–	(234)
A	1 442 556	CLP	(1 574)	USD	22 avril 2024	2 131	1 992	–	(139)
A	582	USD	(547 143)	CLP	22 avril 2024	(788)	(755)	33	–
A	783 581	CLP	(823)	USD	22 avril 2024	1 114	1 082	–	(32)
A	526 123	CLP	(541)	USD	22 avril 2024	732	727	–	(5)
A	297 178	CLP	(304)	USD	22 avril 2024	412	410	–	(2)
A	78	USD	(77 140)	CLP	22 avril 2024	(106)	(106)	–	–
A	585	USD	(573 425)	CLP	22 avril 2024	(792)	(792)	–	–
A	2 250 703	CLP	(2 338)	USD	22 avril 2024	3 166	3 108	–	(58)
A	2 307	USD	(2 233 679)	CLP	22 avril 2024	(3 124)	(3 085)	39	–
A	3 691 058	CLP	(3 747)	USD	22 avril 2024	5 074	5 097	23	–
A	10 916	USD	(78 366)	CNY	22 avril 2024	(14 783)	(14 652)	131	–
A	3 538	CNY	(493)	USD	22 avril 2024	667	661	–	(6)
A	3 154	USD	(22 505)	CNY	22 avril 2024	(4 271)	(4 207)	64	–

# FONDS MONDIAL MACRO 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	717 USD	(5 128) CNY	22 avril 2024	(971)	(959)	12	–
A	128 USD	(920) CNY	22 avril 2024	(174)	(172)	2	–
A	556 USD	(4 004) CNY	22 avril 2024	(753)	(749)	4	–
A	28 460 CNY	(3 967) USD	22 avril 2024	5 373	5 321	–	(52)
A	3 172 USD	(22 793) CNY	22 avril 2024	(4 296)	(4 262)	34	–
A	194 USD	(1 396) CNY	22 avril 2024	(263)	(261)	2	–
A	2 295 CNY	(320) USD	22 avril 2024	434	429	–	(5)
A	6 855 USD	(49 338) CNY	22 avril 2024	(9 283)	(9 224)	59	–
A	6 931 USD	(50 185) CNY	22 avril 2024	(9 387)	(9 383)	4	–
A	40 759 387 COP	(10 202) USD	22 avril 2024	13 817	14 239	422	–
A	68 228 841 COP	(17 078) USD	22 avril 2024	23 128	23 835	707	–
A	27 459 837 COP	(6 866) USD	22 avril 2024	9 299	9 592	293	–
A	2 992 233 COP	(751) USD	22 avril 2024	1 017	1 045	28	–
A	7 019 298 COP	(1 751) USD	22 avril 2024	2 372	2 452	80	–
A	1 277 469 COP	(320) USD	22 avril 2024	434	446	12	–
A	2 486 USD	(9 873 875) COP	22 avril 2024	(3 367)	(3 450)	–	(83)
A	1 242 601 COP	(313) USD	22 avril 2024	424	434	10	–
A	7 590 USD	(30 182 774) COP	22 avril 2024	(10 279)	(10 544)	–	(265)
A	6 409 397 COP	(1 626) USD	22 avril 2024	2 202	2 239	37	–
A	7 333 225 COP	(1 873) USD	22 avril 2024	2 536	2 561	25	–
A	6 056 923 COP	(1 562) USD	22 avril 2024	2 116	2 116	–	–
A	6 460 USD	(147 939) CZK	22 avril 2024	(8 749)	(8 542)	207	–
A	6 764 USD	(154 899) CZK	22 avril 2024	(9 160)	(8 944)	216	–
A	3 310 USD	(76 105) CZK	22 avril 2024	(4 483)	(4 394)	89	–
A	327 USD	(7 491) CZK	22 avril 2024	(443)	(432)	11	–
A	9 327 CZK	(402) USD	22 avril 2024	544	539	–	(5)
A	234 USD	(5 539) CZK	22 avril 2024	(317)	(320)	–	(3)
A	508 USD	(11 920) CZK	22 avril 2024	(688)	(688)	–	–
A	5 539 CZK	(237) USD	22 avril 2024	321	320	–	(1)
A	51 838 CZK	(2 223) USD	22 avril 2024	3 011	2 993	–	(18)
A	176 USD	(4 073) CZK	22 avril 2024	(238)	(235)	3	–
A	2 739 USD	(63 766) CZK	22 avril 2024	(3 709)	(3 681)	28	–
A	2 222 CZK	(95) USD	22 avril 2024	129	129	–	–
A	9 994 USD	(9 178) EUR	22 avril 2024	(13 535)	(13 420)	115	–
A	665 EUR	(723) USD	22 avril 2024	979	972	–	(7)
A	1 145 USD	(1 053) EUR	22 avril 2024	(1 550)	(1 539)	11	–
A	3 383 EUR	(3 646) USD	22 avril 2024	4 938	4 947	9	–
A	2 550 EUR	(2 741) USD	22 avril 2024	3 712	3 729	17	–
A	7 186 EUR	(7 786) USD	22 avril 2024	10 545	10 508	–	(37)
A	1 061 EUR	(1 153) USD	22 avril 2024	1 562	1 551	–	(11)
A	3 693 EUR	(4 023) USD	22 avril 2024	5 448	5 401	–	(47)
A	5 463 USD	(4 996) EUR	22 avril 2024	(7 399)	(7 306)	93	–
A	3 333 EUR	(3 624) USD	22 avril 2024	4 908	4 874	–	(34)
A	34 EUR	(37) USD	22 avril 2024	50	50	–	–
A	5 678 USD	(4 478) GBP	22 avril 2024	(7 689)	(7 656)	33	–
A	4 185 USD	(3 301) GBP	22 avril 2024	(5 667)	(5 642)	25	–
A	1 922 GBP	(2 436) USD	22 avril 2024	3 299	3 286	–	(13)
A	163 USD	(129) GBP	22 avril 2024	(221)	(220)	1	–
A	1 432 GBP	(1 802) USD	22 avril 2024	2 441	2 449	8	–
A	446 USD	(354) GBP	22 avril 2024	(604)	(605)	–	(1)

# FONDS MONDIAL MACRO 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	6 436 USD	(5 097) GBP	22 avril 2024	(8 716)	(8 713)	3	–
A	2 233 GBP	(2 834) USD	22 avril 2024	3 838	3 818	–	(20)
A	6 817 GBP	(8 681) USD	22 avril 2024	11 757	11 652	–	(105)
A	775 USD	(606) GBP	22 avril 2024	(1 049)	(1 035)	14	–
A	2 628 GBP	(3 341) USD	22 avril 2024	4 525	4 492	–	(33)
A	135 GBP	(171) USD	22 avril 2024	231	231	–	–
A	160 195 914 IDR	(10 242) USD	22 avril 2024	13 870	13 663	–	(207)
A	69 120 400 IDR	(4 419) USD	22 avril 2024	5 985	5 895	–	(90)
A	39 847 120 IDR	(2 530) USD	22 avril 2024	3 426	3 398	–	(28)
A	25 331 716 IDR	(1 600) USD	22 avril 2024	2 167	2 161	–	(6)
A	13 505 698 IDR	(857) USD	22 avril 2024	1 160	1 152	–	(8)
A	17 882 434 IDR	(1 141) USD	22 avril 2024	1 545	1 525	–	(20)
A	17 427 996 IDR	(1 116) USD	22 avril 2024	1 512	1 487	–	(25)
A	273 USD	(4 279 696) IDR	22 avril 2024	(370)	(365)	5	–
A	2 039 USD	(32 141 661) IDR	22 avril 2024	(2 762)	(2 742)	20	–
A	39 719 908 IDR	(2 554) USD	22 avril 2024	3 459	3 388	–	(71)
A	26 419 221 IDR	(1 677) USD	22 avril 2024	2 271	2 253	–	(18)
A	35 270 029 IDR	(2 227) USD	22 avril 2024	3 016	3 008	–	(8)
A	7 358 USD	(27 576) ILS	22 avril 2024	(9 965)	(10 173)	–	(208)
A	7 222 USD	(27 064) ILS	22 avril 2024	(9 780)	(9 985)	–	(205)
A	3 945 ILS	(1 054) USD	22 avril 2024	1 428	1 456	28	–
A	1 618 ILS	(443) USD	22 avril 2024	600	597	–	(3)
A	930 USD	(3 383) ILS	22 avril 2024	(1 260)	(1 248)	12	–
A	3 463 ILS	(945) USD	22 avril 2024	1 280	1 277	–	(3)
A	16 014 ILS	(4 414) USD	22 avril 2024	5 978	5 908	–	(70)
A	475 ILS	(132) USD	22 avril 2024	179	176	–	(3)
A	1 641 USD	(5 879) ILS	22 avril 2024	(2 223)	(2 169)	54	–
A	2 218 USD	(8 117) ILS	22 avril 2024	(3 004)	(2 994)	10	–
A	127 USD	(466) ILS	22 avril 2024	(172)	(172)	–	–
A	2 322 USD	(8 499) ILS	22 avril 2024	(3 144)	(3 135)	9	–
A	301 592 INR	(3 612) USD	22 avril 2024	4 892	4 897	5	–
A	164 004 INR	(1 965) USD	22 avril 2024	2 661	2 663	2	–
A	19 358 INR	(232) USD	22 avril 2024	314	314	–	–
A	176 USD	(14 726) INR	22 avril 2024	(239)	(239)	–	–
A	38 614 INR	(464) USD	22 avril 2024	628	627	–	(1)
A	1 507 USD	(125 225) INR	22 avril 2024	(2 041)	(2 034)	7	–
A	333 USD	(27 646) INR	22 avril 2024	(451)	(449)	2	–
A	48 633 INR	(586) USD	22 avril 2024	793	789	–	(4)
A	712 USD	(58 990) INR	22 avril 2024	(964)	(958)	6	–
A	60 277 INR	(725) USD	22 avril 2024	982	978	–	(4)
A	53 619 INR	(643) USD	22 avril 2024	871	871	–	–
A	5 345 USD	(781 234) JPY	22 avril 2024	(7 238)	(7 013)	225	–
A	1 425 127 JPY	(9 749) USD	22 avril 2024	13 203	12 792	–	(411)
A	425 442 JPY	(2 905) USD	22 avril 2024	3 934	3 819	–	(115)
A	37 421 JPY	(256) USD	22 avril 2024	347	336	–	(11)
A	105 315 JPY	(719) USD	22 avril 2024	974	945	–	(29)
A	660 USD	(98 381) JPY	22 avril 2024	(894)	(883)	11	–
A	345 USD	(51 447) JPY	22 avril 2024	(467)	(462)	5	–
A	173 288 JPY	(1 162) USD	22 avril 2024	1 573	1 555	–	(18)
A	6 009 USD	(894 900) JPY	22 avril 2024	(8 138)	(8 033)	105	–

# FONDS MONDIAL MACRO 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	1 811 473 JPY	(12 340) USD	22 avril 2024	16 712	16 260	–	(452)
A	2 928 USD	(439 338) JPY	22 avril 2024	(3 966)	(3 943)	23	–
A	8 636 USD	(1 304 145) JPY	22 avril 2024	(11 696)	(11 706)	–	(10)
A	3 885 USD	(5 181 924) KOR	22 avril 2024	(5 261)	(5 206)	55	–
A	2 627 USD	(3 504 492) KOR	22 avril 2024	(3 558)	(3 521)	37	–
A	2 541 USD	(3 387 027) KOR	22 avril 2024	(3 441)	(3 402)	39	–
A	467 USD	(619 384) KOR	22 avril 2024	(632)	(622)	10	–
A	770 992 KOR	(583) USD	22 avril 2024	790	775	–	(15)
A	853 USD	(1 138 344) KOR	22 avril 2024	(1 155)	(1 144)	11	–
A	346 USD	(459 419) KOR	22 avril 2024	(469)	(461)	8	–
A	716 USD	(950 830) KOR	22 avril 2024	(969)	(955)	14	–
A	210 USD	(279 674) KOR	22 avril 2024	(284)	(281)	3	–
A	1 774 405 KOR	(1 355) USD	22 avril 2024	1 835	1 783	–	(52)
A	2 782 USD	(3 718 091) KOR	22 avril 2024	(3 767)	(3 735)	32	–
A	165 USD	(222 237) KOR	22 avril 2024	(224)	(223)	1	–
A	72 381 MXN	(4 148) USD	22 avril 2024	5 617	5 875	258	–
A	147 829 MXN	(8 472) USD	22 avril 2024	11 473	12 000	527	–
A	51 616 MXN	(2 930) USD	22 avril 2024	3 968	4 190	222	–
A	14 253 MXN	(818) USD	22 avril 2024	1 108	1 157	49	–
A	3 009 USD	(51 935) MXN	22 avril 2024	(4 075)	(4 216)	–	(141)
A	2 206 USD	(38 365) MXN	22 avril 2024	(2 987)	(3 114)	–	(127)
A	5 547 USD	(95 854) MXN	22 avril 2024	(7 512)	(7 781)	–	(269)
A	4 663 MXN	(271) USD	22 avril 2024	367	378	11	–
A	102 055 MXN	(5 994) USD	22 avril 2024	8 118	8 285	167	–
A	1 616 USD	(27 369) MXN	22 avril 2024	(2 189)	(2 222)	–	(33)
A	18 393 MXN	(1 087) USD	22 avril 2024	1 472	1 493	21	–
A	17 230 MXN	(1 029) USD	22 avril 2024	1 394	1 399	5	–
A	197 901 NOK	(18 817) USD	22 avril 2024	25 484	24 698	–	(786)
A	13 823 USD	(145 378) NOK	22 avril 2024	(18 720)	(18 142)	578	–
A	8 458 NOK	(805) USD	22 avril 2024	1 090	1 056	–	(34)
A	1 296 USD	(13 547) NOK	22 avril 2024	(1 755)	(1 691)	64	–
A	1 472 USD	(15 647) NOK	22 avril 2024	(1 994)	(1 953)	41	–
A	1 177 USD	(12 528) NOK	22 avril 2024	(1 594)	(1 563)	31	–
A	66 988 NOK	(6 381) USD	22 avril 2024	8 641	8 360	–	(281)
A	2 417 USD	(25 414) NOK	22 avril 2024	(3 273)	(3 171)	102	–
A	89 730 NOK	(8 523) USD	22 avril 2024	11 542	11 198	–	(344)
A	1 034 USD	(10 876) NOK	22 avril 2024	(1 400)	(1 357)	43	–
A	8 635 USD	(92 003) NOK	22 avril 2024	(11 694)	(11 482)	212	–
A	9 085 USD	(97 436) NOK	22 avril 2024	(12 304)	(12 159)	145	–
A	10 520 USD	(17 236) NZD	22 avril 2024	(14 247)	(13 945)	302	–
A	11 412 NZD	(6 965) USD	22 avril 2024	9 432	9 232	–	(200)
A	7 326 USD	(12 063) NZD	22 avril 2024	(9 922)	(9 759)	163	–
A	3 904 NZD	(2 387) USD	22 avril 2024	3 233	3 158	–	(75)
A	4 231 USD	(6 975) NZD	22 avril 2024	(5 730)	(5 644)	86	–
A	2 416 NZD	(1 464) USD	22 avril 2024	1 983	1 954	–	(29)
A	26 165 NZD	(16 181) USD	22 avril 2024	21 913	21 169	–	(744)
A	277 NZD	(171) USD	22 avril 2024	231	224	–	(7)
A	1 315 USD	(2 156) NZD	22 avril 2024	(1 781)	(1 744)	37	–
A	4 580 USD	(7 448) NZD	22 avril 2024	(6 202)	(6 026)	176	–
A	2 592 USD	(4 285) NZD	22 avril 2024	(3 510)	(3 467)	43	–

# FONDS MONDIAL MACRO 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	2 576 USD	(4 286) NZD	22 avril 2024	(3 489)	(3 468)	21	–
A	3 747 USD	(209 479) PHP	22 avril 2024	(5 075)	(5 046)	29	–
A	7 218 USD	(403 495) PHP	22 avril 2024	(9 775)	(9 720)	55	–
A	1 934 USD	(109 017) PHP	22 avril 2024	(2 619)	(2 626)	–	(7)
A	529 USD	(29 864) PHP	22 avril 2024	(717)	(720)	–	(3)
A	404 USD	(22 711) PHP	22 avril 2024	(547)	(547)	–	–
A	1 775 USD	(99 887) PHP	22 avril 2024	(2 404)	(2 406)	–	(2)
A	2 537 USD	(141 614) PHP	22 avril 2024	(3 436)	(3 412)	24	–
A	3 600 USD	(201 998) PHP	22 avril 2024	(4 875)	(4 866)	9	–
A	1 526 USD	(85 384) PHP	22 avril 2024	(2 066)	(2 057)	9	–
A	1 147 USD	(63 625) PHP	22 avril 2024	(1 554)	(1 533)	21	–
A	708 USD	(39 601) PHP	22 avril 2024	(959)	(954)	5	–
A	2 568 USD	(144 525) PHP	22 avril 2024	(3 478)	(3 481)	–	(3)
A	11 846 PLN	(2 924) USD	22 avril 2024	3 960	4 016	56	–
A	27 375 PLN	(6 757) USD	22 avril 2024	9 151	9 280	129	–
A	5 675 PLN	(1 399) USD	22 avril 2024	1 895	1 924	29	–
A	1 424 PLN	(354) USD	22 avril 2024	479	483	4	–
A	1 229 USD	(4 978) PLN	22 avril 2024	(1 665)	(1 688)	–	(23)
A	48 PLN	(12) USD	22 avril 2024	16	16	–	–
A	1 722 PLN	(430) USD	22 avril 2024	583	584	1	–
A	24 PLN	(6) USD	22 avril 2024	8	8	–	–
A	6 528 PLN	(1 644) USD	22 avril 2024	2 227	2 213	–	(14)
A	3 174 USD	(12 470) PLN	22 avril 2024	(4 299)	(4 227)	72	–
A	1 265 PLN	(318) USD	22 avril 2024	431	429	–	(2)
A	859 USD	(3 417) PLN	22 avril 2024	(1 163)	(1 159)	4	–
A	5 794 USD	(60 598) SEK	22 avril 2024	(7 847)	(7 673)	174	–
A	132 510 SEK	(12 671) USD	22 avril 2024	17 160	16 779	–	(381)
A	282 USD	(2 952) SEK	22 avril 2024	(382)	(374)	8	–
A	7 501 SEK	(721) USD	22 avril 2024	976	950	–	(26)
A	1 407 USD	(14 815) SEK	22 avril 2024	(1 905)	(1 875)	30	–
A	14 635 SEK	(1 387) USD	22 avril 2024	1 879	1 854	–	(25)
A	37 903 SEK	(3 676) USD	22 avril 2024	4 978	4 800	–	(178)
A	2 546 USD	(26 161) SEK	22 avril 2024	(3 448)	(3 313)	135	–
A	11 465 SEK	(1 109) USD	22 avril 2024	1 502	1 452	–	(50)
A	1 955 USD	(19 980) SEK	22 avril 2024	(2 647)	(2 530)	117	–
A	188 USD	(1 966) SEK	22 avril 2024	(255)	(249)	6	–
A	882 USD	(9 322) SEK	22 avril 2024	(1 195)	(1 181)	14	–
A	11 427 USD	(405 451) THB	22 avril 2024	(15 476)	(15 065)	411	–
A	12 373 USD	(438 996) THB	22 avril 2024	(16 756)	(16 311)	445	–
A	6 158 USD	(218 868) THB	22 avril 2024	(8 340)	(8 132)	208	–
A	207 USD	(7 293) THB	22 avril 2024	(280)	(271)	9	–
A	1 986 USD	(70 316) THB	22 avril 2024	(2 689)	(2 612)	77	–
A	126 USD	(4 548) THB	22 avril 2024	(171)	(169)	2	–
A	134 523 THB	(3 758) USD	22 avril 2024	5 089	4 998	–	(91)
A	12 571 THB	(351) USD	22 avril 2024	476	467	–	(9)
A	101 133 THB	(2 833) USD	22 avril 2024	3 837	3 758	–	(79)
A	2 354 USD	(83 959) THB	22 avril 2024	(3 188)	(3 120)	68	–
A	724 USD	(26 098) THB	22 avril 2024	(981)	(969)	12	–
A	893 USD	(32 410) THB	22 avril 2024	(1 209)	(1 204)	5	–
A	189 008 ZAR	(9 892) USD	22 avril 2024	13 397	13 489	92	–

# FONDS MONDIAL MACRO 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	273 150	ZAR	(14 296)	USD	22 avril 2024	19 361	19 494	133	–
A	110 681	ZAR	(5 764)	USD	22 avril 2024	7 806	7 899	93	–
A	5 394	ZAR	(284)	USD	22 avril 2024	385	385	–	–
A	37 769	ZAR	(1 989)	USD	22 avril 2024	2 693	2 695	2	–
A	5 086	ZAR	(264)	USD	22 avril 2024	358	363	5	–
A	1 263	USD	(24 318)	ZAR	22 avril 2024	(1 710)	(1 735)	–	(25)
A	16 348	ZAR	(853)	USD	22 avril 2024	1 155	1 166	11	–
A	1 382	USD	(26 245)	ZAR	22 avril 2024	(1 871)	(1 873)	–	(2)
A	62 686	ZAR	(3 348)	USD	22 avril 2024	4 534	4 474	–	(60)
A	45 329	ZAR	(2 390)	USD	22 avril 2024	3 237	3 235	–	(2)
A	35 120	ZAR	(1 845)	USD	22 avril 2024	2 499	2 507	8	–
A	3 734	AUD	(2 454)	USD	22 avril 2024	3 324	3 297	–	(27)
A	137	USD	(209)	AUD	22 avril 2024	(186)	(185)	1	–
A	222	USD	(337)	AUD	22 avril 2024	(300)	(297)	3	–
A	13	USD	(19)	AUD	22 avril 2024	(17)	(17)	–	–
A	53	USD	(81)	AUD	22 avril 2024	(72)	(72)	–	–
A	241	USD	(373)	AUD	22 avril 2024	(327)	(329)	–	(2)
A	1 888	USD	(2 879)	AUD	22 avril 2024	(2 557)	(2 543)	14	–
A	828	AUD	(543)	USD	22 avril 2024	735	731	–	(4)
A	1 764	USD	(2 702)	AUD	22 avril 2024	(2 389)	(2 385)	4	–
A	425	AUD	(281)	USD	22 avril 2024	380	375	–	(5)
A	1 480	USD	(2 266)	AUD	22 avril 2024	(2 005)	(2 001)	4	–
A	1 320	AUD	(864)	USD	22 avril 2024	1 170	1 166	–	(4)
A	16 224	BRL	(3 245)	USD	22 avril 2024	4 395	4 371	–	(24)
A	16 316	BRL	(3 264)	USD	22 avril 2024	4 421	4 397	–	(24)
A	218	BRL	(44)	USD	22 avril 2024	59	59	–	–
A	265	USD	(1 327)	BRL	22 avril 2024	(359)	(358)	1	–
A	1 849	BRL	(370)	USD	22 avril 2024	501	498	–	(3)
A	1 102	BRL	(220)	USD	22 avril 2024	298	297	–	(1)
A	299	USD	(1 487)	BRL	22 avril 2024	(405)	(401)	4	–
A	105	USD	(523)	BRL	22 avril 2024	(142)	(140)	2	–
A	9 050	BRL	(1 822)	USD	22 avril 2024	2 468	2 439	–	(29)
A	1 078	BRL	(216)	USD	22 avril 2024	292	290	–	(2)
A	7 311	BRL	(1 452)	USD	22 avril 2024	1 966	1 970	4	–
A	903	BRL	(181)	USD	22 avril 2024	245	244	–	(1)
A	3 158	USD	(4 264)	CAD	22 avril 2024	4 264	4 277	13	–
A	1 016	USD	(1 371)	CAD	22 avril 2024	1 371	1 375	4	–
A	739	USD	(995)	CAD	22 avril 2024	995	1 001	6	–
A	27	CAD	(20)	USD	22 avril 2024	(27)	(27)	–	–
A	273	USD	(369)	CAD	22 avril 2024	369	370	1	–
A	9	CAD	(7)	USD	22 avril 2024	(9)	(9)	–	–
A	96	USD	(130)	CAD	22 avril 2024	130	131	1	–
A	168	USD	(228)	CAD	22 avril 2024	228	229	1	–
A	4 413	USD	(5 985)	CAD	22 avril 2024	5 985	5 977	–	(8)
A	162	USD	(218)	CAD	22 avril 2024	218	219	1	–
A	3 075	CAD	(2 265)	USD	22 avril 2024	(3 075)	(3 068)	7	–
A	1 331	CAD	(981)	USD	22 avril 2024	(1 331)	(1 329)	2	–
A	882 277	CLP	(958)	USD	22 avril 2024	1 297	1 218	–	(79)
A	288 940	CLP	(315)	USD	22 avril 2024	427	399	–	(28)
A	196	USD	(184 303)	CLP	22 avril 2024	(266)	(255)	11	–

# FONDS MONDIAL MACRO 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	244 479	CLP (257)	USD	22 avril 2024	348	338	–	(10)
A	137 121	CLP (141)	USD	22 avril 2024	191	190	–	(1)
A	78 780	CLP (80)	USD	22 avril 2024	109	109	–	–
A	57	USD (55 714)	CLP	22 avril 2024	(77)	(77)	–	–
A	175 189	CLP (179)	USD	22 avril 2024	242	242	–	–
A	761 992	CLP (792)	USD	22 avril 2024	1 072	1 052	–	(20)
A	756	USD (732 054)	CLP	22 avril 2024	(1 024)	(1 011)	13	–
A	1 238 549	CLP (1 257)	USD	22 avril 2024	1 703	1 711	8	–
A	3 360	USD (24 125)	CNY	22 avril 2024	(4 551)	(4 511)	40	–
A	159	USD (1 145)	CNY	22 avril 2024	(216)	(214)	2	–
A	397	USD (2 828)	CNY	22 avril 2024	(537)	(529)	8	–
A	92	USD (660)	CNY	22 avril 2024	(125)	(123)	2	–
A	117	USD (843)	CNY	22 avril 2024	(159)	(157)	2	–
A	123	USD (887)	CNY	22 avril 2024	(167)	(166)	1	–
A	8 156	CNY (1 137)	USD	22 avril 2024	1 540	1 525	–	(15)
A	797	USD (5 732)	CNY	22 avril 2024	(1 080)	(1 071)	9	–
A	1 130	USD (8 127)	CNY	22 avril 2024	(1 531)	(1 519)	12	–
A	1 267	CNY (176)	USD	22 avril 2024	239	236	–	(3)
A	2 595	USD (18 682)	CNY	22 avril 2024	(3 515)	(3 493)	22	–
A	2 199	USD (15 922)	CNY	22 avril 2024	(2 978)	(2 977)	1	–
A	11 929 402	COP (2 986)	USD	22 avril 2024	4 044	4 168	124	–
A	24 901 587	COP (6 233)	USD	22 avril 2024	8 441	8 699	258	–
A	2 526 329	COP (632)	USD	22 avril 2024	856	883	27	–
A	57	USD (225 516)	COP	22 avril 2024	(77)	(79)	–	(2)
A	2 788 854	COP (696)	USD	22 avril 2024	942	974	32	–
A	45 095	COP (11)	USD	22 avril 2024	15	15	–	–
A	737	USD (2 926 220)	COP	22 avril 2024	(998)	(1 023)	–	(25)
A	162	USD (644 772)	COP	22 avril 2024	(220)	(225)	–	(5)
A	43	USD (171 616)	COP	22 avril 2024	(58)	(60)	–	(2)
A	1 726 027	COP (438)	USD	22 avril 2024	593	603	10	–
A	3 802 704	COP (971)	USD	22 avril 2024	1 315	1 328	13	–
A	929 734	COP (240)	USD	22 avril 2024	325	325	–	–
A	2 474	USD (56 670)	CZK	22 avril 2024	(3 351)	(3 272)	79	–
A	1 993	USD (45 637)	CZK	22 avril 2024	(2 699)	(2 635)	64	–
A	303	USD (6 963)	CZK	22 avril 2024	(410)	(402)	8	–
A	869	CZK (38)	USD	22 avril 2024	51	50	–	(1)
A	548	CZK (24)	USD	22 avril 2024	32	32	–	–
A	32	USD (766)	CZK	22 avril 2024	(44)	(44)	–	–
A	133	USD (3 116)	CZK	22 avril 2024	(180)	(180)	–	–
A	4 291	CZK (183)	USD	22 avril 2024	248	247	–	(1)
A	464	USD (10 824)	CZK	22 avril 2024	(629)	(625)	4	–
A	197	CZK (9)	USD	22 avril 2024	12	12	–	–
A	1 138	USD (26 487)	CZK	22 avril 2024	(1 541)	(1 529)	12	–
A	4 657	CZK (199)	USD	22 avril 2024	270	269	–	(1)
A	3 377	USD (3 101)	EUR	22 avril 2024	(4 574)	(4 535)	39	–
A	646	EUR (703)	USD	22 avril 2024	952	945	–	(7)
A	248	USD (228)	EUR	22 avril 2024	(336)	(334)	2	–
A	911	EUR (981)	USD	22 avril 2024	1 329	1 331	2	–
A	728	EUR (783)	USD	22 avril 2024	1 060	1 065	5	–
A	2 051	EUR (2 223)	USD	22 avril 2024	3 010	2 999	–	(11)

# FONDS MONDIAL MACRO 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	268 EUR	(292) USD	22 avril 2024	395	392	–	(3)
A	1 641 EUR	(1 788) USD	22 avril 2024	2 421	2 400	–	(21)
A	1 936 USD	(1 771) EUR	22 avril 2024	(2 622)	(2 589)	33	–
A	1 228 EUR	(1 335) USD	22 avril 2024	1 808	1 795	–	(13)
A	60 USD	(55) EUR	22 avril 2024	(81)	(81)	–	–
A	1 638 USD	(1 292) GBP	22 avril 2024	(2 218)	(2 208)	10	–
A	1 696 USD	(1 338) GBP	22 avril 2024	(2 297)	(2 287)	10	–
A	941 GBP	(1 193) USD	22 avril 2024	1 615	1 609	–	(6)
A	12 GBP	(15) USD	22 avril 2024	20	20	–	–
A	376 GBP	(473) USD	22 avril 2024	641	643	2	–
A	113 USD	(90) GBP	22 avril 2024	(153)	(153)	–	–
A	1 819 USD	(1 440) GBP	22 avril 2024	(2 463)	(2 462)	1	–
A	685 GBP	(868) USD	22 avril 2024	1 176	1 170	–	(6)
A	1 810 GBP	(2 306) USD	22 avril 2024	3 123	3 095	–	(28)
A	260 USD	(203) GBP	22 avril 2024	(352)	(347)	5	–
A	920 GBP	(1 169) USD	22 avril 2024	1 583	1 572	–	(11)
A	35 GBP	(44) USD	22 avril 2024	59	59	–	–
A	52 546 082 IDR	(3 359) USD	22 avril 2024	4 549	4 481	–	(68)
A	24 933 500 IDR	(1 594) USD	22 avril 2024	2 159	2 127	–	(32)
A	146 415 IDR	(10) USD	22 avril 2024	13	13	–	–
A	5 005 874 IDR	(316) USD	22 avril 2024	428	427	–	(1)
A	5 494 712 IDR	(349) USD	22 avril 2024	472	469	–	(3)
A	4 343 652 IDR	(277) USD	22 avril 2024	375	370	–	(5)
A	4 738 816 IDR	(303) USD	22 avril 2024	411	404	–	(7)
A	233 USD	(3 647 684) IDR	22 avril 2024	(315)	(311)	4	–
A	14 164 763 IDR	(899) USD	22 avril 2024	1 217	1 208	–	(9)
A	12 298 234 IDR	(791) USD	22 avril 2024	1 071	1 049	–	(22)
A	13 105 582 IDR	(832) USD	22 avril 2024	1 127	1 118	–	(9)
A	8 657 333 IDR	(546) USD	22 avril 2024	740	738	–	(2)
A	2 385 USD	(8 938) ILS	22 avril 2024	(3 230)	(3 298)	–	(68)
A	2 545 USD	(9 535) ILS	22 avril 2024	(3 446)	(3 518)	–	(72)
A	3 841 ILS	(1 026) USD	22 avril 2024	1 390	1 417	27	–
A	861 ILS	(236) USD	22 avril 2024	319	317	–	(2)
A	345 USD	(1 255) ILS	22 avril 2024	(467)	(462)	5	–
A	1 089 ILS	(298) USD	22 avril 2024	403	402	–	(1)
A	4 605 ILS	(1 269) USD	22 avril 2024	1 719	1 699	–	(20)
A	351 ILS	(97) USD	22 avril 2024	132	129	–	(3)
A	1 249 USD	(4 474) ILS	22 avril 2024	(1 691)	(1 650)	41	–
A	725 USD	(2 654) ILS	22 avril 2024	(982)	(979)	3	–
A	181 USD	(663) ILS	22 avril 2024	(245)	(245)	–	–
A	681 USD	(2 492) ILS	22 avril 2024	(922)	(919)	3	–
A	102 000 INR	(1 221) USD	22 avril 2024	1 654	1 656	2	–
A	32 324 INR	(387) USD	22 avril 2024	524	524	–	–
A	1 571 INR	(19) USD	22 avril 2024	26	26	–	–
A	18 USD	(1 518) INR	22 avril 2024	(25)	(25)	–	–
A	9 923 INR	(119) USD	22 avril 2024	161	161	–	–
A	428 USD	(35 604) INR	22 avril 2024	(580)	(578)	2	–
A	125 USD	(10 377) INR	22 avril 2024	(169)	(168)	1	–
A	43 811 INR	(528) USD	22 avril 2024	715	712	–	(3)
A	269 USD	(22 271) INR	22 avril 2024	(364)	(362)	2	–

# FONDS MONDIAL MACRO 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	24 885 INR	(300) USD	22 avril 2024	406	404	–	(2)
A	14 659 INR	(176) USD	22 avril 2024	238	238	–	–
A	1 136 USD	(166 016) JPY	22 avril 2024	(1 538)	(1 490)	48	–
A	383 785 JPY	(2 625) USD	22 avril 2024	3 555	3 444	–	(111)
A	91 059 JPY	(622) USD	22 avril 2024	842	817	–	(25)
A	1 782 JPY	(13) USD	22 avril 2024	17	16	–	(1)
A	35 893 JPY	(245) USD	22 avril 2024	332	322	–	(10)
A	202 USD	(30 119) JPY	22 avril 2024	(274)	(271)	3	–
A	106 USD	(15 725) JPY	22 avril 2024	(143)	(141)	2	–
A	40 530 JPY	(272) USD	22 avril 2024	368	364	–	(4)
A	1 491 USD	(222 028) JPY	22 avril 2024	(2 019)	(1 993)	26	–
A	626 032 JPY	(4 264) USD	22 avril 2024	5 775	5 619	–	(156)
A	892 USD	(133 748) JPY	22 avril 2024	(1 208)	(1 201)	7	–
A	3 106 USD	(469 084) JPY	22 avril 2024	(4 207)	(4 211)	–	(4)
A	1 060 USD	(1 413 925) KOR	22 avril 2024	(1 435)	(1 420)	15	–
A	1 143 USD	(1 525 041) KOR	22 avril 2024	(1 548)	(1 532)	16	–
A	407 USD	(542 252) KOR	22 avril 2024	(551)	(545)	6	–
A	64 USD	(84 256) KOR	22 avril 2024	(86)	(85)	1	–
A	149 982 KOR	(114) USD	22 avril 2024	154	151	–	(3)
A	219 USD	(292 313) KOR	22 avril 2024	(297)	(294)	3	–
A	93 USD	(123 087) KOR	22 avril 2024	(126)	(124)	2	–
A	123 USD	(163 281) KOR	22 avril 2024	(166)	(164)	2	–
A	890 USD	(1 184 318) KOR	22 avril 2024	(1 205)	(1 190)	15	–
A	685 429 KOR	(524) USD	22 avril 2024	709	689	–	(20)
A	1 093 USD	(1 461 227) KOR	22 avril 2024	(1 480)	(1 468)	12	–
A	87 476 KOR	(65) USD	22 avril 2024	88	88	–	–
A	29 891 MXN	(1 713) USD	22 avril 2024	2 320	2 427	107	–
A	44 552 MXN	(2 553) USD	22 avril 2024	3 458	3 617	159	–
A	4 016 MXN	(228) USD	22 avril 2024	309	326	17	–
A	1 845 MXN	(106) USD	22 avril 2024	143	149	6	–
A	770 USD	(13 290) MXN	22 avril 2024	(1 043)	(1 079)	–	(36)
A	646 USD	(11 239) MXN	22 avril 2024	(875)	(912)	–	(37)
A	1 588 USD	(27 449) MXN	22 avril 2024	(2 151)	(2 228)	–	(77)
A	547 MXN	(32) USD	22 avril 2024	43	44	1	–
A	43 652 MXN	(2 564) USD	22 avril 2024	3 472	3 543	71	–
A	618 USD	(10 470) MXN	22 avril 2024	(837)	(850)	–	(13)
A	8 509 MXN	(503) USD	22 avril 2024	681	691	10	–
A	4 007 MXN	(239) USD	22 avril 2024	324	325	1	–
A	49 715 NOK	(4 727) USD	22 avril 2024	6 402	6 204	–	(198)
A	3 039 USD	(31 961) NOK	22 avril 2024	(4 116)	(3 989)	127	–
A	14 USD	(150) NOK	22 avril 2024	(19)	(18)	1	–
A	409 USD	(4 276) NOK	22 avril 2024	(554)	(534)	20	–
A	399 USD	(4 247) NOK	22 avril 2024	(541)	(530)	11	–
A	336 USD	(3 572) NOK	22 avril 2024	(455)	(446)	9	–
A	18 949 NOK	(1 805) USD	22 avril 2024	2 444	2 364	–	(80)
A	730 USD	(7 668) NOK	22 avril 2024	(988)	(957)	31	–
A	36 058 NOK	(3 425) USD	22 avril 2024	4 638	4 500	–	(138)
A	427 USD	(4 488) NOK	22 avril 2024	(578)	(560)	18	–
A	2 940 USD	(31 323) NOK	22 avril 2024	(3 981)	(3 909)	72	–
A	3 197 USD	(34 282) NOK	22 avril 2024	(4 329)	(4 278)	51	–

# FONDS MONDIAL MACRO 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	3 421 USD	(5 605) NZD	22 avril 2024	(4 633)	(4 535)	98	–
A	3 637 NZD	(2 220) USD	22 avril 2024	3 006	2 942	–	(64)
A	1 938 USD	(3 191) NZD	22 avril 2024	(2 624)	(2 581)	43	–
A	1 239 NZD	(758) USD	22 avril 2024	1 026	1 002	–	(24)
A	1 263 USD	(2 082) NZD	22 avril 2024	(1 710)	(1 684)	26	–
A	720 NZD	(436) USD	22 avril 2024	591	582	–	(9)
A	7 440 NZD	(4 601) USD	22 avril 2024	6 231	6 019	–	(212)
A	22 NZD	(13) USD	22 avril 2024	18	17	–	(1)
A	103 USD	(169) NZD	22 avril 2024	(139)	(136)	3	–
A	1 602 USD	(2 605) NZD	22 avril 2024	(2 169)	(2 107)	62	–
A	936 USD	(1 549) NZD	22 avril 2024	(1 268)	(1 252)	16	–
A	859 USD	(1 429) NZD	22 avril 2024	(1 163)	(1 156)	7	–
A	1 572 USD	(87 865) PHP	22 avril 2024	(2 129)	(2 117)	12	–
A	2 135 USD	(119 399) PHP	22 avril 2024	(2 892)	(2 876)	16	–
A	17 USD	(969) PHP	22 avril 2024	(23)	(23)	–	–
A	52 USD	(2 908) PHP	22 avril 2024	(70)	(70)	–	–
A	190 USD	(10 669) PHP	22 avril 2024	(257)	(257)	–	–
A	467 USD	(26 255) PHP	22 avril 2024	(632)	(633)	–	(1)
A	713 USD	(39 810) PHP	22 avril 2024	(966)	(959)	7	–
A	859 USD	(48 248) PHP	22 avril 2024	(1 164)	(1 162)	2	–
A	2 162 USD	(121 015) PHP	22 avril 2024	(2 928)	(2 915)	13	–
A	295 USD	(16 395) PHP	22 avril 2024	(400)	(394)	6	–
A	504 USD	(28 186) PHP	22 avril 2024	(682)	(678)	4	–
A	656 USD	(36 933) PHP	22 avril 2024	(889)	(890)	–	(1)
A	1 789 PLN	(442) USD	22 avril 2024	598	606	8	–
A	11 473 PLN	(2 832) USD	22 avril 2024	3 835	3 889	54	–
A	73 USD	(296) PLN	22 avril 2024	(99)	(101)	–	(2)
A	36 PLN	(9) USD	22 avril 2024	12	12	–	–
A	290 USD	(1 176) PLN	22 avril 2024	(393)	(398)	–	(5)
A	19 USD	(76) PLN	22 avril 2024	(26)	(26)	–	–
A	458 PLN	(114) USD	22 avril 2024	155	155	–	–
A	76 USD	(301) PLN	22 avril 2024	(103)	(102)	1	–
A	5 512 PLN	(1 389) USD	22 avril 2024	1 881	1 869	–	(12)
A	1 158 USD	(4 547) PLN	22 avril 2024	(1 568)	(1 542)	26	–
A	833 PLN	(210) USD	22 avril 2024	284	283	–	(1)
A	389 USD	(1 549) PLN	22 avril 2024	(527)	(525)	2	–
A	4 424 USD	(46 270) SEK	22 avril 2024	(5 992)	(5 859)	133	–
A	70 568 SEK	(6 748) USD	22 avril 2024	9 139	8 936	–	(203)
A	419 USD	(4 394) SEK	22 avril 2024	(568)	(556)	12	–
A	1 535 SEK	(148) USD	22 avril 2024	200	195	–	(5)
A	362 USD	(3 813) SEK	22 avril 2024	(490)	(482)	8	–
A	3 977 SEK	(377) USD	22 avril 2024	511	504	–	(7)
A	10 707 SEK	(1 038) USD	22 avril 2024	1 406	1 356	–	(50)
A	780 USD	(8 022) SEK	22 avril 2024	(1 057)	(1 016)	41	–
A	10 603 SEK	(1 026) USD	22 avril 2024	1 389	1 343	–	(46)
A	720 USD	(7 358) SEK	22 avril 2024	(975)	(932)	43	–
A	147 SEK	(14) USD	22 avril 2024	19	19	–	–
A	376 USD	(3 972) SEK	22 avril 2024	(509)	(503)	6	–
A	4 097 USD	(145 384) THB	22 avril 2024	(5 549)	(5 402)	147	–

# FONDS MONDIAL MACRO 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	3 947 USD	(140 042) THB	22 avril 2024	(5 345)	(5 203)	142	–
A	600 USD	(21 322) THB	22 avril 2024	(812)	(792)	20	–
A	6 363 THB	(180) USD	22 avril 2024	244	236	–	(8)
A	738 USD	(26 109) THB	22 avril 2024	(999)	(971)	28	–
A	1 194 THB	(33) USD	22 avril 2024	45	44	–	(1)
A	38 948 THB	(1 088) USD	22 avril 2024	1 473	1 447	–	(26)
A	10 713 THB	(300) USD	22 avril 2024	406	398	–	(8)
A	1 098 USD	(39 208) THB	22 avril 2024	(1 487)	(1 456)	31	–
A	697 USD	(24 859) THB	22 avril 2024	(944)	(924)	20	–
A	548 USD	(19 746) THB	22 avril 2024	(742)	(733)	9	–
A	38 USD	(1 397) THB	22 avril 2024	(52)	(52)	–	–
A	31 240 ZAR	(1 635) USD	22 avril 2024	2 214	2 229	15	–
A	124 950 ZAR	(6 539) USD	22 avril 2024	8 856	8 917	61	–
A	9 045 ZAR	(471) USD	22 avril 2024	638	646	8	–
A	158 USD	(2 998) ZAR	22 avril 2024	(214)	(214)	–	–
A	14 064 ZAR	(741) USD	22 avril 2024	1 003	1 004	1	–
A	108 ZAR	(6) USD	22 avril 2024	8	8	–	–
A	382 USD	(7 357) ZAR	22 avril 2024	(517)	(525)	–	(8)
A	174 ZAR	(9) USD	22 avril 2024	12	12	–	–
A	36 651 ZAR	(1 929) USD	22 avril 2024	2 612	2 615	3	–
A	19 124 ZAR	(1 021) USD	22 avril 2024	1 383	1 365	–	(18)
A	22 876 ZAR	(1 207) USD	22 avril 2024	1 634	1 633	–	(1)
A	5 532 ZAR	(291) USD	22 avril 2024	394	395	1	–
A	4 984 CAD	(3 691) USD	22 avril 2024	(4 984)	(4 999)	–	(15)
A	6 759 CAD	(5 006) USD	22 avril 2024	(6 759)	(6 779)	–	(20)
A	463 CAD	(344) USD	22 avril 2024	(463)	(466)	–	(3)
A	246 CAD	(183) USD	22 avril 2024	(246)	(248)	–	(2)
A	585 CAD	(433) USD	22 avril 2024	(585)	(586)	–	(1)
A	984 USD	(1 331) CAD	22 avril 2024	1 331	1 331	–	–
A	2 670 USD	(3 602) CAD	22 avril 2024	3 602	3 616	14	–
A	329 USD	(445) CAD	22 avril 2024	445	446	1	–
A	163 USD	(221) CAD	22 avril 2024	221	221	–	–
A	1 484 CAD	(1 100) USD	22 avril 2024	(1 484)	(1 490)	–	(6)
A	1 665 CAD	(1 226) USD	22 avril 2024	(1 665)	(1 661)	4	–
A	589 CAD	(434) USD	22 avril 2024	(589)	(588)	1	–
A	20 958 AUD	(13 776) USD	22 avril 2024	18 657	18 506	–	(151)
A	2 017 USD	(3 069) AUD	22 avril 2024	(2 732)	(2 710)	22	–
A	1 277 USD	(1 940) AUD	22 avril 2024	(1 729)	(1 713)	16	–
A	4 306 AUD	(2 841) USD	22 avril 2024	3 847	3 802	–	(45)
A	504 USD	(773) AUD	22 avril 2024	(683)	(682)	1	–
A	1 499 USD	(2 315) AUD	22 avril 2024	(2 030)	(2 045)	–	(15)
A	11 941 USD	(18 214) AUD	22 avril 2024	(16 172)	(16 083)	89	–
A	5 346 AUD	(3 505) USD	22 avril 2024	4 747	4 720	–	(27)
A	17 993 AUD	(11 734) USD	22 avril 2024	15 891	15 887	–	(4)
A	21 431 USD	(32 819) AUD	22 avril 2024	(29 023)	(28 980)	43	–
A	2 106 AUD	(1 391) USD	22 avril 2024	1 884	1 859	–	(25)
A	6 631 AUD	(4 333) USD	22 avril 2024	5 868	5 855	–	(13)
A	6 500 AUD	(4 252) USD	22 avril 2024	5 758	5 739	–	(19)
A	93 642 BRL	(18 733) USD	22 avril 2024	25 370	25 234	–	(136)
A	71 910 BRL	(14 387) USD	22 avril 2024	19 484	19 378	–	(106)

# FONDS MONDIAL MACRO 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	273 USD	(1 371) BRL	22 avril 2024	(370)	(369)	1	–
A	36 711 BRL	(7 325) USD	22 avril 2024	9 920	9 893	–	(27)
A	8 638 BRL	(1 729) USD	22 avril 2024	2 342	2 327	–	(15)
A	7 684 BRL	(1 533) USD	22 avril 2024	2 076	2 071	–	(5)
A	1 386 USD	(6 895) BRL	22 avril 2024	(1 877)	(1 858)	19	–
A	419 BRL	(84) USD	22 avril 2024	114	113	–	(1)
A	3 689 BRL	(743) USD	22 avril 2024	1 006	994	–	(12)
A	8 324 BRL	(1 666) USD	22 avril 2024	2 256	2 243	–	(13)
A	30 768 BRL	(6 110) USD	22 avril 2024	8 275	8 291	16	–
A	7 770 BRL	(1 555) USD	22 avril 2024	2 106	2 094	–	(12)
A	15 656 USD	(21 138) CAD	22 avril 2024	21 139	21 202	63	–
A	5 602 USD	(7 563) CAD	22 avril 2024	7 563	7 586	23	–
A	3 343 USD	(4 503) CAD	22 avril 2024	4 503	4 528	25	–
A	6 704 USD	(8 994) CAD	22 avril 2024	8 994	9 079	85	–
A	1 263 USD	(1 707) CAD	22 avril 2024	1 707	1 711	4	–
A	65 USD	(88) CAD	22 avril 2024	88	88	–	–
A	1 018 USD	(1 373) CAD	22 avril 2024	1 373	1 378	5	–
A	1 687 USD	(2 280) CAD	22 avril 2024	2 280	2 286	6	–
A	11 725 USD	(15 892) CAD	22 avril 2024	15 893	15 880	–	(13)
A	3 945 USD	(5 350) CAD	22 avril 2024	5 351	5 344	–	(7)
A	1 465 USD	(1 977) CAD	22 avril 2024	1 977	1 985	8	–
A	1 798 CAD	(1 325) USD	22 avril 2024	(1 798)	(1 794)	4	–
A	6 201 CAD	(4 571) USD	22 avril 2024	(6 201)	(6 190)	11	–
A	4 516 901 CLP	(4 903) USD	22 avril 2024	6 640	6 237	–	(403)
A	1 331 405 CLP	(1 452) USD	22 avril 2024	1 967	1 839	–	(128)
A	456 922 CLP	(486) USD	22 avril 2024	658	630	–	(28)
A	1 416 185 CLP	(1 487) USD	22 avril 2024	2 014	1 956	–	(58)
A	902 900 CLP	(927) USD	22 avril 2024	1 255	1 246	–	(9)
A	647 213 CLP	(662) USD	22 avril 2024	897	894	–	(3)
A	228 USD	(224 672) CLP	22 avril 2024	(309)	(310)	–	(1)
A	945 USD	(927 074) CLP	22 avril 2024	(1 280)	(1 280)	–	–
A	4 083 350 CLP	(4 241) USD	22 avril 2024	5 743	5 638	–	(105)
A	4 173 USD	(4 040 756) CLP	22 avril 2024	(5 651)	(5 580)	71	–
A	6 467 992 CLP	(6 565) USD	22 avril 2024	8 891	8 931	40	–
A	19 888 USD	(142 782) CNY	22 avril 2024	(26 934)	(26 696)	238	–
A	14 101 CNY	(1 964) USD	22 avril 2024	2 660	2 636	–	(24)
A	1 696 USD	(12 105) CNY	22 avril 2024	(2 297)	(2 263)	34	–
A	5 984 USD	(42 812) CNY	22 avril 2024	(8 104)	(8 004)	100	–
A	375 USD	(2 688) CNY	22 avril 2024	(508)	(502)	6	–
A	870 USD	(6 264) CNY	22 avril 2024	(1 178)	(1 171)	7	–
A	49 420 CNY	(6 889) USD	22 avril 2024	9 329	9 239	–	(90)
A	5 517 USD	(39 640) CNY	22 avril 2024	(7 471)	(7 412)	59	–
A	602 USD	(4 324) CNY	22 avril 2024	(815)	(809)	6	–
A	4 281 CNY	(597) USD	22 avril 2024	809	800	–	(9)
A	12 508 USD	(90 030) CNY	22 avril 2024	(16 939)	(16 832)	107	–
A	11 801 USD	(85 442) CNY	22 avril 2024	(15 982)	(15 975)	7	–
A	111 425 340 COP	(27 890) USD	22 avril 2024	37 771	38 924	1 153	–
A	75 916 084 COP	(19 001) USD	22 avril 2024	25 733	26 520	787	–
A	28 USD	(112 284) COP	22 avril 2024	(38)	(39)	–	(1)

# FONDS MONDIAL MACRO 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	2 594 377	COP	(651)	USD	22 avril 2024	882	906	24	–
A	1 334	USD	(5 348 690)	COP	22 avril 2024	(1 807)	(1 868)	–	(61)
A	896 437	COP	(225)	USD	22 avril 2024	305	314	9	–
A	23 303 562	COP	(5 867)	USD	22 avril 2024	7 946	8 141	195	–
A	343	USD	(1 358 309)	COP	22 avril 2024	(464)	(475)	–	(11)
A	2 396	USD	(9 526 730)	COP	22 avril 2024	(3 245)	(3 329)	–	(84)
A	11 478 594	COP	(2 912)	USD	22 avril 2024	3 944	4 010	66	–
A	13 552 450	COP	(3 461)	USD	22 avril 2024	4 687	4 734	47	–
A	5 121 354	COP	(1 321)	USD	22 avril 2024	1 789	1 789	–	–
A	9 491	USD	(217 356)	CZK	22 avril 2024	(12 854)	(12 549)	305	–
A	13 224	USD	(302 858)	CZK	22 avril 2024	(17 909)	(17 486)	423	–
A	1 182	USD	(27 179)	CZK	22 avril 2024	(1 601)	(1 569)	32	–
A	6 352	USD	(145 468)	CZK	22 avril 2024	(8 603)	(8 399)	204	–
A	12 951	CZK	(557)	USD	22 avril 2024	755	748	–	(7)
A	276	USD	(6 548)	CZK	22 avril 2024	(374)	(378)	–	(4)
A	1 226	USD	(28 767)	CZK	22 avril 2024	(1 661)	(1 661)	–	–
A	16 152	CZK	(690)	USD	22 avril 2024	935	932	–	(3)
A	86 621	CZK	(3 716)	USD	22 avril 2024	5 032	5 001	–	(31)
A	282	USD	(6 535)	CZK	22 avril 2024	(382)	(377)	5	–
A	5 003	USD	(116 472)	CZK	22 avril 2024	(6 775)	(6 724)	51	–
A	14 867	CZK	(636)	USD	22 avril 2024	861	858	–	(3)
A	31 304	USD	(28 746)	EUR	22 avril 2024	(42 394)	(42 034)	360	–
A	3 399	EUR	(3 695)	USD	22 avril 2024	5 004	4 970	–	(34)
A	5 496	USD	(5 055)	EUR	22 avril 2024	(7 443)	(7 392)	51	–
A	5 895	EUR	(6 353)	USD	22 avril 2024	8 604	8 620	16	–
A	4 514	EUR	(4 852)	USD	22 avril 2024	6 571	6 601	30	–
A	12 835	EUR	(13 907)	USD	22 avril 2024	18 834	18 767	–	(67)
A	2 067	EUR	(2 247)	USD	22 avril 2024	3 043	3 022	–	(21)
A	6 625	EUR	(7 216)	USD	22 avril 2024	9 773	9 688	–	(85)
A	10 036	USD	(9 178)	EUR	22 avril 2024	(13 592)	(13 420)	172	–
A	6 205	EUR	(6 747)	USD	22 avril 2024	9 138	9 074	–	(64)
A	151	USD	(139)	EUR	22 avril 2024	(204)	(203)	1	–
A	8 952	USD	(7 061)	GBP	22 avril 2024	(12 123)	(12 070)	53	–
A	7 997	USD	(6 308)	GBP	22 avril 2024	(10 830)	(10 783)	47	–
A	4 892	GBP	(6 200)	USD	22 avril 2024	8 396	8 363	–	(33)
A	2 844	USD	(2 244)	GBP	22 avril 2024	(3 852)	(3 837)	15	–
A	2 514	GBP	(3 163)	USD	22 avril 2024	4 284	4 297	13	–
A	751	USD	(596)	GBP	22 avril 2024	(1 017)	(1 018)	–	(1)
A	11 768	USD	(9 320)	GBP	22 avril 2024	(15 937)	(15 932)	5	–
A	4 179	GBP	(5 302)	USD	22 avril 2024	7 180	7 143	–	(37)
A	12 207	GBP	(15 546)	USD	22 avril 2024	21 054	20 866	–	(188)
A	1 395	USD	(1 091)	GBP	22 avril 2024	(1 889)	(1 865)	24	–
A	4 789	GBP	(6 089)	USD	22 avril 2024	8 246	8 187	–	(59)
A	205	GBP	(258)	USD	22 avril 2024	350	350	–	–
A	352 473 550	IDR	(22 534)	USD	22 avril 2024	30 517	30 061	–	(456)
A	41 597 982	IDR	(2 660)	USD	22 avril 2024	3 602	3 548	–	(54)
A	303	USD	(4 763 878)	IDR	22 avril 2024	(410)	(407)	3	–
A	138 754 643	IDR	(8 763)	USD	22 avril 2024	11 868	11 833	–	(35)
A	26 914 009	IDR	(1 706)	USD	22 avril 2024	2 311	2 295	–	(16)

# FONDS MONDIAL MACRO 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	29 192 024	IDR	(1 862)	USD	22 avril 2024	2 522	2 489	–	(33)
A	38 004 355	IDR	(2 434)	USD	22 avril 2024	3 296	3 241	–	(55)
A	832	USD	(13 046 447)	IDR	22 avril 2024	(1 127)	(1 113)	14	–
A	3 298	USD	(51 984 719)	IDR	22 avril 2024	(4 467)	(4 434)	33	–
A	72 034 544	IDR	(4 632)	USD	22 avril 2024	6 273	6 144	–	(129)
A	48 379 496	IDR	(3 071)	USD	22 avril 2024	4 159	4 126	–	(33)
A	53 151 367	IDR	(3 357)	USD	22 avril 2024	4 546	4 533	–	(13)
A	9 777	USD	(36 643)	ILS	22 avril 2024	(13 241)	(13 518)	–	(277)
A	15 271	USD	(57 232)	ILS	22 avril 2024	(20 681)	(21 114)	–	(433)
A	20 563	ILS	(5 495)	USD	22 avril 2024	7 442	7 586	144	–
A	4 041	USD	(14 751)	ILS	22 avril 2024	(5 472)	(5 442)	30	–
A	1 788	USD	(6 501)	ILS	22 avril 2024	(2 422)	(2 398)	24	–
A	6 616	ILS	(1 806)	USD	22 avril 2024	2 446	2 441	–	(5)
A	28 196	ILS	(7 772)	USD	22 avril 2024	10 525	10 402	–	(123)
A	1 300	ILS	(361)	USD	22 avril 2024	489	480	–	(9)
A	3 119	USD	(11 172)	ILS	22 avril 2024	(4 224)	(4 122)	102	–
A	4 029	USD	(14 742)	ILS	22 avril 2024	(5 456)	(5 438)	18	–
A	278	USD	(1 022)	ILS	22 avril 2024	(377)	(377)	–	–
A	3 759	USD	(13 762)	ILS	22 avril 2024	(5 091)	(5 077)	14	–
A	518 047	INR	(6 204)	USD	22 avril 2024	8 402	8 411	9	–
A	154 026	INR	(1 845)	USD	22 avril 2024	2 499	2 501	2	–
A	197 186	INR	(2 364)	USD	22 avril 2024	3 202	3 202	–	–
A	275	USD	(22 938)	INR	22 avril 2024	(373)	(373)	–	–
A	64 452	INR	(774)	USD	22 avril 2024	1 048	1 047	–	(1)
A	2 587	USD	(215 046)	INR	22 avril 2024	(3 504)	(3 491)	13	–
A	693	USD	(57 565)	INR	22 avril 2024	(938)	(934)	4	–
A	96 744	INR	(1 165)	USD	22 avril 2024	1 578	1 570	–	(8)
A	1 314	USD	(108 910)	INR	22 avril 2024	(1 779)	(1 768)	11	–
A	111 758	INR	(1 345)	USD	22 avril 2024	1 821	1 814	–	(7)
A	85 473	INR	(1 025)	USD	22 avril 2024	1 388	1 388	–	–
A	9 572 901	JPY	(65 486)	USD	22 avril 2024	88 686	85 930	–	(2 756)
A	8 075 547	JPY	(55 243)	USD	22 avril 2024	74 814	72 487	–	(2 327)
A	28 785	USD	(4 200 613)	JPY	22 avril 2024	(38 983)	(37 708)	1 275	–
A	1 224 996	JPY	(8 390)	USD	22 avril 2024	11 363	10 996	–	(367)
A	312 337	JPY	(2 134)	USD	22 avril 2024	2 890	2 804	–	(86)
A	561	USD	(83 681)	JPY	22 avril 2024	(760)	(751)	9	–
A	318 154	JPY	(2 132)	USD	22 avril 2024	2 887	2 855	–	(32)
A	145 534	JPY	(975)	USD	22 avril 2024	1 321	1 306	–	(15)
A	9 907	USD	(1 475 403)	JPY	22 avril 2024	(13 417)	(13 244)	173	–
A	3 166 037	JPY	(21 567)	USD	22 avril 2024	29 208	28 419	–	(789)
A	5 435	USD	(815 363)	JPY	22 avril 2024	(7 361)	(7 318)	43	–
A	14 479	USD	(2 186 354)	JPY	22 avril 2024	(19 608)	(19 625)	–	(17)
A	5 583	USD	(7 447 473)	KOR	22 avril 2024	(7 561)	(7 481)	80	–
A	5 602	USD	(7 471 777)	KOR	22 avril 2024	(7 586)	(7 506)	80	–
A	1 912	USD	(2 548 441)	KOR	22 avril 2024	(2 589)	(2 560)	29	–
A	3 984	USD	(5 284 068)	KOR	22 avril 2024	(5 396)	(5 308)	88	–
A	1 242 759	KOR	(940)	USD	22 avril 2024	1 273	1 249	–	(24)
A	1 427	USD	(1 905 552)	KOR	22 avril 2024	(1 933)	(1 914)	19	–
A	809	USD	(1 072 665)	KOR	22 avril 2024	(1 096)	(1 077)	19	–

# FONDS MONDIAL MACRO 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	1 102 USD	(1 463 327) KOR	22 avril 2024	(1 492)	(1 470)	22	–
A	600 USD	(799 540) KOR	22 avril 2024	(813)	(803)	10	–
A	3 178 731 KOR	(2 426) USD	22 avril 2024	3 286	3 193	–	(93)
A	5 034 USD	(6 729 903) KOR	22 avril 2024	(6 818)	(6 761)	57	–
A	42 950 KOR	(32) USD	22 avril 2024	43	43	–	–
A	277 689 MXN	(15 913) USD	22 avril 2024	21 551	22 542	991	–
A	100 653 MXN	(5 768) USD	22 avril 2024	7 812	8 171	359	–
A	14 901 MXN	(846) USD	22 avril 2024	1 146	1 210	64	–
A	119 339 MXN	(6 849) USD	22 avril 2024	9 276	9 687	411	–
A	5 241 USD	(90 468) MXN	22 avril 2024	(7 098)	(7 344)	–	(246)
A	4 033 USD	(70 150) MXN	22 avril 2024	(5 462)	(5 695)	–	(233)
A	9 885 USD	(170 814) MXN	22 avril 2024	(13 387)	(13 867)	–	(480)
A	6 916 MXN	(402) USD	22 avril 2024	545	562	17	–
A	186 556 MXN	(10 957) USD	22 avril 2024	14 839	15 144	305	–
A	2 903 USD	(49 154) MXN	22 avril 2024	(3 931)	(3 990)	–	(59)
A	33 111 MXN	(1 957) USD	22 avril 2024	2 650	2 687	37	–
A	26 208 MXN	(1 565) USD	22 avril 2024	2 120	2 127	7	–
A	13 497 USD	(141 949) NOK	22 avril 2024	(18 279)	(17 715)	564	–
A	232 081 NOK	(22 067) USD	22 avril 2024	29 885	28 963	–	(922)
A	174 USD	(1 822) NOK	22 avril 2024	(235)	(228)	7	–
A	331 USD	(3 460) NOK	22 avril 2024	(448)	(432)	16	–
A	2 593 USD	(27 550) NOK	22 avril 2024	(3 511)	(3 439)	72	–
A	2 112 USD	(22 479) NOK	22 avril 2024	(2 860)	(2 805)	55	–
A	121 521 NOK	(11 574) USD	22 avril 2024	15 675	15 165	–	(510)
A	4 500 USD	(47 309) NOK	22 avril 2024	(6 094)	(5 904)	190	–
A	163 983 NOK	(15 574) USD	22 avril 2024	21 092	20 464	–	(628)
A	1 873 USD	(19 706) NOK	22 avril 2024	(2 537)	(2 459)	78	–
A	15 652 USD	(166 770) NOK	22 avril 2024	(21 197)	(20 812)	385	–
A	16 370 USD	(175 561) NOK	22 avril 2024	(22 170)	(21 909)	261	–
A	2 671 USD	(4 376) NZD	22 avril 2024	(3 617)	(3 540)	77	–
A	3 431 USD	(5 621) NZD	22 avril 2024	(4 646)	(4 548)	98	–
A	9 660 USD	(15 906) NZD	22 avril 2024	(13 083)	(12 869)	214	–
A	841 NZD	(514) USD	22 avril 2024	696	680	–	(16)
A	7 716 USD	(12 720) NZD	22 avril 2024	(10 449)	(10 292)	157	–
A	4 458 NZD	(2 703) USD	22 avril 2024	3 660	3 607	–	(53)
A	47 118 NZD	(29 138) USD	22 avril 2024	39 461	38 121	–	(1 340)
A	414 NZD	(255) USD	22 avril 2024	346	335	–	(11)
A	2 294 USD	(3 760) NZD	22 avril 2024	(3 107)	(3 042)	65	–
A	8 308 USD	(13 511) NZD	22 avril 2024	(11 251)	(10 932)	319	–
A	4 715 USD	(7 797) NZD	22 avril 2024	(6 386)	(6 307)	79	–
A	4 534 USD	(7 543) NZD	22 avril 2024	(6 140)	(6 103)	37	–
A	11 053 USD	(617 856) PHP	22 avril 2024	(14 969)	(14 884)	85	–
A	7 795 USD	(435 787) PHP	22 avril 2024	(10 557)	(10 498)	59	–
A	9 417 PHP	(167) USD	22 avril 2024	226	227	1	–
A	5 385 USD	(303 892) PHP	22 avril 2024	(7 293)	(7 320)	–	(27)
A	859 USD	(48 317) PHP	22 avril 2024	(1 163)	(1 164)	–	(1)
A	3 045 USD	(171 339) PHP	22 avril 2024	(4 124)	(4 128)	–	(4)
A	4 739 USD	(264 532) PHP	22 avril 2024	(6 418)	(6 372)	46	–
A	6 314 USD	(354 297) PHP	22 avril 2024	(8 551)	(8 535)	16	–

# FONDS MONDIAL MACRO 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	3 219 USD	(180 175) PHP	22 avril 2024	(4 359)	(4 340)	19	–
A	2 053 USD	(113 870) PHP	22 avril 2024	(2 781)	(2 743)	38	–
A	1 312 USD	(73 397) PHP	22 avril 2024	(1 777)	(1 768)	9	–
A	3 922 USD	(220 678) PHP	22 avril 2024	(5 311)	(5 316)	–	(5)
A	26 640 PLN	(6 576) USD	22 avril 2024	8 906	9 031	125	–
A	40 706 PLN	(10 048) USD	22 avril 2024	13 608	13 799	191	–
A	592 USD	(2 403) PLN	22 avril 2024	(802)	(814)	–	(12)
A	18 136 PLN	(4 504) USD	22 avril 2024	6 100	6 148	48	–
A	2 132 USD	(8 635) PLN	22 avril 2024	(2 888)	(2 928)	–	(40)
A	52 USD	(210) PLN	22 avril 2024	(70)	(71)	–	(1)
A	3 799 PLN	(950) USD	22 avril 2024	1 286	1 288	2	–
A	121 USD	(482) PLN	22 avril 2024	(164)	(163)	1	–
A	12 686 PLN	(3 197) USD	22 avril 2024	4 329	4 301	–	(28)
A	5 811 USD	(22 826) PLN	22 avril 2024	(7 870)	(7 738)	132	–
A	2 416 PLN	(608) USD	22 avril 2024	823	820	–	(3)
A	1 788 USD	(7 120) PLN	22 avril 2024	(2 422)	(2 413)	9	–
A	26 616 SEK	(2 545) USD	22 avril 2024	3 447	3 371	–	(76)
A	96 848 SEK	(9 261) USD	22 avril 2024	12 542	12 264	–	(278)
A	2 268 USD	(23 746) SEK	22 avril 2024	(3 072)	(3 007)	65	–
A	37 135 SEK	(3 567) USD	22 avril 2024	4 831	4 702	–	(129)
A	2 441 USD	(25 699) SEK	22 avril 2024	(3 306)	(3 255)	51	–
A	25 554 SEK	(2 422) USD	22 avril 2024	3 280	3 236	–	(44)
A	70 300 SEK	(6 817) USD	22 avril 2024	9 232	8 902	–	(330)
A	4 773 USD	(49 047) SEK	22 avril 2024	(6 464)	(6 211)	253	–
A	22 653 SEK	(2 192) USD	22 avril 2024	2 968	2 869	–	(99)
A	3 544 USD	(36 224) SEK	22 avril 2024	(4 799)	(4 587)	212	–
A	329 USD	(3 433) SEK	22 avril 2024	(446)	(435)	11	–
A	1 802 USD	(19 045) SEK	22 avril 2024	(2 441)	(2 412)	29	–
A	24 785 USD	(879 388) THB	22 avril 2024	(33 566)	(32 675)	891	–
A	16 146 USD	(572 876) THB	22 avril 2024	(21 866)	(21 286)	580	–
A	2 422 USD	(86 076) THB	22 avril 2024	(3 280)	(3 198)	82	–
A	10 812 USD	(381 334) THB	22 avril 2024	(14 643)	(14 169)	474	–
A	3 836 USD	(135 827) THB	22 avril 2024	(5 195)	(5 047)	148	–
A	1 307 THB	(36) USD	22 avril 2024	49	48	–	(1)
A	222 633 THB	(6 219) USD	22 avril 2024	8 422	8 272	–	(150)
A	38 582 THB	(1 079) USD	22 avril 2024	1 461	1 433	–	(28)
A	164 942 THB	(4 621) USD	22 avril 2024	6 258	6 129	–	(129)
A	4 255 USD	(151 764) THB	22 avril 2024	(5 763)	(5 639)	124	–
A	1 364 USD	(49 138) THB	22 avril 2024	(1 847)	(1 825)	22	–
A	840 USD	(30 471) THB	22 avril 2024	(1 137)	(1 132)	5	–
A	654 193 ZAR	(34 239) USD	22 avril 2024	46 369	46 687	318	–
A	140 130 ZAR	(7 334) USD	22 avril 2024	9 932	10 000	68	–
A	34 007 ZAR	(1 771) USD	22 avril 2024	2 398	2 427	29	–
A	207 966 ZAR	(10 953) USD	22 avril 2024	14 834	14 842	8	–
A	73 530 ZAR	(3 871) USD	22 avril 2024	5 243	5 248	5	–
A	3 929 ZAR	(205) USD	22 avril 2024	277	281	4	–
A	1 704 USD	(32 824) ZAR	22 avril 2024	(2 308)	(2 342)	–	(34)
A	19 828 ZAR	(1 034) USD	22 avril 2024	1 401	1 415	14	–
A	1 864 USD	(35 433) ZAR	22 avril 2024	(2 525)	(2 528)	–	(3)
A	65 871 ZAR	(3 518) USD	22 avril 2024	4 764	4 701	–	(63)

# FONDS MONDIAL MACRO 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	3 143 USD	(59 594) ZAR	22 avril 2024	(4 256)	(4 253)	3	–
A	2 029 USD	(38 632) ZAR	22 avril 2024	(2 748)	(2 757)	–	(9)
<b>Total des contrats de change à terme de gré à gré</b>						<b>29 320</b>	<b>(26 612)</b>
<b>Total des actifs dérivés</b>							<b>38 285</b>
<b>Total des passifs dérivés</b>							<b>(33 970)</b>

## 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.

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.

## NOTES ANNEXES

### 3. Méthodes comptables significatives (suite)

#### b) Évaluation de la juste valeur

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

Les placements dans des titres cotés à une Bourse des valeurs mobilières ou négociés sur un marché hors cote 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.

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.

# FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## NOTES ANNEXES

### 3. Méthodes comptables significatives (suite)

#### c) Comptabilisation des revenus et des charges

Les revenus d'intérêts et les charges d'intérêts aux fins de distribution correspondent à l'intérêt nominal reçu ou payé 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. Le revenu et les charges de dividendes sont constatés à la date ex-dividende. Les dividendes et les intérêts versés découlant de la vente à découvert d'actions et d'obligations sont comptabilisés à l'état du résultat global aux postes Dividendes et Revenu d'intérêts, respectivement. 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 les charges, dans le profit (la perte) réalisé(e) à la vente de placements ou dans le revenu provenant des rabais sur les frais, selon le cas, à la date ex-dividende ou de distribution.

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

#### d) Commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille

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

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

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

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

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

#### f) Compensation

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

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

#### g) Devise

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

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

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

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

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

#### i) Valeur liquidative par titre

La valeur liquidative quotidienne d'un fonds 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.

# FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## NOTES ANNEXES

### 3. Méthodes comptables significatives (suite)

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

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

#### k) Fusions

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

#### l) Frais de vente à découvert et d'emprunt

Le Fonds peut effectuer des ventes à découvert d'actions et d'obligations dans le cadre de sa stratégie de placement globale. Lorsque le Fonds procède à la vente à découvert d'une action ou d'une obligation, il doit emprunter ce titre d'un courtier et verser en échange des frais d'emprunt au courtier, afin de finaliser la vente. Le Fonds peut réaliser un profit sur la vente à découvert si le cours du titre diminue entre le moment de la vente à découvert et la date à laquelle le Fonds dénoue sa position vendeur, en rachetant le titre à un cours inférieur et en le remettant au courtier. Une perte surviendra si le cours du titre augmente. Les restrictions prévues par la stratégie de placement du Fonds en matière de ventes à découvert et d'emprunt comprennent ce qui suit : i) la valeur marchande globale de tous les titres vendus à découvert par le Fonds ne doit pas dépasser 50 % de l'actif net total du Fonds; ii) la valeur marchande globale de tous les titres d'un émetteur en particulier vendus à découvert par le Fonds ne doit pas dépasser 20 % de l'actif net total du Fonds; iii) le Fonds peut emprunter des liquidités correspondant à un maximum de 50 % de sa valeur liquidative; et iv) le recours à la vente à découvert combinée à l'emprunt de liquidités par le Fonds est assujéti à une limite globale de 50 % de sa valeur liquidative. Les profits et les pertes réalisé(e)s sur la vente à découvert d'actions et d'obligations sont comptabilisé(e)s à l'état du résultat global au poste Profit (perte) net(te) réalisé(e).

#### m) 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 assujétiées 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.

## 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 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.

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).

## 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 et titres vendus à découvert, 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. Dans le cas de titres vendus à découvert, la perte pour le Fonds continue d'augmenter, sans limite, au fur et à mesure que la juste valeur de l'élément sous-jacent augmente. Ce risque est atténué au moyen de restrictions quant à la capacité du Fonds de vendre des titres à découvert. Ces restrictions sont décrites à la note 3 I).

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 MONDIAL MACRO 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 MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS AUDITÉS | 31 mars 2024

## NOTES ANNEXES

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

#### c) Prêt de titres

	31 mars 2024	31 mars 2023
	(\$)	(\$)
Valeur des titres prêtés	2 424	8 309
Valeur des biens reçus en garantie	2 547	8 968

	31 mars 2024		31 mars 2023	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
Revenus de prêts de titres bruts	85	100,0	24	100,0
Impôt retenu à la source	(5)	(5,9)	(2)	(8,3)
	80	94,1	22	91,7
Paiements à l'agent de prêt de titres	(14)	(16,5)	(4)	(16,7)
Revenu tiré du prêt de titres	66	77,6	18	75,0

#### d) Commissions

	(\$)
31 mars 2024	22
31 mars 2023	12

#### e) Risques découlant des instruments financiers

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

Le Fonds cherche à procurer un rendement total positif sur un cycle de marché, peu importe la direction générale du marché, en investissant dans des positions acheteur et/ou vendeur sur titres de capitaux propres et titres à revenu fixe; il peut également investir dans des marchandises et/ou des devises. Les stratégies du Fonds comprennent un ensemble de processus qui devraient tirer une valeur des marchés de négociation qui sont animés par les données et les événements macroéconomiques mondiaux, comme les fluctuations des prix des marchandises, des taux de change, ainsi que des marchés boursiers et obligataires. Le Fonds peut également effectuer des ventes à découvert, emprunter des fonds et/ou investir dans des dérivés, comme des contrats à terme standardisés et des contrats à terme de gré à gré. L'exposition globale du Fonds à ses sources de levier correspond à la somme des sources de levier suivantes et ne doit pas dépasser 300 % de sa valeur liquidative : i) la valeur de marché globale des titres vendus à découvert; ii) l'encours total des emprunts aux termes des conventions d'emprunt aux fins de placement; et iii) la valeur notionnelle globale des positions sur dérivés visés du Fonds, à l'exception des dérivés visés utilisés aux fins de couverture.

# FONDS MONDIAL MACRO 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 %	
					(\$)	%	(\$)	%
ZAR	–	812	144 292	145 104				
COP	–	–	140 200	140 200				
JPY	–	69	131 631	131 700				
BRL	–	–	123 449	123 449				
IDR	–	–	109 232	109 232				
MXN	–	(655)	54 721	54 066				
PLN	–	(13)	37 476	37 463				
CLP	–	–	35 407	35 407				
SEK	–	(73)	26 974	26 901				
INR	–	–	23 414	23 414				
EUR	–	133	12 152	12 285				
GBP	–	(55)	7 684	7 629				
SGD	–	1 176	8	1 184				
CHF	–	(355)	133	(222)				
AUD	–	237	(5 649)	(5 412)				
NOK	–	–	(19 470)	(19 470)				
NZD	–	–	(26 095)	(26 095)				
KOR	–	–	(53 281)	(53 281)				
ILS	–	–	(64 146)	(64 146)				
CZK	–	–	(72 936)	(72 936)				
USD	34 257	16 007	(160 509)	(110 245)				
PHP	–	–	(117 183)	(117 183)				
CNY	–	–	(117 446)	(117 446)				
THB	–	64	(121 041)	(120 977)				
<b>Total</b>	<b>34 257</b>	<b>17 347</b>	<b>89 017</b>	<b>140 621</b>				
% de l'actif net	5,2	2,6	13,4	21,2				
<b>Total de la sensibilité aux variations des taux de change</b>					<b>(7 031)</b>	<b>(1,1)</b>	<b>7 031</b>	<b>1,1</b>

# FONDS MONDIAL MACRO 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 %	
					(\$)	%	(\$)	%
MXN	–	(46)	79 097	79 051				
BRL	–	–	54 426	54 426				
COP	–	–	34 878	34 878				
EUR	–	2 354	31 149	33 503				
PLN	–	–	28 572	28 572				
ZAR	–	(400)	24 062	23 662				
IDR	–	–	21 408	21 408				
NOK	–	–	19 819	19 819				
SEK	–	(42)	16 037	15 995				
CLP	–	–	9 704	9 704				
AUD	–	(623)	6 435	5 812				
CHF	–	85	(294)	(209)				
NZD	–	–	(3 308)	(3 308)				
JPY	–	3 030	(7 367)	(4 337)				
CZK	–	–	(10 689)	(10 689)				
ILS	–	–	(14 089)	(14 089)				
GBP	–	389	(17 521)	(17 132)				
USD	25 631	10 039	(55 707)	(20 037)				
THB	–	–	(23 185)	(23 185)				
CNY	–	–	(24 405)	(24 405)				
KOR	–	–	(27 378)	(27 378)				
PHP	–	–	(29 165)	(29 165)				
NTD	–	–	(36 049)	(36 049)				
INR	–	–	(47 602)	(47 602)				
Total	25 631	14 786	28 828	69 245				
% de l'actif net	5,2	3,0	5,9	14,1				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					(4 697)	(1,0)	4 697	1,0

\* Comprend les instruments financiers monétaires et non monétaires.

##### 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.

	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
		Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
31 mars 2024	(\$)	(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	88 084				
1 an à 5 ans	–				
5 ans à 10 ans	–				
Plus de 10 ans	–				
Total	88 084				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt		5 959	0,9	(5 959)	(0,9)

# FONDS MONDIAL MACRO 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 (suite)

31 mars 2023	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
		Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
		(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	(246 403)				
1 an à 5 ans	–				
5 ans à 10 ans	–				
Plus de 10 ans	–				
<b>Total</b>	<b>(246 403)</b>				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt		17 767	3,6	(17 767)	(3,6)

##### iv. Autre risque de prix

Aux 31 mars 2024 et 2023, le Fonds n'avait aucune exposition importante à l'autre risque de prix.

##### v. Risque de crédit

Aux 31 mars 2024 et 2023, le Fonds n'avait aucune exposition importante au risque de crédit.

#### 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 (\$)
Options	–	7 290	–	7 290	–	7 751	–	7 751
Fonds/billets négociés en bourse	26 967	–	–	26 967	17 880	–	–	17 880
Fonds communs de placement	6 858	–	–	6 858	24 889	–	–	24 889
Actifs dérivés	7 809	30 476	–	38 285	2 539	30 970	–	33 509
Passifs dérivés	(7 358)	(26 612)	–	(33 970)	(10 999)	(13 966)	–	(24 965)
Placements à court terme	525 525	39 123	–	564 648	329 074	65 765	–	394 839
<b>Total</b>	<b>559 801</b>	<b>50 277</b>	<b>–</b>	<b>610 078</b>	<b>363 383</b>	<b>90 520</b>	<b>–</b>	<b>453 903</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 des périodes, aucun transfert n'a eu lieu entre le niveau 1 et le niveau 2.

#### 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	23	–
Autres fonds gérés par le gestionnaire	194 819	177 579
Fonds gérés par des sociétés affiliées au gestionnaire	426 146	290 331

#### 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	38 285	(32 693)	–	5 592
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(33 970)	32 693	48 254	46 977
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
<b>Total</b>	<b>4 315</b>	<b>–</b>	<b>48 254</b>	<b>52 569</b>

# FONDS MONDIAL MACRO 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 (suite)

	31 mars 2023			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	7 513	(4 995)	–	2 518
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(13 455)	4 995	31 941	23 481
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	(5 942)	–	31 941	25 999

#### 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 (\$)
iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF	0,0	2 286
iShares TIPS Bond ETF	0,0	3 840
Fonds de lingots d'or Mackenzie, série R	2,7	6 858
SPDR Bloomberg High Yield Bond ETF	0,0	5 041
SPDR S&P Oil & Gas Exploration & Production ETF	0,3	15 800

31 mars 2023	% de l'actif net du Fonds sous-jacent	Juste valeur des placements du Fonds (\$)
Fonds de lingots d'or Mackenzie, série R	9,3	24 889
SPDR S&P Oil & Gas Exploration & Production ETF	0,4	17 880

#### j) Effet de levier

L'effet de levier survient lorsqu'un Fonds emprunte de l'argent ou des titres, ou a recours à des produits dérivés, pour effectuer des placements qui n'auraient autrement pas été possibles. L'exposition globale du Fonds à ses sources de levier est calculée comme étant la somme des éléments suivants : i) la valeur marchande des titres vendeur; ii) le montant en espèces emprunté aux fins de placement; et iii) la valeur notionnelle des positions sur dérivés du Fonds, à l'exception des dérivés utilisés aux fins de couverture. Cette exposition ne peut dépasser 300 % de la valeur liquidative du Fonds.

Au cours de l'exercice clos le 31 mars 2024, l'exposition globale du Fonds aux sources de levier a varié entre 104 % et 233 % de la valeur liquidative du Fonds. Le bas de la fourchette a été atteint en avril 2023 et correspond aux sommes généralement empruntées pour le Fonds. Le haut de la fourchette a été atteint en mars 2024, après que l'équipe de gestion de portefeuille a ajouté davantage de contrats à terme standardisés. Les sources de levier étaient des positions acheteur et vendeur sur contrats à terme standardisés, des options achetées, des swaps et des contrats de change à terme de gré à gré. Incluant la valeur notionnelle des dérivés utilisés aux fins de couverture, les montants de levier minimaux et maximaux ont varié entre 311 % et 518 %.

Au cours de l'exercice clos le 31 mars 2023, l'exposition globale du Fonds aux sources de levier a varié entre 73 % et 190 % de la valeur liquidative du Fonds. Le haut de la fourchette a été atteint en avril 2022, lorsque les positions actives du Fonds ont nécessité un levier accru pour atteindre les objectifs en matière de profil risque/rendement. Le bas de la fourchette a été atteint en juillet 2022, lorsque les expositions dans l'ensemble du portefeuille étaient généralement plus basses en réaction à la volatilité élevée des marchés. Les sources de levier étaient des positions acheteur et vendeur sur contrats à terme standardisés et contrats de change à terme de gré à gré. Incluant la valeur notionnelle des dérivés utilisés aux fins de couverture, les montants de levier minimaux et maximaux ont varié entre 235 % et 331 %.

#### k) Événements postérieurs

Lors d'une assemblée qui s'est tenue le 31 mai 2024, les investisseurs du Fonds multistratégie à rendement absolu Mackenzie (le « Fonds dissous ») ont approuvé une proposition de fusion du Fonds dissous avec le Fonds en date du 11 octobre 2024, ou vers cette date, après avoir reçu une recommandation positive du comité d'examen indépendant de Mackenzie de réaliser la fusion proposée. Après la fusion proposée, le Fonds dissous sera dissous. Les charges engagées pour réaliser la fusion proposée seront acquittées par Mackenzie.

#### l) Placements donnés en garantie

Au 31 mars 2024, 654 \$ (néant au 31 mars 2023) ont été reçus en garantie de Morgan Stanley et de J.P. Morgan en contrepartie de contrats à terme de gré à gré.