

## **États financiers intermédiaires non audités**

*Pour la période de six mois close le 30 septembre 2024*

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

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

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

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

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



# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

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

	30 sept. 2024	31 mars 2024 (Audité)		Actif net attribuable aux porteurs de titres (note 3)			
				par titre		par série	
	\$	\$		30 sept. 2024	31 mars 2024 (Audité)	30 sept. 2024	31 mars 2024 (Audité)
<b>ACTIF</b>							
<b>Actifs courants</b>							
Placements à la juste valeur	1 148 937	1 432 378	Série A	12,88	12,41	7 454	8 462
Trésorerie et équivalents de trésorerie	43 335	13 572	Série AR	9,49	9,15	9 835	10 014
Intérêts courus à recevoir	10 440	12 612	Série B	9,36	9,02	920	1 044
Sommes à recevoir pour placements vendus	692	16 289	Série C	9,35	9,01	85	89
Sommes à recevoir pour titres émis	6	214	Série CL	10,22	9,85	1	215 122
Sommes à recevoir du gestionnaire	11	12	Série D	9,33	9,00	6 124	5 919
Marge sur instruments dérivés	3 173	6 366	Série F	10,96	10,56	41 513	40 386
Actifs dérivés	2 110	156	Série FB	9,39	9,05	436	485
<b>Total de l'actif</b>	<b>1 208 704</b>	<b>1 481 599</b>	Série G	10,06	9,70	170	169
			Série I	5,40	5,21	2 145	2 367
			Série IG	9,40	9,06	251 416	254 505
			Série J	10,18	9,82	288	274
<b>PASSIF</b>			Série M	10,53	10,15	63	60
<b>Passifs courants</b>			Série O	10,88	10,49	6 972	6 549
Sommes à payer pour placements achetés	12 105	16 374	Série PW	9,73	9,38	85 886	94 969
Sommes à payer pour titres rachetés	62	651	Série PWFB	9,30	8,96	2 511	2 273
Sommes à payer au gestionnaire	23	25	Série PWR	9,25	8,92	4 984	4 092
Obligation pour options vendues	59	–	Série PWT8	7,29	7,22	254	244
Passifs dérivés	29	1 218	Série PWX	9,39	9,05	698	664
<b>Total du passif</b>	<b>12 278</b>	<b>18 268</b>	Série R	10,22	9,85	698 741	672 501
<b>Actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>1 196 426</b>	<b>1 463 331</b>	Série S	–	9,61	–	61 451
			Série SC	9,57	9,22	69 151	74 738
			Série U	9,35	9,02	861	979
			Série Investisseur	9,89	9,53	275	286
			Série-B	9,79	9,43	4	4
			Série LB	9,35	9,02	1 095	1 049
			Série LF	9,08	8,75	843	650
			Série LW	9,37	9,03	3 701	3 986
						<b>1 196 426</b>	<b>1 463 331</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

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

	2024 \$	2023 \$	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation (note 3)			
			par titre		par série	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>Revenus</b>						
Dividendes	23	874				
Revenus d'intérêts aux fins de distribution	27 369	27 092				
Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets						
Profit (perte) net(te) réalisé(e)	(7 025)	(34 391)				
Profit (perte) net(te) latent(e)	53 707	(57 092)				
Revenu tiré du prêt de titres	24	75				
Revenu provenant des rabais sur les frais	65	76				
<b>Total des revenus (pertes)</b>	<b>74 163</b>	<b>(63 366)</b>				
<b>Charges (note 6)</b>						
Frais de gestion	1 201	1 252				
Rabais sur les frais de gestion	(1)	(5)				
Frais d'administration	218	233				
Intérêts débiteurs	5	4				
Commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille	26	31				
Frais du comité d'examen indépendant	2	2				
<b>Charges avant les montants absorbés par le gestionnaire</b>	<b>1 451</b>	<b>1 517</b>				
Charges absorbées par le gestionnaire	–	–				
<b>Charges nettes</b>	<b>1 451</b>	<b>1 517</b>				
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, avant impôt</b>	<b>72 712</b>	<b>(64 883)</b>				
Charge (économie) d'impôt étranger retenu à la source	6	1				
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>72 706</b>	<b>(64 884)</b>				
Série A	0,60	(0,60)	379	(513)		
Série AR	0,45	(0,46)	475	(503)		
Série B	0,44	(0,44)	46	(64)		
Série C	0,45	(0,44)	4	(4)		
Série CL	0,27	(0,41)	3 672	(9 323)		
Série D	0,49	(0,43)	319	(229)		
Série F	0,57	(0,48)	2 124	(2 647)		
Série FB	0,63	(0,42)	106	(26)		
Série G	0,50	(0,47)	9	(11)		
Série I	0,27	(0,24)	118	(129)		
Série IG	0,52	(0,38)	14 387	(11 451)		
Série J	0,51	(0,45)	14	(14)		
Série M	0,53	(0,47)	3	(3)		
Série O	0,62	(0,44)	391	(292)		
Série PW	0,45	(0,45)	3 969	(3 894)		
Série PWFB	0,72	(0,39)	522	(134)		
Série PWR	0,48	(0,43)	247	(167)		
Série PWT8	0,37	(0,36)	14	(12)		
Série PWX	0,53	(0,40)	39	(31)		
Série R	0,58	(0,42)	39 329	(28 540)		
Série S	0,45	(0,40)	2 766	(2 914)		
Série SC	0,46	(0,45)	3 423	(3 629)		
Série U	0,46	(0,42)	47	(56)		
Série Investisseur	0,50	(0,45)	14	(17)		
Série-B	0,55	(0,25)	–	(1)		
Série Conseiller	–	(0,43)	–	(1)		
Série LB	0,46	(0,43)	54	(70)		
Série LF	0,49	(0,27)	42	(11)		
Série LW	0,46	(0,43)	193	(198)		
			<b>72 706</b>	<b>(64 884)</b>		

# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE LA SITUATION FINANCIÈRE

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

	Total		Série A		Série AR		Série B		Série C	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	1 463 331	1 508 372	8 462	11 557	10 014	10 056	1 044	1 431	89	90
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	72 706	(64 884)	379	(513)	475	(503)	46	(64)	4	(4)
Distributions versées aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(26 703)	(25 045)	(96)	(96)	(116)	(89)	(12)	(13)	(1)	(1)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(7)	(7)	–	–	–	–	–	–	–	–
Rabais sur les frais de gestion	(1)	(5)	–	–	–	–	–	–	–	–
Total des distributions versées aux porteurs de titres	(26 711)	(25 057)	(96)	(96)	(116)	(89)	(12)	(13)	(1)	(1)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	71 923	88 480	166	222	533	448	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	26 597	9 149	80	82	116	89	11	12	1	1
Paiements au rachat de titres	(411 420)	(78 268)	(1 537)	(2 288)	(1 187)	(516)	(169)	(212)	(8)	(2)
Total des opérations sur les titres	(312 900)	19 361	(1 291)	(1 984)	(538)	21	(158)	(200)	(7)	(1)
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>(266 905)</b>	<b>(70 580)</b>	<b>(1 008)</b>	<b>(2 593)</b>	<b>(179)</b>	<b>(571)</b>	<b>(124)</b>	<b>(277)</b>	<b>(4)</b>	<b>(6)</b>
<b>À la clôture</b>	<b>1 196 426</b>	<b>1 437 792</b>	<b>7 454</b>	<b>8 964</b>	<b>9 835</b>	<b>9 485</b>	<b>920</b>	<b>1 154</b>	<b>85</b>	<b>84</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>										
<b>Titres en circulation, à l'ouverture</b>			<b>682</b>	<b>922</b>	<b>1 094</b>	<b>1 088</b>	<b>116</b>	<b>157</b>	<b>10</b>	<b>10</b>
Émis			13	18	58	49	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions			6	7	13	10	1	1	–	–
Rachetés			(122)	(187)	(129)	(57)	(19)	(23)	(1)	–
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>			<b>579</b>	<b>760</b>	<b>1 036</b>	<b>1 090</b>	<b>98</b>	<b>135</b>	<b>9</b>	<b>10</b>

  

	Série CL		Série D		Série F		Série FB		Série G	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	215 122	215 276	5 919	4 703	40 386	56 869	485	586	169	213
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	3 672	(9 323)	319	(229)	2 124	(2 647)	106	(26)	9	(11)
Distributions versées aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(2 925)	(3 910)	(98)	(67)	(682)	(826)	(27)	(8)	(2)	(2)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Total des distributions versées aux porteurs de titres	(2 925)	(3 910)	(98)	(67)	(682)	(826)	(27)	(8)	(2)	(2)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	1 201	15 560	350	869	7 061	7 565	8 337	91	–	–
Réinvestissement des distributions	2 925	–	96	66	650	797	27	8	2	2
Paiements au rachat de titres	(219 994)	(7 464)	(462)	(232)	(8 026)	(4 969)	(8 492)	(109)	(8)	(13)
Total des opérations sur les titres	(215 868)	8 096	(16)	703	(315)	3 393	(128)	(10)	(6)	(11)
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>(215 121)</b>	<b>(5 137)</b>	<b>205</b>	<b>407</b>	<b>1 127</b>	<b>(80)</b>	<b>(49)</b>	<b>(44)</b>	<b>1</b>	<b>(24)</b>
<b>À la clôture</b>	<b>1</b>	<b>210 139</b>	<b>6 124</b>	<b>5 110</b>	<b>41 513</b>	<b>56 789</b>	<b>436</b>	<b>542</b>	<b>170</b>	<b>189</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>										
<b>Titres en circulation, à l'ouverture</b>			<b>21 841</b>	<b>21 636</b>	<b>658</b>	<b>518</b>	<b>3 824</b>	<b>5 331</b>	<b>54</b>	<b>64</b>
Émis			122	1 570	38	98	659	724	938	10
Réinvestissement des distributions			298	–	11	7	61	77	3	1
Rachetés			(22 261)	(764)	(51)	(26)	(755)	(475)	(949)	(12)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>			<b>–</b>	<b>22 442</b>	<b>656</b>	<b>597</b>	<b>3 789</b>	<b>5 657</b>	<b>46</b>	<b>63</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.



# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

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

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

	Série R		Série S		Série SC		Série U		Série Investisseur	
	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>672 501</b>	<b>669 442</b>	<b>61 451</b>	<b>71 427</b>	<b>74 738</b>	<b>76 077</b>	<b>979</b>	<b>1 295</b>	<b>286</b>	<b>364</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	39 329	(28 540)	2 766	(2 914)	3 423	(3 629)	47	(56)	14	(17)
Distributions versées aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(13 937)	(11 894)	(1 027)	(1 212)	(960)	(811)	(13)	(13)	(4)	(4)
Gains en capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Rabais sur les frais de gestion	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Total des distributions versées aux porteurs de titres	(13 937)	(11 894)	(1 027)	(1 212)	(960)	(811)	(13)	(13)	(4)	(4)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	26 276	41 855	346	321	7 283	10 520	-	-	-	2
Réinvestissement des distributions	13 937	-	1 027	1 212	936	789	13	13	3	4
Paiements au rachat de titres	(39 365)	(18 259)	(64 563)	(3 359)	(16 269)	(13 124)	(165)	(168)	(24)	(41)
Total des opérations sur les titres	848	23 596	(63 190)	(1 826)	(8 050)	(1 815)	(152)	(155)	(21)	(35)
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>26 240</b>	<b>(16 838)</b>	<b>(61 451)</b>	<b>(5 952)</b>	<b>(5 587)</b>	<b>(6 255)</b>	<b>(118)</b>	<b>(224)</b>	<b>(11)</b>	<b>(56)</b>
<b>À la clôture</b>	<b>698 741</b>	<b>652 604</b>	<b>-</b>	<b>65 475</b>	<b>69 151</b>	<b>69 822</b>	<b>861</b>	<b>1 071</b>	<b>275</b>	<b>308</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>
Titres en circulation, à l'ouverture	68 275	67 280	6 397	7 361	8 103	8 166	109	142	30	38
Émis	2 648	4 291	36	34	785	1 146	-	-	-	-
Réinvestissement des distributions	1 404	-	107	128	101	87	1	1	-	-
Rachetés	(3 953)	(1 877)	(6 540)	(353)	(1 762)	(1 436)	(18)	(18)	(2)	(4)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>68 374</b>	<b>69 694</b>	<b>-</b>	<b>7 170</b>	<b>7 227</b>	<b>7 963</b>	<b>92</b>	<b>125</b>	<b>28</b>	<b>34</b>

  

	Série-B		Série Conseiller		Série LB		Série LF		Série LW	
	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>4</b>	<b>78</b>	<b>-</b>	<b>32</b>	<b>1 049</b>	<b>1 510</b>	<b>650</b>	<b>596</b>	<b>3 986</b>	<b>4 390</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	-	(1)	-	(1)	54	(70)	42	(11)	193	(198)
Distributions versées aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	-	(1)	-	-	(14)	(15)	(13)	(5)	(54)	(46)
Gains en capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Rabais sur les frais de gestion	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Total des distributions versées aux porteurs de titres	-	(1)	-	-	(14)	(15)	(13)	(5)	(54)	(46)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	-	-	-	-	126	25	156	82	225	92
Réinvestissement des distributions	-	1	-	-	14	15	13	5	49	42
Paiements au rachat de titres	-	(73)	-	(20)	(134)	(215)	(5)	(402)	(698)	(423)
Total des opérations sur les titres	-	(72)	-	(20)	6	(175)	164	(315)	(424)	(289)
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>-</b>	<b>(74)</b>	<b>-</b>	<b>(21)</b>	<b>46</b>	<b>(260)</b>	<b>193</b>	<b>(331)</b>	<b>(285)</b>	<b>(533)</b>
<b>À la clôture</b>	<b>4</b>	<b>4</b>	<b>-</b>	<b>11</b>	<b>1 095</b>	<b>1 250</b>	<b>843</b>	<b>265</b>	<b>3 701</b>	<b>3 857</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>
Titres en circulation, à l'ouverture	-	8	-	3	116	166	74	67	441	481
Émis	-	-	-	-	14	2	19	9	26	10
Réinvestissement des distributions	-	-	-	-	2	2	1	1	5	5
Rachetés	-	(8)	-	(2)	(15)	(24)	(1)	(45)	(77)	(47)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>1</b>	<b>117</b>	<b>146</b>	<b>93</b>	<b>32</b>	<b>395</b>	<b>449</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

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

	2024 \$	2023 \$
<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	72 706	(64 884)
Ajustements pour :		
Perte (profit) net(te) réalisé(e) sur les placements	9 111	29 707
Variation de la perte (du profit) net(te) latent(e) sur les placements	(53 707)	57 092
Achat de placements	(399 548)	(661 750)
Produit de la vente et de l'échéance de placements	549 737	628 554
(Augmentation) diminution des sommes à recevoir et autres actifs	5 366	2 831
Augmentation (diminution) des sommes à payer et autres passifs	(2)	(1)
<b>Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités d'exploitation</b>	<b>183 663</b>	<b>(8 451)</b>
<b>Flux de trésorerie liés aux activités de financement</b>		
Produit de l'émission de titres	58 653	82 154
Paiements au rachat de titres	(212 448)	(71 967)
Distributions versées, déduction faite des réinvestissements	(114)	(15 908)
<b>Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités de financement</b>	<b>(153 909)</b>	<b>(5 721)</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>	<b>29 754</b>	<b>(14 172)</b>
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à l'ouverture	13 572	14 966
Incidence des fluctuations des taux de change sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie	9	114
<b>Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture</b>	<b>43 335</b>	<b>908</b>
Trésorerie	16 623	908
Équivalents de trésorerie	26 712	–
<b>Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture</b>	<b>43 335</b>	<b>908</b>
<b>Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :</b>		
Dividendes reçus	23	641
Impôts étrangers payés	6	1
Intérêts reçus	29 541	25 808
Intérêts versés	5	4

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N <sup>bre</sup> d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS</b>					
407 International Inc. 1,80 % 22-05-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 430 000	1 451	1 412
407 International Inc. 4,22 % 14-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 180 000	1 180	1 204
407 International Inc. 3,14 % 06-03-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	369 000	366	364
407 International Inc. 3,43 % 01-06-2033, série MTN	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 309 000	3 379	3 208
407 International Inc. 3,60 % 21-05-2047, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 281 000	2 143	1 976
407 International Inc. 3,67 % 08-03-2049, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 706 000	2 324	2 361
407 International Inc. 4,86 % 31-07-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	430 000	429	452
407 International Inc. 4,68 % 07-10-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	360 000	366	368
Access Justice Durham 5,02 % 31-08-2039	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 882 239	1 935	1 961
AerCap Ireland Capital DAC 3,00 % 29-10-2028	Irlande	Sociétés – Non convertibles	1 096 000 USD	1 265	1 401
Aéroports de Montréal 6,55 % 11-10-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	140 000	165	164
Aéroports de Montréal 3,92 % 12-06-2045, rachetables 2044	Canada	Sociétés – Non convertibles	227 000	211	210
Aéroports de Montréal 3,36 % 24-04-2047, rachetables 2046	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 278 000	998	1 079
Aéroports de Montréal 3,03 % 21-04-2050, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	246 000	192	194
AES Andes SA 6,30 % 15-03-2029	Chili	Sociétés – Non convertibles	802 000 USD	1 083	1 127
AIMCo Realty Investors LP 2,20 % 04-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	930 000	930	907
AIMCo Realty Investors LP 2,71 % 01-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 846 000	2 760	2 727
Air Lease Corp. 5,40 % 01-06-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 600 000	2 608	2 724
Alectra Inc. 3,24 % 21-11-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	510 000	533	509
Alectra Inc. 1,75 % 11-02-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	735 000	645	657
Alectra Inc. 4,63 % 13-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	518 000	518	542
Algonquin Power & Utilities Corp. 4,09 % 17-02-2027, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 626 000	1 627	1 644
Algonquin Power & Utilities Corp. 4,60 % 29-01-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	542 000	530	563
Algonquin Power & Utilities Corp. 2,85 % 15-07-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 953 000	3 500	3 891
Alimentation Couche-Tard inc. 2,95 % 25-01-2030, rachetables 2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	438 000 USD	575	548
Alimentation Couche-Tard inc. 5,59 % 25-09-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 473 000	1 473	1 589
AltaLink, L.P. 4,74 % 22-05-2054	Canada	Sociétés – Non convertibles	535 000	535	555
AltaLink, L.P. 5,46 % 11-10-2055	Canada	Sociétés – Non convertibles	547 000	547	632
Amazon.com Inc. 4,70 % 01-12-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 760 000 USD	2 391	2 474
American Tower Corp. 1,88 % 15-10-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	940 000 USD	1 252	1 096
Anglian Water Services Financing PLC 4,53 % 26-08-2032	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	591 000	591	587
ARC Resources Ltd. 3,47 % 10-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	240 000	230	230
AT&T Inc. 4,85 % 25-05-2047	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	812 000	726	777
ATCO Ltd., taux variable 01-11-2078, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 230 000	1 209	1 253
Athene Global Funding 3,13 % 10-03-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	900 000	900	897
Athene Global Funding 2,10 % 24-09-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 580 000	1 578	1 554
Athene Global Funding 2,47 % 09-06-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	459 000	413	437
Athene Global Funding 5,11 % 07-03-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	820 000	820	856
Avolon Holdings Funding Ltd. 5,75 % 01-03-2029 144A	Irlande	Sociétés – Non convertibles	1 540 000 USD	2 061	2 146
Bank of America Corp., taux variable 15-09-2027 (taux variable différé)	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 555 000	1 528	1 506
Bank of America Corp., taux variable 16-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	5 453 000	5 201	5 448
Banque de Montréal 3,65 % 01-04-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	648 000	637	651
Banque de Montréal 4,71 % 07-12-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 775 000	4 760	4 940
Banque de Montréal 3,19 % 01-03-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 990 000	3 951	3 975
Banque de Montréal 4,54 % 18-12-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 250 000	1 250	1 294
Banque de Montréal 4,42 % 17-07-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 950 000	2 950	3 046
Banque de Montréal, taux variable 27-10-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 847 000	1 883	1 988
Banque de Montréal, taux variable 07-09-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 024 000	4 015	4 317
Banque de Montréal, taux variable 03-07-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 420 000	1 420	1 474
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 104 000	3 062	3 066
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 236 000	4 238	4 436
La Banque de Nouvelle-Écosse 6,45 % 01-01-2025	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	660 319	694	663
La Banque de Nouvelle-Écosse 1,95 % 10-01-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 390 000	3 263	3 371
La Banque de Nouvelle-Écosse 2,16 % 03-02-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 146 000	1 092	1 139
La Banque de Nouvelle-Écosse 5,50 % 29-12-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 467 000	5 502	5 585
La Banque de Nouvelle-Écosse 5,50 % 08-05-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 032 000	3 046	3 121
La Banque de Nouvelle-Écosse 4,68 % 01-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 590 000	1 590	1 657
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 26-09-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 106 000	1 107	1 110
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 03-05-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 308 000	1 308	1 312
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 02-08-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	900 000	900	954

# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 01-08-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 210 000	1 208	1 255
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 27-07-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 725 000	3 703	3 854
BCE Inc. 2,20 % 29-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	407 000	404	389
BCE Inc. 3,00 % 17-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 124 000	997	1 063
BCI QuadReal Realty 2,55 % 24-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 052 000	2 020	2 021
bclMC Realty Corp. 1,07 % 04-02-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	465 000	465	450
Becle SAB de CV 2,50 % 14-10-2031	Mexique	Sociétés – Non convertibles	1 170 000 USD	1 466	1 318
Bell Canada 4,45 % 27-02-2047, rachetables 2046	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 250 000	2 365	2 053
Bell Canada 5,15 % 14-11-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 862 000	1 873	1 958
Bell Canada 5,25 % 15-03-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 330 000	1 329	1 409
Compagnie de téléphone Bell du Canada 5,15 % 24-08-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 089 000	1 085	1 149
Compagnie de téléphone Bell du Canada 5,15 % 09-02-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	703 000	680	710
Bimbo Bakeries USA Inc. 6,05 % 15-01-2029	Mexique	Sociétés – Non convertibles	920 000 USD	1 271	1 316
BP Capital Markets PLC 3,47 % 15-05-2025	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	1 889 000	1 904	1 884
British Columbia Investment Management 4,90 % 02-06-2033	Canada	Gouvernements provinciaux	4 137 000	4 321	4 549
Broadcom Inc. 4,11 % 15-09-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 310 000 USD	1 670	1 770
Brookfield Infrastructure Finance ULC 5,62 % 14-11-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 519 000	1 519	1 601
Brookfield Infrastructure Finance ULC 4,20 % 11-09-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 147 000	2 124	2 177
Brookfield Infrastructure Finance ULC 2,86 % 01-09-2032, rachetables 2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	253 000	253	229
Brookfield Renewable Energy Partners ULC 3,63 % 15-01-2027, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 502 000	3 484	3 504
Brookfield Renewable Partners ULC 4,25 % 15-01-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 762 000	1 784	1 794
Brookfield Renewable Partners ULC 5,29 % 28-10-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	444 000	468	474
Brookfield Renewable Partners ULC 4,96 % 20-10-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	820 000	820	850
Bruce Power L.P. 4,00 % 21-06-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 677 000	2 637	2 693
Bruce Power L.P. 4,99 % 21-12-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	280 000	280	295
CAE Inc. 5,54 % 12-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	790 000	790	829
Administration aéroportuaire de Calgary 3,55 % 07-10-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	465 000	406	399
Administration aéroportuaire de Calgary 3,55 % 07-10-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	440 000	356	376
Corporation Cameco 4,94 % 24-05-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	560 000	560	586
Investissements RPC 2,25 % 01-12-2031	Canada	Gouvernement fédéral	4 780 000	4 733	4 465
Canadian Core Real Estate LP 3,30 % 02-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 010 000	1 010	989
Banque Canadienne Impériale de Commerce 2,00 % 17-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 517 000	2 517	2 492
Banque Canadienne Impériale de Commerce 1,10 % 19-01-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	531 000	524	515
Banque Canadienne Impériale de Commerce 5,05 % 07-10-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 005 000	1 001	1 047
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 21-04-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	920 000	920	897
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 07-04-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	999 000	988	1 007
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 20-01-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 180 000	1 180	1 230
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 20-04-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 070 000	1 069	1 118
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 16-01-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 320 000	1 320	1 385
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 12-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 490 000	1 488	1 541
Banque Canadienne Impériale de Commerce 4,38 % 28-10-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 237 000	2 187	2 213
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 28-07-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	995 000	993	1 031
Fonds hypothécaire Canada 3,84 % 01-11-2028	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	5 144 242	4 995	5 229
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada 4,40 % 10-05-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	870 000	868	904
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 2,54 % 28-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 473 000	4 222	4 353
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 3,15 % 13-03-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 616 000	1 581	1 594
Canadian Utilities Ltd. 4,85 % 03-06-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 085 000	1 077	1 106
Banque canadienne de l'Ouest 2,61 % 30-01-2025, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	610 000	625	607
Banque canadienne de l'Ouest 3,86 % 21-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 520 000	1 520	1 519
Banque canadienne de l'Ouest 5,26 % 20-12-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	480 000	480	488

# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Banque canadienne de l'Ouest 1,93 % 16-04-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 310 000	1 310	1 279
Banque canadienne de l'Ouest 5,15 % 02-09-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 470 000	2 473	2 582
Banque canadienne de l'Ouest 4,57 % 11-07-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	300 000	300	310
Banque canadienne de l'Ouest, taux variable 22-12-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	520 000	520	548
Banque canadienne de l'Ouest 5,95 % 29-01-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	720 000	720	768
Capital Power Corp. 4,99 % 23-01-2026, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 086 000	1 086	1 097
Capital Power Corp. 4,83 % 16-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 499 000	1 499	1 520
CCL Industries Inc. 3,86 % 13-04-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 290 000	1 290	1 288
CDP Financière inc. 4,20 % 02-12-2030	Canada	Gouvernements provinciaux	2 872 000	2 902	3 026
Cenovus Energy Inc. 3,50 % 07-02-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 399 000	1 359	1 392
Central 1 Credit Union 5,88 % 10-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	650 000	650	676
CGI inc. 3,99 % 07-09-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	850 000	850	860
CGI inc. 4,15 % 05-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	610 000	610	619
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 2,46 % 30-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	520 000	520	508
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 2,85 % 21-05-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 008 000	1 032	989
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 3,53 % 11-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 184 000	3 986	4 116
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 5,40 % 01-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 992 000	1 996	2 115
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 5,70 % 28-02-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	745 000	740	806
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 5,03 % 28-02-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	310 000	310	324
Ville de Toronto 2,60 % 24-09-2039	Canada	Administrations municipales	1 180 000	1 172	975
Coast Capital Savings Federal Credit Union 7,01 % 28-09-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 260 000	1 260	1 320
Coastal GasLink Pipeline LP 4,69 % 30-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	640 000	640	669
Coastal GasLink Pipeline LP 4,91 % 30-06-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	940 000	940	993
Coastal GasLink Pipeline LP 5,19 % 30-09-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	770 000	770	823
Cogeco Communications inc. 5,30 % 16-02-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	400 000	400	420
Comber Wind Financial Corp. 5,13 % 15-11-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	211 529	237	215
Constellation Software Inc. 5,16 % 16-02-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	210 000 USD	283	293
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	785 118	785	767
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-09-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	793 573	794	777
Corp. Nacional del Cobre de Chile 4,50 % 16-09-2025	Chili	Sociétés – Non convertibles	480 000 USD	639	647
CPPIB Capital Inc. 3,95 % 02-06-2032	Canada	Gouvernement fédéral	1 747 000	1 737	1 815
Fonds de placement immobilier Crombie 3,92 % 21-06-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	324 000	340	325
Fonds de placement immobilier Crombie 2,69 % 31-03-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	860 000	865	824
Fonds de placement immobilier Crombie 3,21 % 09-10-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 304 000	1 283	1 227
Fonds de placement immobilier Crombie 3,13 % 12-08-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	472 000	458	436
CU Inc. 4,09 % 02-09-2044, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	245 000	235	230
CU Inc. 4,77 % 14-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 019 000	1 018	1 055
CU Inc. 5,09 % 20-09-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	980 000	980	1 065
Dollarama inc. 5,08 % 27-10-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	943 000	940	955
Dollarama inc. 5,53 % 26-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 050 000	1 050	1 122
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 1,66 % 22-12-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 180 000	1 179	1 149
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,54 % 07-12-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	700 000	700	681
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,06 % 17-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 120 000	1 073	1 069
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 5,38 % 22-03-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	960 000	963	1 002
Électricité de France SA 4,50 % 21-09-2028 144A	France	Sociétés – Non convertibles	278 000 USD	367	377
L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie 5,50 % 13-01-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	610 000	610	634
L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie 3,63 % 17-04-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	531 000	531	458
Empresas CMPC SA 3,00 % 06-04-2031	Chili	Sociétés – Non convertibles	400 000 USD	499	480
Enbridge Gas Inc. 2,37 % 09-08-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 021 000	980	970
Enbridge Gas Inc. 2,35 % 15-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	458 000	383	418
Enbridge Gas Inc. 5,70 % 06-10-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 305 000	1 345	1 464
Enbridge Gas Inc. 3,20 % 15-09-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 140 000	1 975	1 672

# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N <sup>bre</sup> d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Enbridge Gas Inc. 4,55 % 17-08-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 490 000	2 375	2 461
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 887 000	10 731	10 903
Enbridge Inc., taux variable 12-04-2078, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 631 000	4 661	4 845
Enbridge Inc., taux variable 15-01-2084, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	430 000	448	474
Enbridge Inc., taux variable 15-01-2084, rachetables 2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 088 000	1 113	1 269
Pipelines Enbridge Inc. 4,55 % 29-09-2045, rachetables 2045	Canada	Sociétés – Non convertibles	380 000	340	353
Pipelines Enbridge Inc. 4,33 % 22-02-2049, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	745 000	724	666
Pipelines Enbridge Inc. 5,82 % 17-08-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	327 000	350	363
Enel Finance International NV 5,00 % 15-06-2032 144A	Italie	Sociétés – Non convertibles	160 000 USD	197	219
Énergir inc. 2,10 % 16-04-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	800 000	800	774
Énergir inc. 4,67 % 27-09-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	760 000	760	797
EPCOR Utilities Inc. 3,55 % 27-11-2047, rachetables 2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 560 000	1 544	1 339
EPCOR Utilities Inc. 3,11 % 08-07-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 394 000	2 254	1 886
EPCOR Utilities Inc. 4,73 % 02-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 030 000	1 030	1 060
EPCOR Utilities Inc. 5,33 % 03-10-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 031 000	2 103	2 287
EPCOR Utilities Inc. 4,99 % 31-05-2054	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 100 000	1 100	1 180
Banque Équitable 1,88 % 26-11-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	172 000	154	168
Banque Équitable 3,36 % 02-03-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	788 000	788	781
Banque Équitable 5,16 % 11-01-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 190 000	1 190	1 223
Banque Équitable 3,99 % 24-03-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	691 000	691	692
Fairfax Financial Holdings Ltd. 8,30 % 15-04-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 180 000 USD	3 294	3 105
Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,23 % 14-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 220 000	1 204	1 237
Fairfax Financial Holdings Ltd. 3,95 % 03-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 766 000	1 740	1 750
Fédération des caisses Desjardins du Québec 5,20 % 01-10-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 279 000	1 280	1 296
Fédération des caisses Desjardins du Québec 1,59 % 10-09-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 528 000	1 427	1 480
Fédération des caisses Desjardins du Québec 4,41 % 19-05-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 051 000	1 052	1 075
Fédération des caisses Desjardins du Québec 5,47 % 17-11-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 049 000	2 076	2 190
Fédération des caisses Desjardins du Québec 3,80 % 24-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	870 000	870	874
Fédération des caisses Desjardins du Québec, taux variable 26-05-2030, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 065 000	1 111	1 057
Fédération des caisses Desjardins du Québec, taux variable 23-08-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 560 000	2 560	2 640
Fédération des caisses Desjardins du Québec, taux variable 15-05-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 390 000	1 390	1 459
Fonds de placement immobilier First Capital 3,45 % 01-03-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	660 000	584	648
Fonds de placement immobilier First Capital 5,46 % 12-06-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	450 000	451	472
First Capital Realty Inc. 5,57 % 01-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 996 000	3 045	3 185
First West Credit Union 9,19 % 09-08-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	760 000	760	845
Compagnie Crédit Ford du Canada 6,33 % 10-11-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	790 000	790	823
Compagnie Crédit Ford du Canada 5,58 % 22-02-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	670 000	670	689
Compagnie Crédit Ford du Canada 5,24 % 23-05-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	860 000	860	883
Compagnie Crédit Ford du Canada 5,44 % 09-02-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	308 000	308	319
Compagnie Crédit Ford du Canada 4,79 % 12-09-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	640 000	640	645
Fortis Inc. 4,43 % 31-05-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 980 000	1 975	2 041
Fortis Inc. 4,17 % 09-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 310 000	1 311	1 322
Fortis Inc. 5,68 % 08-11-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 160 000	1 160	1 281
FortisBC Energy Inc. 4,67 % 28-11-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	282 000	284	288
Financière General Motors du Canada Ltée 5,20 % 09-02-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	640 000	640	664
Financière General Motors du Canada Ltée 5,10 % 14-07-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	813 000	811	844
Financière General Motors du Canada Ltée 5,00 % 09-02-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	830 000	829	859
George Weston Ltée 4,19 % 05-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	710 000	711	721
Gibson Energy Inc. 5,75 % 12-07-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 065 000	1 069	1 162
Glencore Funding LLC 5,34 % 04-04-2027 144A	Australie	Sociétés – Non convertibles	410 000 USD	557	568
Glencore Funding LLC 5,70 % 08-05-2033 144A	Australie	Sociétés – Non convertibles	841 000 USD	1 161	1 195
The Goldman Sachs Group Inc. 3,31 %, taux variable 31-10-2025, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 840 000	1 986	1 838
The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 30-11-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 120 000	2 120	2 075
The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 28-02-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	842 000	842	798
Gouvernement du Canada 3,25 % 01-09-2028	Canada	Gouvernement fédéral	567 000	557	578

# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Gouvernement du Canada 2,25 % 01-12-2029	Canada	Gouvernement fédéral	4 430 000	4 411	4 335
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-06-2033	Canada	Gouvernement fédéral	10 783 000	10 185	10 665
Gouvernement du Canada 3,50 % 01-03-2034	Canada	Gouvernement fédéral	6 518 000	6 493	6 829
Gouvernement du Canada 3,00 % 01-06-2034	Canada	Gouvernement fédéral	58 447 000	56 261	58 696
Gouvernement du Canada 0,50 % 01-12-2050, rendement réel	Canada	Gouvernement fédéral	11 544 000	13 479	11 322
Obligations du gouvernement du Canada indexées sur l'inflation 0,25 % 01-12-2054	Canada	Gouvernement fédéral	3 776 000	3 060	3 135
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-12-2055	Canada	Gouvernement fédéral	48 201 000	43 423	44 554
Fiducie de placement immobilier Granite 3,06 % 04-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	924 000	863	909
Fiducie de placement immobilier Granite 2,19 % 30-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 696 000	1 616	1 595
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 1,54 % 03-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 517 000	1 338	1 428
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 7,05 % 12-06-2030, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	959 000	1 095	1 115
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 7,10 % 04-06-2031, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	959 000	1 112	1 136
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 6,47 % 02-02-2034, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	285 000	330	337
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 2,75 % 17-10-2039	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 934 000	3 162	3 239
Fonds de placement immobilier H&R 4,07 % 16-06-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 451 000	1 470	1 449
Heathrow Funding Ltd. 3,25 % 21-05-2025	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	3 630 000	3 707	3 612
Heathrow Funding Ltd. 2,69 % 13-10-2027	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	736 000	736	717
Heathrow Funding Ltd. 3,40 % 08-03-2028	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	2 200 000	2 197	2 181
Heathrow Funding Ltd. 3,79 % 04-09-2030, rachetables 2030	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	2 047 000	2 021	2 019
Heathrow Funding Ltd. 3,73 % 13-04-2033	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	2 957 000	2 783	2 815
Banque HSBC Canada 3,40 % 24-03-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 940 000	1 938	1 937
Hydro One Inc. 4,91 % 27-01-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 746 000	2 772	2 879
Hydro One Inc. 7,35 % 03-06-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 928 000	2 211	2 273
Hydro One Inc. 2,23 % 17-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 416 000	1 258	1 298
Hydro One Inc. 6,93 % 01-06-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 242 000	1 447	1 481
Hydro One Inc. 4,16 % 27-01-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	610 000	609	625
Hydro One Inc. 4,39 % 01-03-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 060 000	1 059	1 099
Hydro One Inc. 4,89 % 13-03-2037	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 731 000	1 685	1 817
Hydro One Inc. 4,85 % 30-11-2054	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 643 000	3 708	3 851
Hyundai Capital Canada Inc. 5,57 % 08-03-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	782 000	792	826
Hyundai Capital Canada Inc. 4,90 % 31-01-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 240 000	1 240	1 290
iA Société financière inc., taux variable 20-06-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	640 000	640	677
L'Ordre Indépendant des Forestiers, taux variable 15-10-2035, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 110 000	1 080	998
Intact Corporation financière 5,46 % 22-09-2032 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	850 000 USD	1 127	1 179
Intact Corporation financière, taux variable 16-05-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	500 000	500	520
Intact Corporation financière 5,28 % 14-09-2054	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 090 000	1 175	1 213
Intact Corporation financière, taux variable 31-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	300 000	300	291
Inter Pipeline Ltd. 3,48 % 16-12-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 656 000	3 742	3 628
Ivanhoe Cambridge II Inc. 2,30 % 12-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	949 000	959	945
The J.M. Smucker Co. 2,38 % 15-03-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	562 000 USD	656	689
John Deere Financial Inc. 5,17 % 15-09-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	360 000	355	382
JPMorgan Chase & Co. 1,90 % 05-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 810 000	2 810	2 705
Keyera Corp. 3,96 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 750 000	1 860	1 741
Liberty Utilities (Canada) LP 3,32 % 14-02-2050, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	660 000	660	502
Les Compagnies Loblaw Itée 2,28 % 07-05-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	568 000	571	529
Les Compagnies Loblaw Itée 5,34 % 13-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	690 000	690	742
Les Compagnies Loblaw Itée 5,12 % 04-03-2054	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 310 000	1 310	1 368
Lower Mattagami Energy LP 2,43 % 14-05-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 000 000	1 914	1 859
Lower Mattagami Energy LP 4,85 % 31-10-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	405 000	405	434
Lower Mattagami Energy LP 4,69 % 07-06-2054	Canada	Sociétés – Non convertibles	550 000	550	571
Banque Manuvie du Canada 1,54 % 14-09-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	753 000	753	727
Banque Manuvie du Canada 2,86 % 16-02-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 740 000	1 740	1 718
Société Financière Manuvie, taux variable 12-05-2030, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	950 000	950	940
Société Financière Manuvie, taux variable 10-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 955 000	3 994	4 154
Société Financière Manuvie, taux variable 23-02-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 190 000	1 190	1 243
Société Financière Manuvie, taux variable 19-06-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 585 000	1 572	1 638

# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Metro inc. 4,66 % 07-02-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	577 000	571	600
Micron Technology Inc. 5,38 % 15-04-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 310 000 USD	1 761	1 825
Banque Nationale du Canada 5,30 % 03-11-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 214 000	1 217	1 233
Banque Nationale du Canada, taux variable 18-08-2026, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 170 000	1 170	1 147
Banque Nationale du Canada 5,22 % 14-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 830 000	1 826	1 935
Banque Nationale du Canada 5,02 % 01-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 870 000	1 891	1 974
Banque Nationale du Canada, taux variable 16-08-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 540 000	2 540	2 649
Banque Nationale du Canada 5,28 % 15-02-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	750 000	750	786
NAV CANADA 2,06 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	910 000	887	843
Nestlé Holdings Inc. 2,19 % 26-01-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 120 000	1 120	1 070
NextEra Energy Capital Holdings Inc. 1,90 % 15-06-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	800 000 USD	962	997
NextEra Energy Capital Holdings Inc. 2,25 % 01-06-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 495 000 USD	3 374	3 023
NextEra Energy Capital Holdings Inc. 4,85 % 30-04-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 293 000	2 295	2 393
North West Redwater Partnership 3,20 % 24-04-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 320 000	1 263	1 313
North West Redwater Partnership 2,80 % 01-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 800 000	2 715	2 754
North West Redwater Partnership 4,25 % 01-06-2029, rachetables, série F	Canada	Sociétés – Non convertibles	710 000	709	729
North West Redwater Partnership 2,80 % 01-06-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 260 000	4 149	3 989
North West Redwater Partnership 4,15 % 01-06-2033, série H	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 721 000	2 455	2 728
North West Redwater Partnership 4,85 % 01-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	740 000	739	775
North West Redwater Partnership 3,65 % 01-06-2035, rachetables 2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 535 000	1 334	1 449
North West Redwater Partnership 3,70 % 23-02-2043, rachetables 2042	Canada	Sociétés – Non convertibles	803 000	761	703
Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc. 4,11 % 31-03-2042	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 461 006	1 461	1 351
NXP BV 2,65 % 15-02-2032	Chine	Sociétés – Non convertibles	456 000 USD	556	536
OMERS Finance Trust 2,60 % 14-05-2029	Canada	Gouvernements provinciaux	1 286 000	1 285	1 256
Ontario Power Generation Inc. 2,89 % 08-04-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 043 000	2 006	2 031
Ontario Power Generation Inc. 1,17 % 22-04-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	687 000	612	662
Ontario Power Generation Inc. 2,98 % 13-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	856 000	853	834
Ontario Power Generation Inc. 4,92 % 19-07-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	500 000	500	532
Ontario Power Generation Inc. 4,83 % 28-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	850 000	850	893
Ontario Teachers' Finance Trust 1,10 % 19-10-2027	Canada	Gouvernements provinciaux	940 000	937	888
Ontario Teachers' Finance Trust 4,30 % 02-06-2034	Canada	Gouvernements provinciaux	3 304 000	3 350	3 453
Régime de retraite des enseignantes et des enseignants de l'Ontario 4,45 % 02-06-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	2 402 000	2 403	2 557
OPB Finance Trust 2,98 % 25-01-2027	Canada	Gouvernements provinciaux	1 673 000	1 675	1 663
PayPal Holdings Inc. 2,30 % 01-06-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	809 000 USD	1 094	993
Pembina Pipeline Corp. 5,72 % 22-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	310 000	310	310
Pembina Pipeline Corp. 4,02 % 27-03-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 881 000	4 085	3 925
Pembina Pipeline Corp. 5,22 % 28-06-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	950 000	950	1 003
Pembina Pipeline Corp. 5,21 % 12-01-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	900 000	899	945
Pembina Pipeline Corp. 4,81 % 25-03-2044	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 536 000	1 648	1 455
Pembina Pipeline Corp. 4,74 % 21-01-2047, rachetables 2046, série MTN	Canada	Sociétés – Non convertibles	686 000	665	642
Pembina Pipeline Corp. 5,67 % 12-01-2054	Canada	Sociétés – Non convertibles	760 000	759	808
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 4,65 % 19-05-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 699 000 USD	4 978	5 123
Prime Structured Mortgage Trust 1,86 % 15-11-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 140 000	1 140	1 136
Prologis Inc. 4,70 % 01-03-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 150 000	1 148	1 191
Prologis Inc. 5,25 % 15-01-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	380 000	372	405
Province de l'Alberta 4,15 % 01-06-2033	Canada	Gouvernements provinciaux	3 129 000	3 073	3 279
Province de l'Alberta 3,05 % 01-12-2048	Canada	Gouvernements provinciaux	4 545 000	4 713	3 790
Province de l'Alberta 3,10 % 01-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	33 409 000	34 113	28 030
Province de l'Alberta 2,95 % 01-06-2052	Canada	Gouvernements provinciaux	5 680 000	4 978	4 604
Province de l'Alberta 4,45 % 01-12-2054	Canada	Gouvernements provinciaux	1 175 000	1 249	1 243
Province de la Colombie-Britannique 4,15 % 18-06-2034	Canada	Gouvernements provinciaux	7 510 000	7 472	7 818
Province de la Colombie-Britannique 2,95 % 18-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	6 417 000	7 080	5 237
Province de la Colombie-Britannique 4,45 % 18-12-2055	Canada	Gouvernements provinciaux	5 611 000	5 828	5 951
Province du Manitoba 3,20 % 05-03-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	7 725 000	8 249	6 500
Province du Manitoba 2,05 % 05-09-2052	Canada	Gouvernements provinciaux	5 947 000	4 475	3 855
Province du Manitoba 3,80 % 05-09-2053	Canada	Gouvernements provinciaux	2 479 000	2 301	2 308

# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N <sup>bre</sup> d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Province de l'Ontario 1,55 % 01-11-2029	Canada	Gouvernements provinciaux	1 893 000	1 888	1 763
Province de l'Ontario 4,05 % 02-02-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	8 670 000	8 659	9 079
Province de l'Ontario 4,10 % 04-03-2033	Canada	Gouvernements provinciaux	4 135 000	4 120	4 322
Province de l'Ontario 4,15 % 02-06-2034	Canada	Gouvernements provinciaux	82 062 000	81 066	85 538
Province de l'Ontario 4,15 % 02-12-2054	Canada	Gouvernements provinciaux	6 418 000	6 301	6 501
Province de l'Ontario 4,60 % 02-12-2055	Canada	Gouvernements provinciaux	10 215 000	10 962	11 165
Province de Québec 3,65 % 20-05-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	2 140 000	2 140	2 183
Province de Québec 3,90 % 22-11-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	1 680 000	1 655	1 739
Province de Québec 4,45 % 01-09-2034	Canada	Gouvernements provinciaux	24 861 000	25 224	26 484
Province de Québec 4,40 % 01-12-2055	Canada	Gouvernements provinciaux	36 711 000	37 892	38 656
Province de la Saskatchewan 2,15 % 02-06-2031	Canada	Gouvernements provinciaux	547 000	480	511
Province de la Saskatchewan 3,10 % 02-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	6 307 000	6 324	5 297
Province de la Saskatchewan 2,80 % 02-12-2052	Canada	Gouvernements provinciaux	6 483 000	6 369	5 087
Province de la Saskatchewan 4,20 % 02-12-2054	Canada	Gouvernements provinciaux	2 538 000	2 593	2 576
PSP Capital Inc. 2,60 % 01-03-2032	Canada	Gouvernement fédéral	2 550 000	2 542	2 423
PSP Capital Inc. 4,15 % 01-06-2033	Canada	Gouvernement fédéral	217 000	219	227
Reliance LP 2,68 % 01-12-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	810 000	810	782
Reliance LP 2,67 % 01-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 060 000	1 060	1 009
Reliance LP 5,25 % 15-05-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 150 000	1 149	1 204
Renasas Electronics Corp. 1,54 % 26-11-2024	Japon	Sociétés – Non convertibles	1 010 000 USD	1 273	1 359
Fonds de placement immobilier RioCan 2,83 % 08-11-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 109 000	1 893	2 010
Rogers Communications Inc. 3,10 % 15-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 000	1	1
Rogers Communications Inc. 5,70 % 21-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 990 000	1 987	2 121
Rogers Communications Inc. 3,75 % 15-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 288 000	2 255	2 271
Rogers Communications Inc. 2,90 % 09-12-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 576 000	1 508	1 473
Rogers Communications Inc. 5,25 % 15-04-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	949 000	920	955
Banque Royale du Canada 5,24 % 02-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 347 000	2 354	2 430
Banque Royale du Canada 2,33 % 28-01-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 437 000	1 294	1 402
Banque Royale du Canada 4,61 % 26-07-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 208 000	1 195	1 245
Banque Royale du Canada 4,64 % 17-01-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 540 000	2 540	2 631
Banque Royale du Canada 4,63 % 01-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 360 000	1 360	1 412
Banque Royale du Canada, taux variable 23-12-2029, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 350 000	1 353	1 346
Banque Royale du Canada, taux variable 03-05-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	617 000	582	605
Banque Royale du Canada, taux variable 03-04-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 580 000	1 580	1 651
Banque Royale du Canada, taux variable 08-08-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 803 000	2 813	2 896
Banque Royale du Canada, taux variable 24-11-2080, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 647 000	1 624	1 632
Sagen MI Canada Inc. 3,26 % 05-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	506 000	493	458
Sagen MI Canada Inc., taux variable 24-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 367 000	1 256	1 269
Saputo inc. 2,88 % 19-11-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	700 000	700	699
Saputo inc. 5,49 % 20-11-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 080 000	1 080	1 163
Sea to Sky Highway Investment LP 2,63 % 31-08-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 545 845	1 496	1 481
Sienna Senior Living Inc. 3,11 % 04-11-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	530 000	530	529
Sienna Senior Living Inc. 3,45 % 27-02-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	630 000	630	624
Sienna Senior Living Inc. 2,82 % 31-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	360 000	360	350
Sienna Senior Living Inc. 4,44 % 17-10-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	220 000	220	221
South Bow Canadian Infrastructure Holdings Ltd. 4,32 % 01-02-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	350 000	350	354
South Bow Canadian Infrastructure Holdings Ltd. 4,62 % 01-02-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	580 000	580	587
South Coast British Columbia Transportation Authority 1,60 % 03-07-2030	Canada	Administrations municipales	1 039 000	1 039	955
Sprint Spectrum Co. LLC 4,74 % 20-03-2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	121 250 USD	157	164
Spy Hill Power LP 4,14 % 31-03-2036	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 056 081	1 053	1 037
Stella-Jones Inc. 4,31 % 01-10-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	540 000	540	543
Financière Sun Life inc., taux variable 10-05-2032, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 750 000	1 749	1 706
Financière Sun Life inc., taux variable 21-11-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 537 000	1 537	1 481
Financière Sun Life inc., taux variable 10-08-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 116 000	4 100	4 279
Financière Sun Life inc., taux variable 04-07-2035	Canada	Sociétés – Non convertibles	596 000	596	641
Financière Sun Life inc., taux variable 01-10-2035	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 897 000	1 835	1 710
Financière Sun Life inc., taux variable 15-05-2036	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 440 000	1 440	1 521
Suncor Énergie Inc. 5,40 % 17-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 510 000	1 508	1 566
Suncor Énergie Inc. 3,95 % 04-03-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 170 000	1 152	1 002

# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N <sup>bre</sup> d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
TELUS Corp. 4,80 % 15-12-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	320 000	320	333
TELUS Corp. 3,30 % 02-05-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	706 000	683	692
TELUS Corp. 3,15 % 19-02-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 490 000	2 423	2 401
TELUS Corp. 4,95 % 18-02-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	630 000	628	660
TELUS Corp. 4,65 % 13-08-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	920 000	919	946
TELUS Corp. 2,85 % 13-11-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 120 000	935	1 031
TELUS Corp. 4,95 % 28-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	560 000	559	584
Tencent Music Entertainment Group 2,00 % 03-09-2030, rachetables 2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	480 000 USD	629	564
Teranet Holdings LP 3,72 % 23-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 300 000	2 300	2 238
T-Mobile USA Inc. 3,75 % 15-04-2027, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 749 000 USD	5 260	5 009
T-Mobile USA Inc. 4,95 % 15-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	563 000 USD	756	779
T-Mobile USA Inc. 4,85 % 15-01-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	268	276
T-Mobile USA Inc. 2,55 % 15-02-2031, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	700 000 USD	951	843
T-Mobile USA Inc. 5,20 % 15-01-2033	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 590 000 USD	2 054	2 226
T-Mobile USA Inc. 5,15 % 15-04-2034	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	270 000 USD	361	376
Groupe TMX Ltée 2,30 % 11-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 030 000	4 180	4 020
Groupe TMX Ltée 3,78 % 05-06-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	880 000	884	887
Groupe TMX Ltée 4,68 % 16-08-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	490 000	490	513
Groupe TMX Ltée 2,02 % 12-02-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	763 000	738	689
Toronto Hydro Corp. 4,61 % 14-06-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 304 000	1 303	1 378
Toronto Hydro Corp. 4,95 % 13-10-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 390 000	1 435	1 491
La Banque Toronto-Dominion 2,67 % 09-09-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 188 000	2 097	2 166
La Banque Toronto-Dominion 4,34 % 27-01-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 355 000	1 337	1 367
La Banque Toronto-Dominion 5,42 % 10-07-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 010 000	1 010	1 043
La Banque Toronto-Dominion 2,26 % 07-01-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	689 000	689	671
La Banque Toronto-Dominion 4,21 % 01-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 840 000	4 746	4 926
La Banque Toronto-Dominion 5,38 % 21-10-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 858 000	1 876	1 957
La Banque Toronto-Dominion 4,48 % 18-01-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 622 000	1 613	1 671
La Banque Toronto-Dominion 5,38 % 01-07-2028	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	1 136 023	1 207	1 180
La Banque Toronto-Dominion 5,49 % 08-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 450 000	1 450	1 551
La Banque Toronto-Dominion 4,68 % 08-01-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	613 000	613	639
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 22-04-2030, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 865 000	5 856	5 832
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 26-01-2032, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 308 000	1 266	1 288
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 09-04-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 330 000	1 330	1 392
Tourmaline Oil Corp. 2,53 % 12-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	550 000	550	525
Crédit Toyota Canada Inc. 4,44 % 27-06-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	650 000	650	672
Crédit Toyota Canada Inc. 3,73 % 02-10-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	820 000	820	822
TransCanada PipeLines Ltd. 3,80 % 05-04-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 262 000	4 515	4 288
TransCanada PipeLines Ltd. 4,33 % 16-09-2047, rachetables 2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 038 000	867	938
TransCanada PipeLines Ltd. 4,34 % 15-10-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 524 000	1 284	1 374
TransCanada PipeLines Ltd. 5,92 % 12-05-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	325 000	345	365
TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	9 067 000	8 708	8 919
Transcontinental inc. 2,67 % 03-02-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	371 000	350	369
Transurban Finance Co. Pty. Ltd. 4,56 % 14-11-2028, rachetables 2028	Australie	Sociétés – Non convertibles	2 290 000	2 329	2 325
Trillium Windpower LP 5,80 % 15-02-2033	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	830 512	832	870
Union Gas Ltd. 4,20 % 02-06-2044, rachetables 2043	Canada	Sociétés – Non convertibles	660 000	617	623
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,12 % 15-04-2025	États-Unis	Gouvernements étrangers	20 743 000 USD	34 012	33 564
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052	États-Unis	Gouvernements étrangers	1 504 000 USD	2 032	1 428
Obligations du Trésor des États-Unis 2,13 % 15-02-2054	États-Unis	Gouvernements étrangers	9 679 000 USD	13 869	13 934
Administration de l'aéroport de Vancouver 1,76 % 20-09-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 144 000	997	1 034
Ventas Canada Finance Ltd. 5,40 % 21-04-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 270 000	1 270	1 334
Ventas Canada Finance Ltd. 5,10 % 05-03-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 020 000	1 019	1 066
Ventas Realty LP 4,00 % 01-03-2028, rachetables 2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 130 000 USD	1 438	1 508
Veren Inc. 4,97 % 21-06-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	870 000	870	900
Verizon Communications Inc., taux variable 20-03-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	422 000 USD	528	574

# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N <sup>bre</sup> d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Verizon Communications Inc. 2,38 % 22-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 366 000	2 267	2 273
Vidéotron Itée 4,65 % 15-07-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 010 000	1 009	1 038
Vidéotron Itée 3,13 % 15-01-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 568 000	1 451	1 473
Crédit VW Canada Inc. 4,21 % 19-08-2027	Allemagne	Sociétés – Non convertibles	195 000	197	197
Crédit VW Canada Inc. 5,73 % 20-09-2028	Allemagne	Sociétés – Non convertibles	590 000	628	629
Crédit VW Canada Inc. 4,42 % 20-08-2029	Allemagne	Sociétés – Non convertibles	1 265 000	1 274	1 284
The Walt Disney Co. 3,06 % 30-03-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 785 000	1 890	1 770
Waste Management of Canada Corp. 2,60 % 23-09-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 856 000	1 852	1 824
Wells Fargo & Co. 2,57 % 01-05-2026, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 730 000	2 779	2 704
Wells Fargo & Co. 2,98 % 19-05-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	4 132 000	4 280	4 087
Welltower Inc. 2,95 % 15-01-2027, rachetables 2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	623 000	566	606
Welltower Inc. 4,25 % 15-04-2028, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 027 000 USD	1 337	1 390
Welltower Inc. 4,13 % 15-03-2029, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 250 000 USD	1 651	1 679
Groupe WSP Global Inc. 2,41 % 19-04-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	946 000	953	905
Groupe WSP Global Inc. 4,12 % 12-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	620 000	620	624
Zoetis Inc. 2,00 % 15-05-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 390 000 USD	1 527	1 661
<b>Total des obligations</b>				<b>1 074 693</b>	<b>1 078 310</b>
<b>OPTIONS</b>					
Options achetées (se reporter au tableau des options achetées)				858	378
<b>Total des options</b>				<b>858</b>	<b>378</b>
<b>FONDS/BILLETS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>					
<sup>1</sup> FINB Obligations canadiennes totales Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	344 390	31 411	32 727
<sup>1</sup> FINB Obligations toutes sociétés canadiennes Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	136 696	12 082	13 156
<sup>1</sup> FINB Obligations à long terme du gouvernement canadien Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	108 470	10 871	11 630
<sup>1</sup> FINB Obligations à ultra-court terme canadiennes Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	43 360	2 126	2 188
<sup>1</sup> FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	586 000	11 773	10 548
<b>Total des fonds/billets négociés en bourse</b>				<b>68 263</b>	<b>70 249</b>
Coûts de transaction				(38)	–
<b>Total des placements</b>				<b>1 143 776</b>	<b>1 148 937</b>
Instruments dérivés					
(se reporter au tableau des instruments dérivés)					
Obligation pour options vendues (se reporter au tableau des options vendues)					2 081
Trésorerie et équivalents de trésorerie					(59)
Autres éléments d'actif moins le passif					43 335
<b>Actif net attribuable aux porteurs de titres</b>					<b>2 132</b>
					<b>1 196 426</b>

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

# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## APERÇU DU PORTEFEUILLE

30 SEPTEMBRE 2024

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	100,0
Obligations	95,9
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)	4,1
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)	–
Autres éléments d'actif (de passif)	0,4
Options sur swaps achetées	–
Options sur devises achetées	–
Options sur swaps vendues	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(0,4)

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	85,6
États-Unis	11,5
Royaume-Uni	1,2
Autres éléments d'actif (de passif)	0,4
Australie	0,4
Irlande	0,4
Mexique	0,2
Allemagne	0,2
Chili	0,2
Autre	0,1
Japon	0,1
Chine	0,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(0,4)

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	51,0
Obligations provinciales	26,0
Obligations fédérales	17,7
Obligations d'État étrangères	4,5
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,6
Autres éléments d'actif (de passif)	0,4
Obligations municipales	0,2
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(0,4)

31 MARS 2024

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	101,0
Obligations	92,8
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)	8,2
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)	–
Autres éléments d'actif (de passif)	1,3
Options sur swaps achetées	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(2,3)

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	86,4
États-Unis	11,8
Autres éléments d'actif (de passif)	1,3
Royaume-Uni	1,1
Australie	0,3
Mexique	0,3
Irlande	0,3
Chili	0,2
Brésil	0,1
Autre	0,1
Allemagne	0,1
Japon	0,1
Chine	0,1
Colombie	0,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(2,3)

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	52,0
Obligations provinciales	24,2
Obligations fédérales	19,1
Obligations d'État étrangères	4,8
Autres éléments d'actif (de passif)	1,3
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,7
Obligations municipales	0,2
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(2,3)

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

# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## TABLEAU DES OPTIONS ACHETÉES

Au 30 septembre 2024

Élément sous-jacent	Nombre de contrats	Type d'option	Date d'échéance	Prix d'exercice \$	Prime payée (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
Indice Markit North American Investment Grade CDX	124 729 000	Vente	16 octobre 2024	62,50 USD	128	5
Indice Markit North American Investment Grade CDX	76 188 675	Vente	20 novembre 2024	72,50 USD	306	20
Indice Markit North American Investment Grade CDX	128 996 000	Vente	18 décembre 2024	65,00 USD	171	108
Option d'achat sur devises CAD/USD	2 545 000	Achat	22 juillet 2025	1,36 USD	74	49
Option de vente sur devises CAD/USD	6 126 500	Vente	22 juillet 2025	1,36 USD	179	196
<b>Total des options</b>					<b>858</b>	<b>378</b>

## TABLEAU DES OPTIONS VENDUES

Au 30 septembre 2024

Élément sous-jacent	Nombre de contrats	Type d'option	Date d'échéance	Prix d'exercice \$	Prime reçue (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
Indice Markit North American Investment Grade CDX	(124 729 000)	Option de vente vendue	16 octobre 2024	80,00 USD	(54)	–
Indice Markit North American Investment Grade CDX	(76 188 675)	Option de vente vendue	20 novembre 2024	87,50 USD	(190)	(9)
Indice Markit North American Investment Grade CDX	(128 996 000)	Option de vente vendue	18 décembre 2024	80,00 USD	(86)	(50)
<b>Total des options</b>					<b>(330)</b>	<b>(59)</b>

# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS

Au 30 septembre 2024

### Tableau des contrats à terme standardisés

Type de contrat	Nombre de contrats	Date d'échéance	Prix moyen des contrats (\$)	Montant notionnel* (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 10 ans, décembre 2024	146	18 décembre 2024	124,89 CAD	18 251	18	–
Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 5 ans, décembre 2024	240	18 décembre 2024	114,55 CAD	27 706	215	–
Contrats à terme standardisés à très long terme sur obligations du Trésor américain, décembre 2024	(329)	19 décembre 2024	133,83 USD	(59 217)	491	–
<b>Total des contrats à terme standardisés</b>				<b>(13 260)</b>	<b>724</b>	<b>–</b>

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

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	9 328 CAD	(6 830) USD	11 octobre 2024	(9 328)	(9 234)	94	–
A	744 CAD	(545) USD	11 octobre 2024	(744)	(737)	7	–
A	8 133 CAD	(5 967) USD	25 octobre 2024	(8 133)	(8 065)	68	–
A	658 USD	(891) CAD	25 octobre 2024	891	889	–	(2)
A	27 013 CAD	(19 604) USD	8 novembre 2024	(27 013)	(26 490)	523	–
A	15 695 CAD	(11 392) USD	8 novembre 2024	(15 695)	(15 393)	302	–
A	4 455 CAD	(3 233) USD	8 novembre 2024	(4 455)	(4 369)	86	–
A	5 404 CAD	(4 009) USD	15 novembre 2024	(5 404)	(5 416)	–	(12)
A	7 091 CAD	(5 260) USD	15 novembre 2024	(7 091)	(7 106)	–	(15)
A	18 397 CAD	(13 432) USD	22 novembre 2024	(18 397)	(18 144)	253	–
A	4 523 CAD	(3 331) USD	22 novembre 2024	(4 523)	(4 499)	24	–
A	5 971 CAD	(4 399) USD	22 novembre 2024	(5 971)	(5 942)	29	–
<b>Total des contrats de change à terme de gré à gré</b>						<b>1 386</b>	<b>(29)</b>

Total des actifs dérivés

2 110

Total des passifs dérivés

(29)

# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

### 1. Périodes comptables et renseignements généraux

L'information fournie dans les présents états financiers et dans les notes annexes se rapporte aux 30 septembre 2024 et 2023 ou aux semestres clos à ces dates, à l'exception des données comparatives présentées dans les états de la situation financière et les notes annexes, qui se rapportent au 31 mars 2024. Pour l'exercice au cours duquel un fonds ou une série est établi(e) ou rétabli(e), l'information fournie se rapporte à la période commençant à la date d'établissement ou de rétablissement. Lorsqu'une série d'un fonds a été dissoute au cours de l'une ou l'autre des périodes, l'information concernant la série est fournie jusqu'à la fermeture des bureaux à la date de dissolution. Se reporter à la note 10 a) pour la date de constitution du Fonds et la date d'établissement de chacune des séries.

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

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

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

Les présents états financiers intermédiaires non audités (les « états financiers ») ont été établis conformément aux normes IFRS de comptabilité (« IFRS »), y compris la Norme comptable internationale 34 (« IAS »), *Information financière intermédiaire*, telles qu'elles ont été publiées par l'International Accounting Standards Board (l'« IASB »). Ces états financiers ont été établis selon les mêmes méthodes comptables, les mêmes jugements comptables critiques et les mêmes estimations que ceux qui ont été utilisés pour établir les états financiers annuels audités les plus récents du Fonds, soit ceux de l'exercice clos le 31 mars 2024. La note 3 présente un résumé des méthodes comptables significatives du Fonds en vertu des IFRS.

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

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

### 3. Méthodes comptables significatives

#### a) Instruments financiers

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

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

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

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

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

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

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

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

# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

### 3. Méthodes comptables significatives (suite)

#### b) Évaluation de la juste valeur

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

### 3. Méthodes comptables significatives (suite)

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

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

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

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

#### c) Comptabilisation des produits

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

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

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

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

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

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

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

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

#### f) Compensation

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

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

#### g) Devise

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

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

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

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

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

#### i) Valeur liquidative par titre

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

# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

### 3. Méthodes comptables significatives (suite)

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

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

k) Fusions

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

l) Modifications comptables futures

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

### 4. Estimations et jugements comptables critiques

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

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

Utilisation d'estimations

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

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

Utilisation de jugements

*Classement et évaluation des placements*

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

*Monnaie fonctionnelle*

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

*Intérêts dans des entités structurées non consolidées*

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

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

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

### 5. Impôts sur le résultat

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

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

# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

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

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

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

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

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

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

### 7. Capital du Fonds

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

### 8. Risques découlant des instruments financiers

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

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

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

#### ii. Risque de liquidité

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

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

#### iii. Risque de change

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

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

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

## NOTES ANNEXES

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

#### iv. Risque de taux d'intérêt

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

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

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

#### v. Autre risque de prix

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

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

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

#### vi. Risque de crédit

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

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

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

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

#### vii. Fonds sous-jacents

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

# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

### 9. Autres informations

#### Abréviations

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

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

# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

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

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

Date de constitution : 12 janvier 1989

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

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

Les titres de série A sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$ selon le mode de souscription avec frais de rachat ou le mode de souscription avec frais modérés.

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

Les titres de série CL sont offerts exclusivement aux fonds communs de placement et aux fonds distincts gérés par La Compagnie d'Assurance du Canada sur la Vie et ses filiales.

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

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

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

Les titres de série I sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$ dans un régime collectif admissible détenant un minimum de 10 000 000 \$ en actifs.

Les titres de série IG sont offerts exclusivement aux fonds communs de placement gérés par Société de gestion d'investissement, I.G. Ltée.

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

Les titres de série PW sont offerts à certains investisseurs à valeur nette élevée de nos Solutions Patrimoine privé qui investissent un minimum de 100 000 \$.

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

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

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

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

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

Les titres de série SC sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$ selon le mode de souscription avec frais d'acquisition.

Les titres des séries B et C ont été créés exclusivement afin de mettre en œuvre les fusions touchant le Fonds et ne sont pas offerts à la vente.

Les titres des séries J, M, PWT8, U et Investisseur, ainsi que les titres de série-B ne sont plus offerts à la vente.

Les titres des séries G et Investisseur ne sont plus offerts à la vente, sauf dans le cas d'achats supplémentaires effectués par des investisseurs qui détiennent ces titres depuis le 11 décembre 2017.

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

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

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

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

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



# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

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

#### c) Prêt de titres

	30 septembre 2024		31 mars 2024	
	(\$)		(\$)	
Valeur des titres prêtés	51 310		81 237	
Valeur des biens reçus en garantie	54 099		85 402	
	30 septembre 2024		30 septembre 2023	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
Revenus de prêts de titres bruts	28	100,0	92	100,0
Impôt retenu à la source	–	–	(1)	(1,1)
	28	100,0	91	98,9
Paiements à l'agent de prêt de titres	(4)	(14,3)	(16)	(17,4)
Revenu tiré du prêt de titres	24	85,7	75	81,5

#### d) Commissions

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

#### e) Risques découlant des instruments financiers

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

Le Fonds vise un revenu ainsi qu'une croissance du capital, tout en cherchant à assurer la protection de son capital, en investissant principalement dans des titres à revenu fixe du gouvernement canadien ainsi que dans des titres à revenu fixe de sociétés et des titres adossés à des créances de grande qualité ou de catégorie investissement. Le Fonds peut consacrer jusqu'à 30 % de son actif aux placements étrangers.

##### ii. Risque de change

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

Devise	30 septembre 2024				Incidence sur l'actif net			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Renforcement de 5 %		Affaiblissement de 5 %	
					(\$)	%	(\$)	%
USD	102 157	15 616	(99 243)	18 530				
Total	102 157	15 616	(99 243)	18 530				
% de l'actif net	8,5	1,3	(8,3)	1,5				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					(519)	–	1 197	0,1

Devise	31 mars 2024				Incidence sur l'actif net			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Renforcement de 5 %		Affaiblissement de 5 %	
					(\$)	%	(\$)	%
USD	135 696	14 923	(149 300)	1 319				
JPY	–	(264)	(62)	(326)				
Total	135 696	14 659	(149 362)	993				
% de l'actif net	9,3	1,0	(10,2)	0,1				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					(84)	–	84	–

\* Comprend les instruments financiers monétaires et non monétaires.

# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

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

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

##### iii. Risque de taux d'intérêt

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

30 septembre 2024	Obligations (\$)	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
			Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
			(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	70 675	(13 260)				
1 an à 5 ans	262 561	–				
5 ans à 10 ans	425 445	–				
Plus de 10 ans	319 629	–				
<b>Total</b>	<b>1 078 310</b>	<b>(13 260)</b>				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt			(82 860)	(6,9)	82 860	6,9

31 mars 2024	Obligations (\$)	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
			Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
			(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	81 861	(36 247)				
1 an à 5 ans	369 937	–				
5 ans à 10 ans	402 760	–				
Plus de 10 ans	429 116	–				
<b>Total</b>	<b>1 283 674</b>	<b>(36 247)</b>				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt			(101 672)	(6,9)	101 672	6,9

##### iv. Autre risque de prix

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

##### v. Risque de crédit

Pour ce Fonds, la plus forte concentration du risque de crédit se trouve dans les titres de créance, tels que les obligations. La juste valeur des titres de créance tient compte de la solvabilité de l'émetteur de ces titres. L'exposition maximale à tout émetteur de titres de créance au 30 septembre 2024 était de 12,5 % de l'actif net du Fonds (11,0 % au 31 mars 2024).

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

Note des obligations*	30 septembre 2024	31 mars 2024
	% de l'actif net	% de l'actif net
AAA	13,7	10,7
AA	17,1	17,0
A	26,2	28,7
BBB	23,5	22,3
Inférieure à BBB	–	–
Sans note	9,6	9,0
<b>Total</b>	<b>90,1</b>	<b>87,7</b>

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

# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

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

#### f) Classement de la juste valeur

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

	30 septembre 2024				31 mars 2024			
	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	–	1 078 310	–	1 078 310	–	1 283 674	–	1 283 674
Options	–	378	–	378	–	78	–	78
Fonds/billets négociés en bourse	70 249	–	–	70 249	75 640	–	–	75 640
Actifs dérivés	724	1 386	–	2 110	156	–	–	156
Passifs dérivés	–	(88)	–	(88)	(228)	(990)	–	(1 218)
Placements à court terme	–	26 712	–	26 712	–	72 986	–	72 986
Total	70 973	1 106 698	–	1 177 671	75 568	1 355 748	–	1 431 316

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 :

	30 septembre 2024	31 mars 2024
	(\$)	(\$)
Gestionnaire	16	14
Autres fonds gérés par le gestionnaire	698 741	672 501
Fonds gérés par des sociétés affiliées au gestionnaire	251 417	531 078

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

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

	30 septembre 2024			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	2 081	(14)	–	2 067
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(14)	14	3 173	3 173
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	2 067	–	3 173	5 240

	31 mars 2024			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	156	(156)	–	–
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(995)	156	6 366	5 527
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	(839)	–	6 366	5 527

# FONDS CANADIEN D'OBLIGATIONS MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

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

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

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

<b>30 septembre 2024</b>	<b>% de l'actif net du Fonds sous-jacent</b>	<b>Juste valeur des placements du Fonds (\$)</b>
FINB Obligations canadiennes totales Mackenzie	3,8	32 727
FINB Obligations toutes sociétés canadiennes Mackenzie	2,2	13 156
FINB Obligations à long terme du gouvernement canadien Mackenzie	16,9	11 630
FINB Obligations à ultra-court terme canadiennes Mackenzie	1,5	2 188
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	5,4	10 548

<b>31 mars 2024</b>	<b>% de l'actif net du Fonds sous-jacent</b>	<b>Juste valeur des placements du Fonds (\$)</b>
FINB Obligations canadiennes totales Mackenzie	4,3	37 121
FINB Obligations toutes sociétés canadiennes Mackenzie	2,6	14 922
FINB Obligations à long terme du gouvernement canadien Mackenzie	16,9	11 139
FINB Obligations à ultra-court terme canadiennes Mackenzie	1,8	2 180
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	5,5	10 278