

États financiers intermédiaires non audités

Pour la période de six mois close le 30 septembre 2024

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

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

AVIS DE NON-AUDIT DES ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES

Corporation Financière Mackenzie, le gestionnaire du Fonds équilibré canadien de croissance Mackenzie Bluewater (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 ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

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)
ACTIF							
Actifs courants			Série A	14,01	13,43	1 394 827	1 452 430
Placements à la juste valeur	5 363 191	5 073 441	Série AR	13,70	13,14	110 071	105 635
Trésorerie et équivalents de trésorerie	130 613	481 716	Série D	16,37	15,69	52 046	51 180
Intérêts courus à recevoir	17 504	15 650	Série F	14,62	14,01	1 387 326	1 431 428
Dividendes à recevoir	2 394	6 165	Série F5	14,41	14,03	71 332	72 345
Sommes à recevoir pour placements vendus	2 766	47 209	Série F8	11,61	11,48	18 855	18 708
Sommes à recevoir pour titres émis	911	3 692	Série FB	13,59	13,03	3 810	4 031
Sommes à recevoir du gestionnaire	32	1 084	Série FB5	15,48	15,10	75	74
Marge sur instruments dérivés	5 167	7 345	Série G	18,99	18,20	340	325
Actifs dérivés	10 428	475	Série I	13,02	12,48	4 847	5 069
Impôt à recouvrer	–	101	Série O	29,59	28,36	227 853	221 817
Total de l'actif	5 533 006	5 636 878	Série O5	16,19	15,70	13	12
			Série PW	16,94	16,23	1 815 204	1 800 486
PASSIF			Série PWFB	13,96	13,37	56 117	54 260
Passifs courants			Série PWFB5	15,74	15,33	346	335
Sommes à payer pour placements achetés	19 572	34 712	Série PWR	12,32	11,81	58 936	50 166
Sommes à payer pour titres rachetés	2 328	10 412	Série PWT5	13,66	13,39	79 340	81 757
Sommes à payer au gestionnaire	768	779	Série PWT8	9,98	9,93	32 342	31 453
Obligation pour options vendues	110	–	Série PWX	17,76	17,02	12 892	12 876
Passifs dérivés	305	3 640	Série PWX8	12,18	11,98	227	215
Total du passif	23 083	49 543	Série R	22,41	21,47	7 255	7 804
Actif net attribuable aux porteurs de titres	5 509 923	5 587 335	Série S	13,28	12,72	17 580	18 589
			Série T5	9,72	9,54	49 145	54 034
			Série T8	5,25	5,23	14 378	15 873
			Série Investisseur	12,57	12,05	36 454	38 171
			Série-B	13,29	12,74	4 018	4 018
			Série Conseiller	12,36	11,85	112	118
			Série LB	12,31	11,80	7 051	7 356
			Série LF	13,64	13,08	22 217	21 840
			Série LF5	15,87	15,47	587	596
			Série LW	12,48	11,96	23 679	23 622
			Série LW5	13,67	13,39	564	607
			Série LX	13,47	13,22	84	105
						5 509 923	5 587 335

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

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	2024	2023	
Revenus									
Dividendes	26 054	25 935							
Revenus d'intérêts aux fins de distribution	43 363	39 471							
Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets									
Profit (perte) net(te) réalisé(e)	59 329	46 123							
Profit (perte) net(te) latent(e)	174 405	(190 301)							
Revenu tiré du prêt de titres	47	99							
Revenu provenant des rabais sur les frais	48	97							
Total des revenus (pertes)	303 246	(78 576)							
Charges (note 6)									
Frais de gestion	41 748	40 958							
Rabais sur les frais de gestion	(21)	(50)							
Frais d'administration	4 930	4 841							
Frais de service aux porteurs de titres	1	–							
Intérêts débiteurs	5	25							
Commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille	632	1 128							
Frais du comité d'examen indépendant	9	8							
Autre	–	9							
Charges avant les montants absorbés par le gestionnaire	47 304	46 919							
Charges absorbées par le gestionnaire	1	1							
Charges nettes	47 371	46 918							
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, avant impôt	255 943	(125 494)							
Charge (économie) d'impôt étranger retenu à la source	1 744	1 167							
Charge d'impôt étranger sur le résultat (recouvrée)	–	–							
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation	254 199	(126 661)							
					Série A	0,58	(0,34)	60 675	(38 267)
					Série AR	0,59	(0,34)	4 733	(2 506)
					Série D	0,79	(0,36)	2 505	(1 126)
					Série F	0,70	(0,27)	69 272	(26 894)
					Série F5	0,71	(0,27)	3 628	(1 356)
					Série F8	0,58	(0,22)	949	(330)
					Série FB	0,63	(0,26)	185	(82)
					Série FB5	0,67	(0,36)	4	–
					Série G	0,87	(0,39)	16	(7)
					Série I	0,58	(0,27)	226	(123)
					Série O	1,58	(0,41)	12 230	(3 128)
					Série O5	0,88	(0,52)	2	(62)
					Série PW	0,74	(0,39)	80 309	(43 083)
					Série PWFB	0,69	(0,25)	2 750	(1 016)
					Série PWFB5	0,78	(0,29)	18	(5)
					Série PWR	0,56	(0,29)	2 537	(999)
					Série PWT5	0,59	(0,31)	3 502	(2 036)
					Série PWT8	0,45	(0,25)	1 438	(813)
					Série PWX	0,95	(0,23)	700	(211)
					Série PWX8	0,67	(0,18)	13	(6)
					Série R	1,15	(0,30)	392	(110)
					Série S	0,70	(0,18)	967	(297)
					Série T5	0,40	(0,24)	2 162	(1 480)
					Série T8	0,22	(0,13)	635	(445)
					Série Investisseur	0,55	(0,26)	1 670	(951)
					Série-B	0,70	(0,18)	213	(56)
					Série Conseiller	0,51	(0,28)	6	(3)
					Série LB	0,51	(0,31)	303	(196)
					Série LF	0,66	(0,25)	1 069	(441)
					Série LF5	0,77	(0,27)	29	(14)
					Série LW	0,54	(0,29)	1 037	(596)
					Série LW5	0,53	(0,33)	21	(18)
					Série LX	0,49	(0,39)	3	(4)
								254 199	(126 661)

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

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 D		Série F	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	5 587 335	5 429 585	1 452 430	1 478 935	105 635	91 298	51 180	47 102	1 431 428	1 347 543
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	254 199	(126 661)	60 675	(38 267)	4 733	(2 506)	2 505	(1 126)	69 272	(26 894)
Distributions versées aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(23 102)	(15 540)	(1 775)	(274)	(117)	(8)	(360)	(273)	(10 972)	(8 689)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(6 461)	(7 119)	–	–	–	–	–	–	–	–
Rabais sur les frais de gestion	(21)	(50)	(4)	(6)	–	–	–	–	(1)	(1)
Total des distributions versées aux porteurs de titres	(29 584)	(22 709)	(1 779)	(280)	(117)	(8)	(360)	(273)	(10 973)	(8 690)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	401 911	472 224	108 477	153 401	11 452	10 433	3 107	8 375	111 558	138 904
Réinvestissement des distributions	23 091	16 432	1 723	269	116	7	350	262	9 100	7 240
Paiements au rachat de titres	(727 029)	(524 715)	(226 699)	(189 293)	(11 748)	(6 060)	(4 736)	(3 838)	(223 059)	(128 055)
Total des opérations sur les titres	(302 027)	(36 059)	(116 499)	(35 623)	(180)	4 380	(1 279)	4 799	(102 401)	18 089
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	(77 412)	(185 429)	(57 603)	(74 170)	4 436	1 866	866	3 400	(44 102)	(17 495)
À la clôture	5 509 923	5 244 156	1 394 827	1 404 765	110 071	93 164	52 046	50 502	1 387 326	1 330 048
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :										
Titres en circulation, à l'ouverture			108 170	115 210	8 042	7 269	3 262	3 143	102 144	100 692
Émis			8 059	12 010	869	836	196	556	7 929	10 417
Réinvestissement des distributions			127	21	9	1	22	18	638	552
Rachetés			(16 791)	(14 823)	(888)	(485)	(301)	(257)	(15 834)	(9 606)
Titres en circulation, à la clôture			99 565	112 418	8 032	7 621	3 179	3 460	94 877	102 055

	Série F5		Série F8		Série FB		Série FB5		Série G	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	72 345	68 429	18 708	17 347	4 031	3 899	74	6	325	330
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	3 628	(1 356)	949	(330)	185	(82)	4	–	16	(7)
Distributions versées aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(584)	(466)	(150)	(114)	(26)	(21)	(1)	–	(1)	(1)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(1 173)	(1 218)	(592)	(565)	–	–	(1)	(1)	–	–
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Total des distributions versées aux porteurs de titres	(1 757)	(1 684)	(742)	(679)	(26)	(21)	(2)	(1)	(1)	(1)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	7 665	6 626	1 958	1 639	550	824	20	68	–	–
Réinvestissement des distributions	251	232	104	93	25	20	–	–	1	1
Paiements au rachat de titres	(10 800)	(4 914)	(2 122)	(1 264)	(955)	(850)	(21)	–	(1)	(20)
Total des opérations sur les titres	(2 884)	1 944	(60)	468	(380)	(6)	(1)	68	–	(19)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	(1 013)	(1 096)	147	(541)	(221)	(109)	1	67	15	(27)
À la clôture	71 332	67 333	18 855	16 806	3 810	3 790	75	73	340	303
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :										
Titres en circulation, à l'ouverture	5 155	4 918	1 630	1 478	309	313	5	–	18	19
Émis	548	481	172	144	42	67	1	5	–	–
Réinvestissement des distributions	18	17	9	8	2	2	–	–	–	–
Rachetés	(770)	(358)	(186)	(110)	(73)	(69)	(1)	–	–	(1)
Titres en circulation, à la clôture	4 951	5 058	1 625	1 520	280	313	5	5	18	18

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

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 I		Série O		Série O5		Série PW		Série PWFB	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	5 069	5 336	221 817	205 136	12	10 055	1 800 486	1 712 842	54 260	52 421
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	226	(123)	12 230	(3 128)	2	(62)	80 309	(43 083)	2 750	(1 016)
Distributions versées aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(21)	(35)	(2 820)	(2 252)	–	(21)	(4 431)	(1 998)	(437)	(339)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	–	–	–	(20)	–	–	–	–
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	(12)	(24)	–	–
Total des distributions versées aux porteurs de titres	(21)	(35)	(2 820)	(2 252)	–	(41)	(4 443)	(2 022)	(437)	(339)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	6	58	5 661	7 007	–	–	123 452	122 389	5 063	2 999
Réinvestissement des distributions	21	35	2 820	2 247	–	39	4 320	1 964	436	339
Paiements au rachat de titres	(454)	(249)	(11 855)	(7 298)	(1)	(9 980)	(188 920)	(127 248)	(5 955)	(4 186)
Total des opérations sur les titres	(427)	(156)	(3 374)	1 956	(1)	(9 941)	(61 148)	(2 895)	(456)	(848)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	(222)	(314)	6 036	(3 424)	1	(10 044)	14 718	(48 000)	1 857	(2 203)
À la clôture	4 847	5 022	227 853	201 712	13	11	1 815 204	1 664 842	56 117	50 218
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :										
Titres en circulation, à l'ouverture	406	445	7 821	7 578	1	652	110 919	110 421	4 057	4 104
Émis	–	5	197	259	–	–	7 571	7 929	377	235
Réinvestissement des distributions	2	3	98	85	–	3	262	129	32	27
Rachetés	(36)	(21)	(417)	(271)	–	(654)	(11 571)	(8 248)	(445)	(329)
Titres en circulation, à la clôture	372	432	7 699	7 651	1	1	107 181	110 231	4 021	4 037

	Série PWFB5		Série PWR		Série PWT5		Série PWT8		Série PWX	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	335	325	50 166	36 437	81 757	89 952	31 453	34 398	12 876	15 056
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	18	(5)	2 537	(999)	3 502	(2 036)	1 438	(813)	700	(211)
Distributions versées aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(3)	(2)	(133)	(46)	(205)	(135)	(78)	(47)	(162)	(159)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(5)	(6)	–	–	(1 730)	(1 939)	(1 182)	(1 262)	–	–
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	(5)	(1)	(1)	–	–
Total des distributions versées aux porteurs de titres	(8)	(8)	(133)	(46)	(1 935)	(2 079)	(1 261)	(1 310)	(162)	(159)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	–	–	8 960	5 345	3 773	2 412	1 830	1 716	6	231
Réinvestissement des distributions	2	2	133	46	983	1 005	634	626	161	158
Paiements au rachat de titres	(1)	(2)	(2 727)	(989)	(8 740)	(10 006)	(1 752)	(3 588)	(689)	(1 283)
Total des opérations sur les titres	1	–	6 366	4 402	(3 984)	(6 589)	712	(1 246)	(522)	(894)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	11	(13)	8 770	3 357	(2 417)	(10 704)	889	(3 369)	16	(1 264)
À la clôture	346	312	58 936	39 794	79 340	79 248	32 342	31 029	12 892	13 792
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :										
Titres en circulation, à l'ouverture	22	21	4 247	3 228	6 108	6 710	3 168	3 353	757	927
Émis	–	–	755	476	283	182	187	170	–	15
Réinvestissement des distributions	–	–	11	4	74	77	65	63	9	10
Rachetés	–	–	(231)	(87)	(658)	(756)	(179)	(357)	(40)	(80)
Titres en circulation, à la clôture	22	21	4 782	3 621	5 807	6 213	3 241	3 229	726	872

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

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 PWX8		Série R		Série S		Série T5		Série T8	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	215	401	7 804	7 874	18 589	20 771	54 034	60 396	15 873	19 688
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	13	(6)	392	(110)	967	(297)	2 162	(1 480)	635	(445)
Distributions versées aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(3)	(4)	(92)	(86)	(220)	(211)	(76)	(47)	(20)	(17)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(6)	(11)	–	–	–	–	(1 172)	(1 359)	(575)	(706)
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	(2)	(7)	(1)	(6)
Total des distributions versées aux porteurs de titres	(9)	(15)	(92)	(86)	(220)	(211)	(1 250)	(1 413)	(596)	(729)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	8	–	32	68	22	175	2 492	2 497	597	1 309
Réinvestissement des distributions	3	3	92	–	220	211	828	930	348	388
Paiements au rachat de titres	(3)	(5)	(973)	(499)	(1 998)	(1 892)	(9 121)	(6 677)	(2 479)	(4 083)
Total des opérations sur les titres	8	(2)	(849)	(431)	(1 756)	(1 506)	(5 801)	(3 250)	(1 534)	(2 386)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	12	(23)	(549)	(627)	(1 009)	(2 014)	(4 889)	(6 143)	(1 495)	(3 560)
À la clôture	227	378	7 255	7 247	17 580	18 757	49 145	54 253	14 378	16 128
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :	Titres		Titres		Titres		Titres		Titres	
Titres en circulation, à l'ouverture	18	33	363	384	1 461	1 710	5 665	6 308	3 035	3 635
Émis	1	–	2	3	2	15	263	265	115	246
Réinvestissement des distributions	–	–	4	–	17	18	87	99	68	74
Rachetés	–	–	(45)	(24)	(156)	(157)	(961)	(709)	(479)	(773)
Titres en circulation, à la clôture	19	33	324	363	1 324	1 586	5 054	5 963	2 739	3 182

	Série Investisseur		Série-B		Série Conseiller		Série LB		Série LF	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	38 171	45 338	4 018	3 952	118	114	7 356	7 054	21 840	21 810
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	1 670	(951)	213	(56)	6	(3)	303	(196)	1 069	(441)
Distributions versées aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(135)	(94)	(50)	(41)	–	–	(7)	–	(167)	(135)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Total des distributions versées aux porteurs de titres	(135)	(94)	(50)	(41)	–	–	(7)	–	(167)	(135)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	–	–	–	–	–	–	979	1 279	2 350	1 784
Réinvestissement des distributions	124	87	50	41	–	–	7	–	167	135
Paiements au rachat de titres	(3 376)	(6 524)	(213)	(212)	(12)	–	(1 587)	(1 026)	(3 042)	(1 570)
Total des opérations sur les titres	(3 252)	(6 437)	(163)	(171)	(12)	–	(601)	253	(525)	349
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	(1 717)	(7 482)	–	(268)	(6)	(3)	(305)	57	377	(227)
À la clôture	36 454	37 856	4 018	3 684	112	111	7 051	7 111	22 217	21 583
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :	Titres		Titres		Titres		Titres		Titres	
Titres en circulation, à l'ouverture	3 169	3 939	315	325	10	10	624	625	1 670	1 747
Émis	–	–	–	–	–	–	82	115	178	143
Réinvestissement des distributions	10	8	4	3	–	–	1	–	13	11
Rachetés	(278)	(569)	(17)	(17)	(1)	–	(134)	(92)	(233)	(126)
Titres en circulation, à la clôture	2 901	3 378	302	311	9	10	573	648	1 628	1 775

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

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 LF5		Série LW		Série LW5		Série LX	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES								
À l'ouverture	596	671	23 622	23 785	607	749	105	135
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	29	(14)	1 037	(596)	21	(18)	3	(4)
Distributions versées aux porteurs de titres :								
Revenu de placement	(5)	(5)	(50)	(19)	(1)	(1)	–	–
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(10)	(13)	–	–	(13)	(16)	(2)	(3)
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	–	–
Total des distributions versées aux porteurs de titres	(15)	(18)	(50)	(19)	(14)	(17)	(2)	(3)
Opérations sur les titres :								
Produit de l'émission de titres	–	193	1 860	2 492	33	–	–	–
Réinvestissement des distributions	8	14	49	19	13	16	2	3
Paievements au rachat de titres	(31)	(127)	(2 839)	(2 851)	(96)	(94)	(24)	(32)
Total des opérations sur les titres	(23)	80	(930)	(340)	(50)	(78)	(22)	(29)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	(9)	48	57	(955)	(43)	(113)	(21)	(36)
À la clôture	587	719	23 679	22 830	564	636	84	99
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :	Titres		Titres		Titres		Titres	
Titres en circulation, à l'ouverture	39	44	1 976	2 082	45	56	8	10
Émis	–	12	154	219	2	–	–	–
Réinvestissement des distributions	–	1	4	2	1	1	–	–
Rachetés	(2)	(8)	(236)	(251)	(7)	(7)	(2)	(2)
Titres en circulation, à la clôture	37	49	1 898	2 052	41	50	6	8

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

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

	2024 \$	2023 \$
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation	254 199	(126 661)
Ajustements pour :		
Perte (profit) net(te) réalisé(e) sur les placements	(67 834)	(48 124)
Variation de la perte (du profit) net(te) latent(e) sur les placements	(174 405)	190 301
Achat de placements	(1 862 294)	(1 695 046)
Produit de la vente et de l'échéance de placements	1 830 860	1 515 014
(Augmentation) diminution des sommes à recevoir et autres actifs	5 248	(251)
Augmentation (diminution) des sommes à payer et autres passifs	(11)	(10)
Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités d'exploitation	(14 237)	(164 777)

Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de titres	303 295	382 156
Paiements au rachat de titres	(633 716)	(433 222)
Distributions versées, déduction faite des réinvestissements	(6 493)	(6 277)
Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités de financement	(336 914)	(57 343)

Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie	(351 151)	(222 120)
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à l'ouverture	481 716	233 278
Incidence des fluctuations des taux de change sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie	48	192
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture	130 613	11 350

Trésorerie	54 682	11 350
Équivalents de trésorerie	75 931	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture	130 613	11 350

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

Dividendes reçus	29 825	25 866
Impôts étrangers payés	1 744	1 167
Intérêts reçus	41 509	37 105
Intérêts versés	5	25

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES PLACEMENTS

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 \$)
OBLIGATIONS					
407 International Inc. 4,22 % 14-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 310 000	1 310	1 337
407 International Inc. 3,14 % 06-03-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 476 000	4 268	4 417
407 International Inc. 3,43 % 01-06-2033, série MTN	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 948 000	2 026	1 889
407 International Inc. 3,60 % 21-05-2047, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 470 000	2 175	2 139
407 International Inc. 3,67 % 08-03-2049, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 058 000	2 605	2 669
407 International Inc. 4,86 % 31-07-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	652 000	651	685
407 International Inc. 4,68 % 07-10-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	490 000	498	501
AerCap Ireland Capital DAC 3,00 % 29-10-2028	Irlande	Sociétés – Non convertibles	1 228 000 USD	1 419	1 570
Aéroports de Montréal 6,55 % 11-10-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	159 000	188	187
Aéroports de Montréal 3,92 % 12-06-2045, rachetables 2044	Canada	Sociétés – Non convertibles	124 000	115	115
Aéroports de Montréal 3,36 % 24-04-2047, rachetables 2046	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 601 000	1 240	1 351
Aéroports de Montréal 3,03 % 21-04-2050, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	179 000	139	141
AES Andes SA 6,30 % 15-03-2029	Chili	Sociétés – Non convertibles	858 000 USD	1 159	1 206
AIMCo Realty Investors LP 2,20 % 04-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 010 000	1 010	985
AIMCo Realty Investors LP 2,71 % 01-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 096 000	2 020	2 008
Air Lease Corp. 5,40 % 01-06-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 770 000	3 780	3 949
Alectra Inc. 3,24 % 21-11-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	460 000	481	459
Alectra Inc. 1,75 % 11-02-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 101 000	966	984
Alectra Inc. 4,63 % 13-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 578 000	1 578	1 652
Algonquin Power & Utilities Corp. 4,09 % 17-02-2027, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 940 000	3 882	3 983
Algonquin Power & Utilities Corp. 2,85 % 15-07-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	6 466 000	5 555	6 364
Algonquin Power & Utilities Corp., taux variable 18-01-2082 (\$ US)	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 574 000 USD	3 225	3 266
Algonquin Power & Utilities Corp., taux variable 18-01-2082 (\$ CA)	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 114 000	1 996	1 999
Alimentation Couche-Tard inc. 5,59 % 25-09-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 240 000	2 240	2 416
AltaGas Ltd., taux variable 11-01-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	800 000	800	741
AltaGas Ltd., taux variable 10-11-2083	Canada	Sociétés – Non convertibles	920 000	920	1 008
AltaLink, L.P. 4,74 % 22-05-2054	Canada	Sociétés – Non convertibles	810 000	810	841
AltaLink, L.P. 5,46 % 11-10-2055	Canada	Sociétés – Non convertibles	840 000	840	971
Altice International SARL 5,00 % 15-01-2028 144A	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	300 000 USD	341	343
Amazon.com Inc. 4,70 % 01-12-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 930 000 USD	2 622	2 713
American Tower Corp. 1,88 % 15-10-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	840 000 USD	1 119	979
Anglian Water Services Financing PLC 4,53 % 26-08-2032	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	701 000	701	696
ARC Resources Ltd. 3,47 % 10-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	266 000	255	255
Ascend Wellness Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 27-08-2025	États-Unis	Prêts à terme	130 909 USD	164	175
AT&T Inc. 4,85 % 25-05-2047	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	906 000	812	867
ATCO Ltd., taux variable 01-11-2078, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 710 000	3 648	3 781
Athene Global Funding 3,13 % 10-03-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	980 000	980	976
Athene Global Funding 2,10 % 24-09-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 410 000	1 408	1 386
Athene Global Funding 2,47 % 09-06-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	492 000	442	468
Athene Global Funding 5,11 % 07-03-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 140 000	1 140	1 190
Avolon Holdings Funding Ltd. 5,75 % 01-03-2029 144A	Irlande	Sociétés – Non convertibles	2 130 000 USD	2 851	2 968
Bank of America Corp., taux variable 15-09-2027 (taux variable différé)	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	6 713 000	6 147	6 504
Bank of America Corp., taux variable 16-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	6 001 000	5 760	5 995
Banque de Montréal 3,65 % 01-04-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 370 000	2 308	2 379
Banque de Montréal 4,31 % 01-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	6 761 000	6 691	6 894
Banque de Montréal 4,71 % 07-12-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	13 922 000	13 792	14 403
Banque de Montréal 3,19 % 01-03-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 810 000	2 710	2 799
Banque de Montréal 4,54 % 18-12-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 010 000	3 010	3 117
Banque de Montréal 4,42 % 17-07-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 750 000	3 750	3 872
Banque de Montréal, taux variable 27-10-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 823 000	2 906	3 039
Banque de Montréal, taux variable 07-09-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 945 000	4 936	5 305
Banque de Montréal, taux variable 03-07-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 810 000	1 810	1 879
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	7 088 000	6 936	7 001
Banque de Montréal, taux variable 26-05-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 410 000	3 316	3 411
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 278 000	5 293	5 527
La Banque de Nouvelle-Écosse 5,50 % 29-12-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 715 000	3 750	3 795
La Banque de Nouvelle-Écosse 5,50 % 08-05-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 262 000	3 301	3 358
La Banque de Nouvelle-Écosse 4,68 % 01-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 200 000	2 199	2 293

FONDS ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 26-09-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 761 000	1 763	1 768
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 03-05-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 197 000	1 197	1 200
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 02-08-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 100 000	1 100	1 166
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 01-08-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 540 000	1 537	1 597
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 27-07-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 197 000	3 179	3 308
Baytex Energy Corp. 8,50 % 30-04-2030 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	626 000 USD	880	878
BCE Inc. 2,20 % 29-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 226 000	2 004	2 125
BCE Inc. 3,00 % 17-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 056 000	935	998
BCI QuadReal Realty 2,55 % 24-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 572 000	2 533	2 533
bclMC Realty Corp. 1,07 % 04-02-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	440 000	440	426
Becle SAB de CV 2,50 % 14-10-2031	Mexique	Sociétés – Non convertibles	1 250 000 USD	1 566	1 408
Bell Canada 4,45 % 27-02-2047, rachetables 2046	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 363 000	1 478	1 244
Bell Canada 5,15 % 14-11-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	6 146 000	6 203	6 461
Bell Canada 5,25 % 15-03-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 080 000	2 078	2 203
Compagnie de téléphone Bell du Canada 5,15 % 24-08-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 234 000	1 230	1 302
Compagnie de téléphone Bell du Canada 5,15 % 09-02-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 000 000	967	1 010
Bimbo Bakeries USA Inc. 6,05 % 15-01-2029	Mexique	Sociétés – Non convertibles	1 440 000 USD	1 989	2 059
BP Capital Markets PLC 3,47 % 15-05-2025	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	981 000	992	978
British Columbia Investment Management 4,90 % 02-06-2033	Canada	Gouvernements provinciaux	6 021 000	6 293	6 620
Broadcast Media Partners Holdings Inc. 4,50 % 01-05-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	250 000 USD	303	304
Broadcom Inc. 4,11 % 15-09-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 905 000 USD	2 429	2 573
Brookfield Infrastructure Finance ULC 5,62 % 14-11-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 660 000	1 660	1 750
Brookfield Infrastructure Finance ULC 4,20 % 11-09-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 437 000	3 527	3 486
Brookfield Infrastructure Finance ULC 2,86 % 01-09-2032, rachetables 2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	222 000	222	201
Brookfield Renewable Energy Partners ULC 3,63 % 15-01-2027, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	12 967 000	12 443	12 975
Brookfield Renewable Partners ULC 4,25 % 15-01-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 233 000	1 254	1 255
Brookfield Renewable Partners ULC 5,29 % 28-10-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	689 000	726	736
Brookfield Renewable Partners ULC 4,96 % 20-10-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 050 000	1 050	1 089
Bruce Power L.P. 4,00 % 21-06-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 145 000	2 045	2 158
Bruce Power L.P. 4,99 % 21-12-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	400 000	400	421
CAE Inc. 5,54 % 12-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 140 000	1 140	1 197
Administration aéroportuaire de Calgary 3,55 % 07-10-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	526 000	459	451
Administration aéroportuaire de Calgary 3,55 % 07-10-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	480 000	388	410
Corporation Cameco 4,94 % 24-05-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 202 000	1 203	1 258
Investissements RPC 2,25 % 01-12-2031	Canada	Gouvernement fédéral	5 782 000	5 564	5 401
Canadian Core Real Estate LP 3,30 % 02-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 080 000	1 080	1 058
Banque Canadienne Impériale de Commerce 1,10 % 19-01-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	86 000	85	83
Banque Canadienne Impériale de Commerce 5,00 % 07-12-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 184 000	2 184	2 252
Banque Canadienne Impériale de Commerce 4,95 % 29-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 461 000	5 511	5 659
Banque Canadienne Impériale de Commerce 5,05 % 07-10-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 579 000	1 565	1 646
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 21-04-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 122 000	1 987	2 068
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 07-04-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	919 000	909	926
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 20-01-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 100 000	1 100	1 146
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 20-04-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 330 000	1 328	1 390
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 16-01-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 750 000	1 750	1 836
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 12-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 910 000	1 907	1 975
Banque Canadienne Impériale de Commerce 4,38 % 28-10-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 217 000	5 021	5 160
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 28-07-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	925 000	923	959
Fonds hypothécaire Canada 3,84 % 01-11-2028	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	9 520 638	9 244	9 677
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada 4,40 % 10-05-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 260 000	1 258	1 309
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 2,54 % 28-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	6 753 000	6 294	6 572

FONDS ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

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 \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 3,15 % 13-03-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 872 000	2 690	2 834
Canadian Utilities Ltd. 4,85 % 03-06-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 700 000	2 689	2 753
Banque canadienne de l'Ouest 3,86 % 21-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 650 000	1 650	1 649
Banque canadienne de l'Ouest 5,26 % 20-12-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	750 000	750	763
Banque canadienne de l'Ouest 1,93 % 16-04-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 610 000	4 310	4 500
Banque canadienne de l'Ouest 5,15 % 02-09-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 460 000	2 463	2 571
Banque canadienne de l'Ouest 4,57 % 11-07-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	460 000	460	476
Banque canadienne de l'Ouest, taux variable 22-12-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	480 000	480	506
Banque canadienne de l'Ouest 5,95 % 29-01-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	840 000	840	896
Banque canadienne de l'Ouest, taux variable 31-07-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	400 000	400	391
Cannabist Co. Holdings Inc. 6,00 % 29-06-2025	Canada	Sociétés – Convertibles	125 000 USD	154	144
Cannabist Co. Holdings Inc. 9,50 % 03-02-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	126	102
Capital Power Corp. 4,99 % 23-01-2026, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 124 000	1 154	1 135
Capital Power Corp. 4,83 % 16-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 395 000	1 395	1 415
Cascades inc. 5,13 % 15-01-2026 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	310 000 USD	411	414
CCL Industries Inc. 3,86 % 13-04-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	690 000	696	689
CDP Financière inc. 1,50 % 19-10-2026	Canada	Gouvernements provinciaux	2 220 000	2 116	2 151
CDP Financière inc. 4,20 % 02-12-2030	Canada	Gouvernements provinciaux	3 964 000	4 005	4 177
Genovus Energy Inc. 3,50 % 07-02-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 172 000	5 096	5 146
Centrais Elétricas Brasileiras SA 3,63 % 04-02-2025	Brésil	Sociétés – Non convertibles	460 000 USD	607	617
Central 1 Credit Union 5,88 % 10-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 010 000	1 010	1 050
CES Energy Solutions Corp. 6,88 % 24-05-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	688 000	692	699
CGI inc. 3,99 % 07-09-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 330 000	1 330	1 345
CGI inc. 4,15 % 05-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	940 000	940	954
Charter Communications Operating LLC 4,50 % 01-05-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 170 000 USD	1 611	1 371
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 2,46 % 30-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	570 000	570	557
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 2,85 % 21-05-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 018 000	3 746	3 944
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 3,53 % 11-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	6 130 000	5 778	6 030
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 5,40 % 01-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 099 000	2 103	2 228
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 5,70 % 28-02-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	486 000	483	526
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 5,03 % 28-02-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	470 000	470	491
CIFI Holdings (Group) Co. Ltd. 6,00 % 16-07-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	442 000 USD	143	58
Ville de Toronto 2,60 % 24-09-2039	Canada	Administrations municipales	800 000	794	661
Clydesdale Acquisition Holdings Inc. 8,75 % 15-04-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	15 000 USD	19	21
Coast Capital Savings Federal Credit Union, taux variable 02-05-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 460 000	2 460	2 587
Coastal GasLink Pipeline LP 4,69 % 30-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	980 000	980	1 024
Coastal GasLink Pipeline LP 4,91 % 30-06-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 420 000	1 420	1 500
Coastal GasLink Pipeline LP 5,19 % 30-09-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 170 000	1 170	1 250
Cogeco Communications inc. 6,13 % 27-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 270 000	1 272	1 305
Cogeco Communications inc. 2,99 % 22-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 286 000	1 280	1 181
Cogeco Communications inc. 5,30 % 16-02-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	440 000	440	463
Cologix Data Centers Issuer LLC 4,94 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	53 000	53	52
Cologix Data Centers Issuer LLC 5,68 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	130 000	130	124
Comber Wind Financial Corp. 5,13 % 15-11-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 002 528	1 066	1 017
Constellation Software Inc. 5,16 % 16-02-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000 USD	337	349
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	594 866	595	581
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-09-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	601 695	602	589
Corp. Nacional del Cobre de Chile 4,50 % 16-09-2025	Chili	Sociétés – Non convertibles	260 000 USD	346	350
Corus Entertainment Inc. 5,00 % 11-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	340 000	340	166
Country Garden Holdings Co. Ltd. 2,70 % 12-07-2026	Chine	Sociétés – Non convertibles	775 000 USD	658	81
Country Garden Holdings 5,63 % 14-01-2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	905 000 USD	622	93
CPPIB Capital Inc. 3,95 % 02-06-2032	Canada	Gouvernement fédéral	2 030 000	1 963	2 109
Fonds de placement immobilier Crombie 3,92 % 21-06-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	163 000	177	163
Fonds de placement immobilier Crombie 2,69 % 31-03-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	750 000	755	719

FONDS ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

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 \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Fonds de placement immobilier Crombie 3,21 % 09-10-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	911 000	917	857
Fonds de placement immobilier Crombie 3,13 % 12-08-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	387 000	386	358
CU Inc. 4,09 % 02-09-2044, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	245 000	238	230
CU Inc. 4,77 % 14-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 125 000	1 124	1 165
CU Inc. 5,09 % 20-09-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 500 000	1 500	1 630
Curaleaf Holdings Inc. 8,00 % 15-12-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 090 000 USD	1 397	1 391
DIRECTV Holdings LLC 5,88 % 15-08-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	251	265
Dollarama inc. 5,08 % 27-10-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	889 000	887	900
Dollarama inc. 5,53 % 26-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 600 000	1 600	1 710
Domtar Corp. 6,75 % 01-10-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	574 000 USD	725	712
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 1,66 % 22-12-2025 (A)	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 170 000	1 169	1 140
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,54 % 07-12-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	760 000	760	740
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,06 % 17-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 190 000	1 139	1 136
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 5,38 % 22-03-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 480 000	1 484	1 544
Ecopetrol SA 4,63 % 02-11-2031	Colombie	Sociétés – Non convertibles	14 000 USD	14	16
Électricité de France SA 4,50 % 21-09-2028 144A	France	Sociétés – Non convertibles	596 000 USD	786	808
Électricité de France SA 5,38 % 17-05-2034	France	Sociétés – Non convertibles	3 392 000	3 392	3 544
L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie 5,50 % 13-01-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	670 000	670	697
L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie 3,63 % 17-04-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	500 000	500	431
Empresas CMPC SA 3,00 % 06-04-2031	Chili	Sociétés – Non convertibles	405 000 USD	505	486
Enbridge Gas Inc. 2,37 % 09-08-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	919 000	874	873
Enbridge Gas Inc. 2,35 % 15-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	480 000	401	439
Enbridge Gas Inc. 5,70 % 06-10-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 684 000	1 725	1 889
Enbridge Gas Inc. 3,20 % 15-09-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 800 000	1 641	1 407
Enbridge Gas Inc. 4,55 % 17-08-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 402 000	4 106	4 351
Enbridge Inc. 4,90 % 26-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 602 000	1 602	1 670
Enbridge Inc. 6,10 % 09-11-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 805 000	1 926	2 024
Enbridge Inc. 3,10 % 21-09-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 813 000	1 648	1 655
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	19 975 000	19 100	20 004
Enbridge Inc., taux variable 12-04-2078, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 982 000	6 058	6 258
Enbridge Inc., taux variable 15-01-2084, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	369 000	385	407
Enbridge Inc., taux variable 15-01-2084, rachetables 2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 093 000	4 270	4 776
Pipelines Enbridge Inc. 4,55 % 29-09-2045, rachetables 2045	Canada	Sociétés – Non convertibles	332 000	297	309
Pipelines Enbridge Inc. 4,33 % 22-02-2049, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	962 000	919	860
Pipelines Enbridge Inc. 5,82 % 17-08-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	284 000	304	315
Enel SPA 2,25 % 12-07-2031 144A	Italie	Sociétés – Non convertibles	250 000 USD	269	294
Énergir inc. 2,10 % 16-04-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	720 000	720	697
Énergir inc. 4,67 % 27-09-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	840 000	840	881
EPCOR Utilities Inc. 3,55 % 27-11-2047, rachetables 2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 060 000	1 041	910
EPCOR Utilities Inc. 3,11 % 08-07-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 378 000	2 902	2 661
EPCOR Utilities Inc. 4,73 % 02-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 150 000	1 150	1 184
EPCOR Utilities Inc. 5,33 % 03-10-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 120 000	3 233	3 513
EPCOR Utilities Inc. 4,99 % 31-05-2054	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 662 000	1 662	1 783
Banque Équitable 1,88 % 26-11-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	184 000	164	180
Banque Équitable 3,36 % 02-03-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	856 000	856	849
Banque Équitable 5,16 % 11-01-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 630 000	1 630	1 675
Banque Équitable 3,99 % 24-03-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 093 000	1 093	1 095
Fairfax Financial Holdings Ltd. 8,30 % 15-04-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 100 000 USD	1 714	1 567
Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,23 % 14-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 653 000	3 539	3 703
Fairfax Financial Holdings Ltd. 3,95 % 03-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 905 000	1 850	1 888
Fairfax India Holdings Corp. 5,00 % 26-02-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	490 000 USD	613	610
Fédération des caisses Desjardins du Québec 5,20 % 01-10-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 561 000	3 576	3 609
Fédération des caisses Desjardins du Québec 1,59 % 10-09-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 491 000	1 401	1 444
Fédération des caisses Desjardins du Québec 4,41 % 19-05-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	914 000	915	935
Fédération des caisses Desjardins du Québec 5,47 % 17-11-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 716 000	2 742	2 903
Fédération des caisses Desjardins du Québec 3,80 % 24-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 377 000	1 377	1 383
Fédération des caisses Desjardins du Québec, taux variable 23-08-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 420 000	2 420	2 496

FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

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 \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Fédération des caisses Desjardins du Québec, taux variable 15-05-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 780 000	1 780	1 868
Fonds de placement immobilier First Capital 3,45 % 01-03-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	960 000	849	943
Fonds de placement immobilier First Capital 5,46 % 12-06-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	680 000	681	713
First Capital Realty Inc. 5,57 % 01-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 999 000	6 105	6 378
First West Credit Union 9,19 % 09-08-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 150 000	1 150	1 279
Compagnie Crédit Ford du Canada 7,00 % 10-02-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 417 000	2 417	2 502
Compagnie Crédit Ford du Canada 7,38 % 12-05-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 291 000	1 291	1 352
Compagnie Crédit Ford du Canada 2,96 % 16-09-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	6 090 000	5 456	5 960
Compagnie Crédit Ford du Canada 6,33 % 10-11-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 220 000	1 220	1 270
Compagnie Crédit Ford du Canada 5,58 % 22-02-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	920 000	920	947
Compagnie Crédit Ford du Canada 5,24 % 23-05-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 300 000	1 300	1 335
Compagnie Crédit Ford du Canada 4,79 % 12-09-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 000 000	1 000	1 007
Ford Motor Credit Co. LLC 6,78 % 15-09-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 930 000	1 930	1 974
Fortis Inc. 4,43 % 31-05-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 922 000	1 923	1 981
Fortis Inc. 4,17 % 09-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 030 000	2 031	2 048
Fortis Inc. 5,68 % 08-11-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 810 000	1 810	1 999
FortisBC Energy Inc. 4,67 % 28-11-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	422 000	425	431
Frontera Generation Holdings LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 28-07-2026	États-Unis	Prêts à terme	23 502 USD	30	42
Frontera Generation Holdings LLC, prêt à terme de second rang, taux variable 26-04-2028	États-Unis	Prêts à terme	22 811 USD	16	25
Location d'équipements Cooper Itée 7,45 % 04-07-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 783 000	2 783	2 846
Financière General Motors du Canada Ltée 5,20 % 09-02-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	700 000	700	726
Financière General Motors du Canada Ltée 5,10 % 14-07-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 114 000	1 112	1 156
Financière General Motors du Canada Ltée 5,00 % 09-02-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 150 000	1 148	1 191
George Weston Itée 4,19 % 05-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 110 000	1 111	1 126
GFL Environmental Inc. 3,75 % 01-08-2025 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	800 000 USD	1 053	1 074
GFL Environmental Inc. 3,50 % 01-09-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 473 000 USD	2 950	3 189
GFL Environmental Inc. 6,75 % 15-01-2031 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 071 000 USD	1 456	1 521
Gibson Energy Inc. 5,75 % 12-07-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 565 000	1 571	1 708
Gibson Energy Inc., taux variable 22-12-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	375 000	377	357
Gibson Energy Inc., taux variable 12-07-2083	Canada	Sociétés – Non convertibles	510 000	516	554
Glencore Funding LLC 5,34 % 04-04-2027 144A	Australie	Sociétés – Non convertibles	600 000 USD	815	832
Glencore Funding LLC 5,70 % 08-05-2033 144A	Australie	Sociétés – Non convertibles	1 223 000 USD	1 689	1 737
GoDaddy Operating Co. LLC 3,50 % 01-03-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	25 000 USD	31	32
The Goldman Sachs Group Inc. 3,31 %, taux variable 31-10-2025, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 030 000	2 191	2 028
The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 30-11-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 280 000	2 280	2 231
The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 28-02-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 037 000	1 001	983
Gouvernement des Bahamas 6,00 % 21-11-2028, rachetables 2028	Bahamas	Gouvernements étrangers	202 000 USD	259	257
Gouvernement des Bahamas 6,95 % 20-11-2029	Bahamas	Gouvernements étrangers	129 000 USD	188	165
Gouvernement des Bahamas 8,95 % 15-10-2032	Bahamas	Gouvernements étrangers	800 000 USD	1 035	1 104
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2027	Brésil	Gouvernements étrangers	1 800 000 BRL	4 591	4 276
Gouvernement du Canada 2,25 % 01-12-2029	Canada	Gouvernement fédéral	556 000	554	544
Gouvernement du Canada 3,50 % 01-03-2034	Canada	Gouvernement fédéral	1 514 000	1 508	1 586
Gouvernement du Canada 3,00 % 01-06-2034	Canada	Gouvernement fédéral	23 341 000	22 094	23 441
Gouvernement du Canada 0,50 % 01-12-2050, rendement réel	Canada	Gouvernement fédéral	14 777 000	16 206	14 493
Obligations du gouvernement du Canada indexées sur l'inflation 0,25 % 01-12-2054	Canada	Gouvernement fédéral	3 550 000	2 846	2 947
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-12-2055	Canada	Gouvernement fédéral	149 027 000	131 293	137 752
Fiducie de placement immobilier Granite 3,06 % 04-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 180 000	2 000	2 144
Fiducie de placement immobilier Granite 2,19 % 30-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 764 000	1 685	1 659
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 1,54 % 03-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 369 000	2 965	3 172
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 7,05 % 12-06-2030, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 062 000	1 212	1 234
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 7,10 % 04-06-2031, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 062 000	1 231	1 258
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 6,47 % 02-02-2034, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	209 000	242	247
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 2,75 % 17-10-2039	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 853 000	4 622	4 819
Fonds de placement immobilier H&R 4,07 % 16-06-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 725 000	1 769	1 723

FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
HCA Healthcare Inc. 3,50 % 01-09-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	309 000 USD	411	394
Heathrow Funding Ltd. 3,25 % 21-05-2025	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	4 430 000	4 326	4 408
Heathrow Funding Ltd. 2,69 % 13-10-2027	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	821 000	821	800
Heathrow Funding Ltd. 3,40 % 08-03-2028	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	6 950 000	6 814	6 889
Heathrow Funding Ltd. 3,79 % 04-09-2030, rachetables 2030	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	1 427 000	1 397	1 407
Heathrow Funding Ltd. 3,73 % 13-04-2033	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	3 359 000	3 166	3 198
Hydro One Inc. 4,91 % 27-01-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	7 632 000	7 673	8 000
Hydro One Inc. 7,35 % 03-06-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 413 000	3 898	4 024
Hydro One Inc. 2,23 % 17-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 264 000	2 114	2 075
Hydro One Inc. 6,93 % 01-06-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 376 000	1 603	1 641
Hydro One Inc. 4,16 % 27-01-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	693 000	692	711
Hydro One Inc. 4,39 % 01-03-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 620 000	1 619	1 680
Hydro One Inc. 4,89 % 13-03-2037	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 913 000	1 862	2 009
Hydro One Inc. 4,85 % 30-11-2054	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 556 000	5 653	5 873
Hyundai Capital Canada Inc. 4,90 % 31-01-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 720 000	1 720	1 790
iA Société financière inc., taux variable 20-06-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	900 000	900	952
L'Ordre Indépendant des Forestiers, taux variable 15-10-2035, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	830 000	830	746
Intact Corporation financière 5,46 % 22-09-2032 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	790 000 USD	1 047	1 096
Intact Corporation financière, taux variable 16-05-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	750 000	750	781
Intact Corporation financière 5,28 % 14-09-2054	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 642 000	1 769	1 827
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	3 350 000	3 432	3 325
Inter Pipeline Ltd. 5,71 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	781 000	781	825
Inter Pipeline Ltd. 3,98 % 25-11-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	547 000	475	520
Inter Pipeline Ltd., taux variable 26-03-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	540 000	540	550
Inter Pipeline Ltd., taux variable 19-11-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000	193	201
Banque internationale pour la reconstruction et le développement 0 % 31-03-2027	Supranationales	s.o.	1 450 000 USD	1 778	1 786
Ivanhoe Cambridge II Inc. 2,30 % 12-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	277 000	286	276
The J.M. Smucker Co. 2,38 % 15-03-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	420 000 USD	490	515
Jazz Pharmaceuticals PLC 4,38 % 15-01-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	250	262
John Deere Financial Inc. 5,17 % 15-09-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	360 000	355	382
JPMorgan Chase & Co. 1,90 % 05-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	5 129 000	4 830	4 937
Kaisa Group Holdings Ltd. 11,70 % 11-11-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	400 000 USD	481	18
Kaisa Group Holdings 9,38 % 10-12-2024	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	165	13
Kaisa Group Holdings 8,65 % 10-12-2024	Chine	Sociétés – Non convertibles	700 000 USD	303	31
Kaisa Group Holdings 10,50 % 10-12-2024	Chine	Sociétés – Non convertibles	500 000 USD	372	20
Keyera Corp. 3,96 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 024 000	4 030	4 003
Keyera Corp., taux variable 13-06-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	670 000	671	692
Keyera Corp., taux variable 10-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 100 000	2 017	2 071
Knight Health Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 17-12-2028	États-Unis	Prêts à terme	377 827 USD	451	294
Produits Kruger S.E.C. 6,00 % 24-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000	201	199
Produits Kruger S.E.C. 5,38 % 09-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	180 000	180	171
LABL Escrow Issuer LLC 6,75 % 15-07-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	95 000 USD	127	129
LABL Escrow Issuer LLC 10,50 % 15-07-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	73 000 USD	98	99
LABL Inc. 8,25 % 01-11-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	81 000 USD	92	99
LABL Inc. 8,63 % 01-10-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	92 000 USD	124	124
Banque Laurentienne du Canada, taux variable 15-06-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 191 000	2 191	2 150
LGI Homes Inc. 8,75 % 15-12-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	60 000 USD	82	87
Liberty Utilities (Canada) LP 3,32 % 14-02-2050, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	590 000	590	449
Les Compagnies Loblaw ltée 5,34 % 13-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	770 000	770	828
Les Compagnies Loblaw ltée 5,12 % 04-03-2054	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 820 000	1 820	1 900
Logan Group Co. Ltd. 4,70 % 06-07-2026	Chine	Sociétés – Non convertibles	1 479 000 USD	1 179	176
Lower Mattagami Energy LP 2,43 % 14-05-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 770 000	1 706	1 645
Lower Mattagami Energy LP 4,85 % 31-10-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 136 000	1 149	1 219
Lower Mattagami Energy LP 4,69 % 07-06-2054	Canada	Sociétés – Non convertibles	840 000	840	872
LSF10 XL Bidco SCA, prêt à terme B de premier rang, taux variable 30-03-2028	Luxembourg	Prêts à terme	520 617 EUR	767	717
Banque Manuvie du Canada 1,54 % 14-09-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 107 000	1 033	1 069
Banque Manuvie du Canada 2,86 % 16-02-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 860 000	1 860	1 836
Société Financière Manuvie, taux variable 10-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 686 000	3 757	3 872

FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

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 \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Société Financière Manuvie, taux variable 23-02-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 640 000	1 640	1 713
Société Financière Manuvie, taux variable 19-06-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 728 000	1 719	1 786
Mattamy Group Corp. 4,63 % 01-03-2030, rachetables 2025 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	164 000 USD	179	213
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 9,25 % 15-04-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	19 000 USD	23	26
Mauser Packaging 7,88 % 15-04-2027, nom.	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	18 000 USD	25	25
McDonald's Corp. 3,80 % 01-04-2028, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	610 000 USD	859	817
MEG Energy Corp. 7,13 % 01-02-2027 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	70 000 USD	92	96
MEG Energy Corp. 5,88 % 01-02-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	856 000 USD	1 113	1 135
Metro inc. 4,66 % 07-02-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	582 000	577	605
Micron Technology Inc. 5,38 % 15-04-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 905 000 USD	2 562	2 654
Mozart Debt Merger Sub Inc. 3,88 % 01-04-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	741 000 USD	938	950
Mozart Debt Merger Sub Inc. 5,25 % 01-10-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 092 000 USD	1 379	1 449
Banque Nationale du Canada 5,30 % 03-11-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 957 000	5 977	6 052
Banque Nationale du Canada 1,53 % 15-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	884 000	853	858
Banque Nationale du Canada 5,22 % 14-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 710 000	2 705	2 866
Banque Nationale du Canada 5,02 % 01-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 740 000	2 770	2 892
Banque Nationale du Canada, taux variable 16-08-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 400 000	2 400	2 503
Banque Nationale du Canada 5,28 % 15-02-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	880 000	880	923
Banque Nationale du Canada, taux variable 15-08-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 220 000	1 222	1 081
NAV CANADA 2,06 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	690 000	690	639
Nestlé Holdings Inc. 2,19 % 26-01-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 220 000	1 220	1 165
New Red Finance Inc. 4,00 % 15-10-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	75 000 USD	99	94
Nexstar Escrow Inc. 5,63 % 15-07-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	169 000 USD	225	227
NextEra Energy Capital Holdings Inc. 1,90 % 15-06-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	710 000 USD	854	885
NextEra Energy Capital Holdings Inc. 2,25 % 01-06-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 600 000 USD	2 247	1 939
NextEra Energy Capital Holdings Inc. 4,85 % 30-04-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	4 203 000	4 219	4 387
North West Redwater Partnership 3,20 % 24-04-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 745 000	1 668	1 736
North West Redwater Partnership 2,80 % 01-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 068 000	4 932	4 984
North West Redwater Partnership 4,25 % 01-06-2029, rachetables, série F	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 630 000	4 518	4 752
North West Redwater Partnership 2,80 % 01-06-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 240 000	5 000	4 907
North West Redwater Partnership 4,15 % 01-06-2033, série H	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 101 000	3 702	4 111
North West Redwater Partnership 4,85 % 01-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 110 000	1 109	1 163
North West Redwater Partnership 3,65 % 01-06-2035, rachetables 2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 340 000	2 034	2 209
North West Redwater Partnership 3,70 % 23-02-2043, rachetables 2042	Canada	Sociétés – Non convertibles	449 000	413	393
Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc. 4,11 % 31-03-2042	Canada	Sociétés – Non convertibles	775 968	785	717
NXP BV 2,65 % 15-02-2032	Chine	Sociétés – Non convertibles	420 000 USD	524	493
Omega Healthcare Investors Inc. 4,50 % 15-01-2025, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	410 000 USD	507	554
OMERS Finance Trust 1,55 % 21-04-2027	Canada	Gouvernements provinciaux	6 080 000	5 833	5 850
Ontario Power Generation Inc. 2,89 % 08-04-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 364 000	2 281	2 350
Ontario Power Generation Inc. 1,17 % 22-04-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 075 000	958	1 036
Ontario Power Generation Inc. 2,98 % 13-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 034 000	1 026	1 007
Ontario Power Generation Inc. 4,92 % 19-07-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	550 000	550	585
Ontario Power Generation Inc. 4,83 % 28-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 280 000	1 280	1 345
Ontario Teachers' Finance Trust 1,10 % 19-10-2027	Canada	Gouvernements provinciaux	830 000	828	784
Ontario Teachers' Finance Trust 4,30 % 02-06-2034	Canada	Gouvernements provinciaux	4 978 000	5 048	5 202
Régime de retraite des enseignantes et des enseignants de l'Ontario 4,45 % 02-06-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	3 191 000	3 193	3 396
OPB Finance Trust 2,98 % 25-01-2027	Canada	Gouvernements provinciaux	917 000	967	911
Corporation Parkland du Canada 3,88 % 16-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	6 510 000	6 248	6 411
Corporation Parkland du Canada 4,38 % 26-03-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	741 000	683	716
Corporation Pétroles Parkland 5,88 % 15-07-2027 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	37 000 USD	49	50
Corporation Pétroles Parkland 6,00 % 23-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 300 000	3 283	3 321
PayPal Holdings Inc. 2,30 % 01-06-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	610 000 USD	853	749
Pembina Pipeline Corp. 5,72 % 22-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	625 000	625	625
Pembina Pipeline Corp. 4,02 % 27-03-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	7 260 000	7 221	7 342

FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Pembina Pipeline Corp. 5,22 % 28-06-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 470 000	1 469	1 552
Pembina Pipeline Corp. 5,21 % 12-01-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 350 000	1 349	1 418
Pembina Pipeline Corp. 4,81 % 25-03-2044	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 694 000	2 786	2 552
Pembina Pipeline Corp. 4,74 % 21-01-2047, rachetables 2046, série MTN	Canada	Sociétés – Non convertibles	875 000	832	818
Pembina Pipeline Corp. 5,67 % 12-01-2054	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 130 000	1 129	1 201
Pembina Pipeline Corp., taux variable 25-01-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 500 000	2 363	2 341
Perrigo Co. PLC 3,15 % 15-06-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	62 000 USD	77	82
Pétróleos de Venezuela 6,00 % 06-12-2024	Venezuela	Sociétés – Non convertibles	420 000 USD	130	55
Pétróleos Mexicanos 6,70 % 16-02-2032	Mexique	Sociétés – Non convertibles	26 000 USD	33	32
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 4,65 % 19-05-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	4 837 000 USD	6 509	6 699
Prime Structured Mortgage Trust 1,86 % 15-11-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 233 000	1 233	1 229
Prologis Inc. 4,70 % 01-03-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 580 000	1 577	1 637
Prologis Inc. 5,25 % 15-01-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	580 000	568	619
Province de l'Alberta 4,15 % 01-06-2033	Canada	Gouvernements provinciaux	4 360 000	4 290	4 569
Province de l'Alberta 3,05 % 01-12-2048	Canada	Gouvernements provinciaux	4 580 000	4 744	3 819
Province de l'Alberta 3,10 % 01-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	29 605 000	30 182	24 839
Province de l'Alberta 2,95 % 01-06-2052	Canada	Gouvernements provinciaux	24 766 000	20 924	20 073
Province de l'Alberta 4,45 % 01-12-2054	Canada	Gouvernements provinciaux	5 123 000	5 444	5 420
Province de la Colombie-Britannique 4,15 % 18-06-2034	Canada	Gouvernements provinciaux	10 358 000	10 306	10 783
Province de la Colombie-Britannique 2,95 % 18-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	8 954 000	9 563	7 307
Province de la Colombie-Britannique 4,45 % 18-12-2055	Canada	Gouvernements provinciaux	8 665 000	8 995	9 190
Province du Manitoba 3,20 % 05-03-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	6 970 000	7 464	5 865
Province du Manitoba 2,05 % 05-09-2052	Canada	Gouvernements provinciaux	13 465 000	9 442	8 727
Province du Manitoba 3,80 % 05-09-2053	Canada	Gouvernements provinciaux	2 686 000	2 491	2 501
Province de l'Ontario 4,05 % 02-02-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	12 870 000	12 854	13 476
Province de l'Ontario 4,10 % 04-03-2033	Canada	Gouvernements provinciaux	953 000	950	996
Province de l'Ontario 4,15 % 02-06-2034	Canada	Gouvernements provinciaux	124 939 000	122 964	130 229
Province de l'Ontario 4,15 % 02-12-2054	Canada	Gouvernements provinciaux	13 304 000	13 054	13 477
Province de l'Ontario 4,60 % 02-12-2055	Canada	Gouvernements provinciaux	18 107 000	19 509	19 791
Province de Québec 3,65 % 20-05-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	2 340 000	2 340	2 387
Province de Québec 3,90 % 22-11-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	2 500 000	2 462	2 588
Province de Québec 4,45 % 01-09-2034	Canada	Gouvernements provinciaux	37 445 000	37 924	39 889
Province de Québec 4,40 % 01-12-2055	Canada	Gouvernements provinciaux	57 500 000	58 746	60 547
Province de la Saskatchewan 2,15 % 02-06-2031	Canada	Gouvernements provinciaux	779 000	683	728
Province de la Saskatchewan 3,10 % 02-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	11 881 000	11 329	9 981
Province de la Saskatchewan 2,80 % 02-12-2052	Canada	Gouvernements provinciaux	6 877 000	6 796	5 396
Province de la Saskatchewan 4,20 % 02-12-2054	Canada	Gouvernements provinciaux	2 692 000	2 751	2 732
PSP Capital Inc. 0,90 % 15-06-2026	Canada	Gouvernement fédéral	2 071 000	2 069	1 997
PSP Capital Inc. 2,60 % 01-03-2032	Canada	Gouvernement fédéral	6 692 000	6 193	6 358
PSP Capital Inc. 4,15 % 01-06-2033	Canada	Gouvernement fédéral	200 000	202	209
Reliance LP 2,68 % 01-12-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	720 000	720	695
Reliance LP 2,67 % 01-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 070 000	1 070	1 019
Reliance LP 5,25 % 15-05-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 737 000	1 735	1 819
Renesas Electronics Corp. 1,54 % 26-11-2024	Japon	Sociétés – Non convertibles	920 000 USD	1 160	1 238
Fonds de placement immobilier RioCan 2,83 % 08-11-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 788 000	1 620	1 704
Rogers Communications Inc. 3,10 % 15-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 691 000	5 445	5 660
Rogers Communications Inc. 5,70 % 21-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 010 000	3 006	3 209
Rogers Communications Inc. 3,75 % 15-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 748 000	5 462	5 706
Rogers Communications Inc. 2,90 % 09-12-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 324 000	1 275	1 238
Rogers Communications Inc. 5,25 % 15-04-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 449 000	1 405	1 458
Rogers Communications Inc., taux variable 17-12-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	22 485 000	20 946	22 232
Rogers Communications Inc., taux variable 15-03-2082 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 510 000 USD	4 494	4 662
Banque Royale du Canada 5,24 % 02-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 163 000	2 169	2 240
Banque Royale du Canada 2,33 % 28-01-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 528 000	2 279	2 467
Banque Royale du Canada 4,61 % 26-07-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 626 000	1 611	1 676
Banque Royale du Canada 4,64 % 17-01-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 860 000	3 853	3 999
Banque Royale du Canada 4,63 % 01-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 680 000	1 680	1 745
Banque Royale du Canada, taux variable 03-05-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 424 000	1 343	1 397
Banque Royale du Canada, taux variable 03-04-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 850 000	1 850	1 933
Banque Royale du Canada, taux variable 08-08-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 576 000	3 576	3 695
Banque Royale du Canada, taux variable 24-11-2080, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	11 631 000	11 363	11 525
Royal Caribbean Cruises Ltd. 6,00 % 01-02-2033 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	933 000 USD	1 292	1 294

FONDS ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
S&P Global Inc. 1,25 % 15-08-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	530 000 USD	704	612
Sagen MI Canada Inc. 3,26 % 05-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	401 000	401	363
Sagen MI Canada Inc., taux variable 24-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	680 000	680	631
Saputo inc. 5,49 % 20-11-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 700 000	1 701	1 830
Sea to Sky Highway Investment LP 2,63 % 31-08-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	932 185	931	893
Sienna Senior Living Inc. 3,11 % 04-11-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	440 000	440	439
Sienna Senior Living Inc. 3,45 % 27-02-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	550 000	550	545
Sienna Senior Living Inc. 2,82 % 31-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	370 000	370	359
Sienna Senior Living Inc. 4,44 % 17-10-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	340 000	340	342
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 2,70 % 13-01-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	87	19
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 5,95 % 04-02-2027	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	62	20
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 4,75 % 05-08-2029	Chine	Sociétés – Non convertibles	806 000 USD	461	79
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 4,75 % 14-01-2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	250 000 USD	81	24
South Bow Canadian Infrastructure Holdings Ltd. 4,32 % 01-02-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	520 000	520	526
South Bow Canadian Infrastructure Holdings Ltd. 4,62 % 01-02-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	850 000	850	860
Sprint Spectrum Co. LLC 4,74 % 20-03-2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	135 000 USD	175	183
Spy Hill Power LP 4,14 % 31-03-2036	Canada	Sociétés – Non convertibles	509 497	524	500
Stella-Jones Inc. 4,31 % 01-10-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	850 000	851	854
Financière Sun Life inc., taux variable 10-05-2032, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	7 080 000	6 529	6 900
Financière Sun Life inc., taux variable 21-11-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	7 348 000	6 662	7 079
Financière Sun Life inc., taux variable 10-08-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	6 028 000	5 984	6 266
Financière Sun Life inc., taux variable 04-07-2035	Canada	Sociétés – Non convertibles	687 000	687	739
Financière Sun Life inc., taux variable 01-10-2035	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 450 000	1 449	1 307
Financière Sun Life inc., taux variable 15-05-2036	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 210 000	2 210	2 334
Sunac China Holdings Ltd. 6,00 % 30-09-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	61 134 USD	23	10
Sunac China Holdings Ltd. 6,25 % 30-09-2026	Chine	Sociétés – Non convertibles	61 208 USD	21	9
Sunac China Holdings Ltd. 6,50 % 30-09-2027	Chine	Sociétés – Non convertibles	122 567 USD	37	17
Sunac China Holdings Ltd. 6,75 % 30-09-2028	Chine	Sociétés – Non convertibles	184 073 USD	50	23
Sunac China Holdings Ltd. 7,00 % 30-09-2029	Chine	Sociétés – Non convertibles	184 296 USD	45	20
Sunac China Holdings Ltd. 7,25 % 30-09-2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	86 679 USD	18	9
Sunac China Holdings Ltd. 1,00 % 30-09-2032	Chine	Sociétés – Non convertibles	73 736 USD	17	8
Suncor Énergie Inc. 5,40 % 17-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 420 000	2 448	2 509
Suncor Énergie Inc. 3,95 % 04-03-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 060 000	1 043	908
Supérieur Plus S.E.C. 4,50 % 15-03-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	160 000 USD	204	206
Tamarack Valley Energy Ltd. 7,25 % 10-05-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000	235	254
TELUS Corp. 4,80 % 15-12-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	450 000	450	468
TELUS Corp. 3,30 % 02-05-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	260 000	251	255
TELUS Corp. 3,15 % 19-02-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 650 000	2 512	2 555
TELUS Corp. 4,95 % 18-02-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	870 000	867	912
TELUS Corp. 4,65 % 13-08-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 170 000	1 169	1 203
TELUS Corp. 2,85 % 13-11-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 020 000	851	939
TELUS Corp. 4,95 % 28-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	830 000	829	866
Tencent Music Entertainment Group 2,00 % 03-09-2030, rachetables 2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	360 000 USD	472	423
Tenet Healthcare Corp. 4,38 % 15-01-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	180 000 USD	226	234
Teranet Holdings LP 3,72 % 23-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 460 000	2 460	2 394
TerraForm Power Operating LLC 4,75 % 15-01-2030, rachetables 2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	40 000 USD	53	52
T-Mobile USA Inc. 3,75 % 15-04-2027, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	4 255 000 USD	5 677	5 685
T-Mobile USA Inc. 4,95 % 15-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 116 000 USD	1 500	1 544
T-Mobile USA Inc. 4,85 % 15-01-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	320 000 USD	428	442
T-Mobile USA Inc. 2,55 % 15-02-2031, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	640 000 USD	869	771
T-Mobile USA Inc. 5,20 % 15-01-2033	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 390 000 USD	3 115	3 347
T-Mobile USA Inc. 5,15 % 15-04-2034	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	430 000 USD	574	599
Groupe TMX Ltée 2,30 % 11-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 490 000	1 541	1 486
Groupe TMX Ltée 3,78 % 05-06-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	470 000	476	474
Groupe TMX Ltée 4,68 % 16-08-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	680 000	680	711
Groupe TMX Ltée 2,02 % 12-02-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	600 000	600	541
Toronto Hydro Corp. 4,61 % 14-06-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 872 000	1 870	1 979
Toronto Hydro Corp. 4,95 % 13-10-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 457 000	1 505	1 563
La Banque Toronto-Dominion 2,67 % 09-09-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 805 000	1 759	1 787

FONDS ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

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 \$)
OBLIGATIONS (suite)					
La Banque Toronto-Dominion 4,34 % 27-01-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 404 000	5 324	5 450
La Banque Toronto-Dominion 2,26 % 07-01-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 008 000	1 008	982
La Banque Toronto-Dominion 4,21 % 01-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 298 000	5 203	5 392
La Banque Toronto-Dominion 5,38 % 21-10-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 878 000	3 907	4 085
La Banque Toronto-Dominion 4,48 % 18-01-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 240 000	2 227	2 307
La Banque Toronto-Dominion 5,49 % 08-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 720 000	2 720	2 910
La Banque Toronto-Dominion 4,68 % 08-01-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	918 000	918	957
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 22-04-2030, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	6 961 000	6 740	6 922
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 26-01-2032, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	877 000	856	863
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 09-04-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 550 000	1 550	1 622
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-10-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	840 000	849	880
Tourmaline Oil Corp. 2,53 % 12-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	590 000	590	563
Crédit Toyota Canada Inc. 4,44 % 27-06-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	980 000	980	1 013
Crédit Toyota Canada Inc. 3,73 % 02-10-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 280 000	1 280	1 284
TransCanada PipeLines Ltd. 3,80 % 05-04-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 348 000	3 410	3 368
TransCanada PipeLines Ltd. 5,28 % 15-07-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 760 000	2 759	2 941
TransCanada PipeLines Ltd. 4,33 % 16-09-2047, rachetables 2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	690 000	576	623
TransCanada PipeLines Ltd. 4,34 % 15-10-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 166 000	1 830	1 953
TransCanada PipeLines Ltd. 5,92 % 12-05-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	462 000	491	519
TransCanada PipeLines Ltd. 5,30 % 15-03-2077	Canada	Sociétés – Non convertibles	271 000 USD	322	360
TransCanada PipeLines Ltd. 4,20 % 04-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 586 000	4 195	4 226
TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	22 055 000	20 475	21 696
Transcontinental inc. 2,67 % 03-02-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	401 000	378	398
Transurban Finance Co. Pty. Ltd. 4,56 % 14-11-2028, rachetables 2028	Australie	Sociétés – Non convertibles	2 706 000	2 852	2 747
Trillium Windpower LP 5,80 % 15-02-2033	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	430 637	479	451
Trulieve Cannabis Corp. 8,00 % 06-10-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	205 000 USD	253	269
Uber Technologies Inc. 8,00 % 01-11-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	870 000 USD	1 129	1 180
Union Gas Ltd. 4,20 % 02-06-2044, rachetables 2043	Canada	Sociétés – Non convertibles	550 000	514	519
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,12 % 15-04-2025	États-Unis	Gouvernements étrangers	30 371 000 USD	49 446	49 143
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052	États-Unis	Gouvernements étrangers	9 376 000 USD	11 313	8 901
Obligations du Trésor des États-Unis 2,13 % 15-02-2054	États-Unis	Gouvernements étrangers	8 708 000 USD	12 491	12 536
Administration de l'aéroport de Vancouver 1,76 % 20-09-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 339 000	1 177	1 210
Ventas Canada Finance Ltd. 5,40 % 21-04-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 860 000	1 860	1 954
Ventas Canada Finance Ltd. 5,10 % 05-03-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 400 000	1 399	1 464
Ventas Realty LP 4,00 % 01-03-2028, rachetables 2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	700 000 USD	911	934
Veren Inc. 4,97 % 21-06-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 310 000	1 310	1 355
Verizon Communications Inc., taux variable 20-03-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	413 000 USD	517	561
Verizon Communications Inc. 2,38 % 22-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 146 000	2 067	2 062
Vermilion Energy Inc. 6,88 % 01-05-2030 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	232 000 USD	298	314
Vidéotron Itée 4,65 % 15-07-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 520 000	1 519	1 562
Vidéotron Itée 3,63 % 15-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 724 000	9 793	10 623
Vidéotron Itée 4,50 % 15-01-2030, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	6 160 000	5 950	6 246
Vidéotron Itée 3,13 % 15-01-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	7 135 000	6 698	6 704
VMED 02 UK Financing I PLC 4,25 % 31-01-2031	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	264	240
Crédit VW Canada Inc. 4,21 % 19-08-2027	Allemagne	Sociétés – Non convertibles	325 000	328	328
Crédit VW Canada Inc. 5,73 % 20-09-2028	Allemagne	Sociétés – Non convertibles	980 000	1 044	1 044
Crédit VW Canada Inc. 4,42 % 20-08-2029	Allemagne	Sociétés – Non convertibles	2 151 000	2 171	2 184
The Walt Disney Co. 3,06 % 30-03-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 593 000	1 687	1 580
Waste Management of Canada Corp. 2,60 % 23-09-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 533 000	1 530	1 507
Wells Fargo & Co. 2,57 % 01-05-2026, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 736 000	2 711	2 710
Wells Fargo & Co. 2,98 % 19-05-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 870 000	1 984	1 850
Welltower Inc. 2,95 % 15-01-2027, rachetables 2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	272 000	247	265
Welltower Inc. 4,25 % 15-04-2028, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	448 000 USD	596	606
Welltower Inc. 4,13 % 15-03-2029, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	910 000 USD	1 203	1 222

FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Groupe WSP Global Inc. 2,41 % 19-04-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	980 000	988	938
Groupe WSP Global Inc. 4,12 % 12-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	970 000	971	977
Zoetis Inc. 2,00 % 15-05-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 000 000 USD	2 197	2 390
Total des obligations				1 653 094	1 679 406
ACTIONS					
Accenture PLC, cat. A	États-Unis	Technologie de l'information	244 158	80 372	116 715
Alcon Inc., CAEE	Suisse	Soins de santé	708 173	88 200	95 837
Alphabet Inc., cat. A	États-Unis	Services de communication	177 539	37 966	39 820
Groupe Altus Ltée	Canada	Biens immobiliers	1 649 229	77 667	90 526
Aon PLC	Irlande	Services financiers	304 585	91 571	142 516
Apple Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	234 000	73 066	73 733
BCE Inc., priv., série AA	Canada	Services de communication	17 810	277	306
BCE Inc., priv., série AI	Canada	Services de communication	3 259	51	51
BCE Inc. 4,54 %, à div. cumulatif rachetable, priv. de premier rang, série R, rachetables	Canada	Services de communication	1 126	20	18
Becton, Dickinson and Co.	États-Unis	Soins de santé	228 690	75 890	74 565
Boyd Group Services Inc.	Canada	Produits industriels	577 090	122 383	118 280
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 46	Canada	Biens immobiliers	20 757	528	475
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 48	Canada	Biens immobiliers	5 888	149	137
Brookfield Asset Management Inc.	Canada	Services financiers	2 416 037	128 669	154 481
Brookfield Renewable Partners L.P., priv., série 13	Canada	Services publics	7 969	197	179
Cadence Design Systems Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	201 000	73 740	73 672
CAE Inc.	Canada	Produits industriels	3 994 195	124 323	101 413
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	Canada	Produits industriels	289 222	45 839	45 804
Canadien Pacifique Kansas City Ltée	Canada	Produits industriels	325 480	37 710	37 648
Dollarama inc.	Canada	Consommation discrétionnaire	546 926	40 893	75 771
Emera Inc., priv., série J	Canada	Services publics	1 036	26	22
Emera Inc., priv., série L	Canada	Services publics	9 885	247	193
Frontera Generation Holdings LLC	États-Unis	Énergie	1 670	4	1
Gartner Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	116 866	71 586	80 091
Intact Corporation financière	Canada	Services financiers	709 144	131 690	184 164
iQor US Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	1 525	26	7
Linde PLC (Bourse de New York)	Irlande	Matériaux	178 558	70 339	115 149
Les Compagnies Loblaw Ltée	Canada	Consommation de base	844 732	113 886	152 119
Les Compagnies Loblaw Ltée 5,30 %, à div. cumulatif rachetable, priv. de second rang, série B	Canada	Consommation de base	4 169	109	97
Mastercard Inc., cat. A	États-Unis	Services financiers	112 257	74 113	74 965
Microsoft Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	253 000	120 753	147 226
Pet Valu Holdings Ltd.	Canada	Consommation discrétionnaire	2 229 571	73 072	57 634
Premium Brands Holdings Corp.	Canada	Consommation de base	995 445	99 772	95 334
Roper Technologies Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	166 912	117 136	125 602
Banque Royale du Canada	Canada	Services financiers	1 207 462	130 361	203 819
S&P Global Inc.	États-Unis	Services financiers	163 995	85 861	114 576
Schneider Electric SE	France	Produits industriels	297 634	66 632	106 518
Source Energy Services Ltd.	Canada	Énergie	200	23	2
Stantec Inc.	Canada	Produits industriels	1 578 387	113 146	171 665
Stryker Corp.	États-Unis	Soins de santé	167 482	82 624	81 824
Thermo Fisher Scientific Inc.	États-Unis	Soins de santé	108 550	80 861	90 805
Thomson Reuters Corp.	Canada	Produits industriels	462 756	64 031	106 753
Groupe TMX Ltée	Canada	Services financiers	2 525 697	99 585	107 064
Toromont Industries Ltd.	Canada	Produits industriels	398 273	45 631	52 580
Trane Technologies PLC	États-Unis	Produits industriels	243 500	77 208	128 008
TransAlta Corp., perpétuelles, priv. série C	Canada	Services publics	3 260	61	65
TransAlta Corp., priv., série A	Canada	Services publics	27 398	364	411
Waste Connections Inc.	Canada	Produits industriels	508 457	94 599	122 919
Total des actions				2 913 257	3 561 560
OPTIONS					
Options achetées (se reporter au tableau des options achetées)				2 009	905
Total des options				2 009	905

FONDS ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
FONDS/BILLETS NÉGOCIÉS EN BOURSE					
¹ FINB Obligations canadiennes totales Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	27 651	2 527	2 628
¹ FINB Obligations à long terme du gouvernement canadien Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	143 530	14 384	15 389
¹ FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	530 000	10 648	9 540
Total des fonds/billets négociés en bourse				27 559	27 557
FONDS COMMUNS DE PLACEMENT					
² Fonds à rendement absolu de titres de créance Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	2 387 308	23 846	20 900
² Fonds de titres à revenu fixe de sociétés mondiales Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	1 886 901	18 873	19 401
² Fonds de titres à taux variable de qualité Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	1 878 202	18 782	18 816
² Fonds d'obligations de sociétés nord-américaines Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	2 627 758	27 698	25 237
Total des fonds communs de placement				89 199	84 354
FONDS PRIVÉS					
³ Northleaf Private Credit II LP	Canada	Services financiers	618	6 316	6 133
⁴ Sagard Credit Partners II LP	Canada	Services financiers	618	3 240	3 276
Total des fonds privés				9 556	9 409
Coûts de transaction				(1 506)	–
Total des placements				4 693 168	5 363 191
Instruments dérivés (se reporter au tableau des instruments dérivés)					10 123
Obligation pour options vendues (se reporter au tableau des options vendues)					(110)
Trésorerie et équivalents de trésorerie					130 613
Autres éléments d'actif moins le passif					6 106
Actif net attribuable aux porteurs de titres					5 509 923

¹ Ce fonds négocié en bourse est géré par Mackenzie.

² Ce fonds est géré par Mackenzie.

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

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

FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

APERÇU DU PORTEFEUILLE

30 SEPTEMBRE 2024

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Actions	64,6
Obligations	31,8
Obligations	30,5
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)	1,3
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)	–
Fonds communs de placement	1,5
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,1
Fonds/billets négociés en bourse	0,5
Autres éléments d'actif (de passif)	0,3
Fonds privés	0,2
Options sur swaps achetées	–
Options sur devises achetées	–
Options sur swaps vendues	–

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	63,5
États-Unis	25,8
Irlande	4,8
France	2,0
Suisse	1,7
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,1
Royaume-Uni	0,3
Autres éléments d'actif (de passif)	0,3
Australie	0,1
Brésil	0,1
Allemagne	0,1
Mexique	0,1
Autre	0,1

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Produits industriels	18,0
Services financiers	17,9
Obligations de sociétés	17,4
Technologie de l'information	11,2
Obligations provinciales	7,9
Soins de santé	6,2
Obligations fédérales	4,9
Consommation de base	4,5
Consommation discrétionnaire	2,4
Matériaux	2,1
Biens immobiliers	1,6
Fonds communs de placement	1,5
Obligations d'État étrangères	1,4
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,1
Autre	0,9
Services de communication	0,7
Autres éléments d'actif (de passif)	0,3

31 MARS 2024

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Actions	62,8
Obligations	28,4
Obligations	25,9
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)	2,5
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie	6,1
Fonds/billets négociés en bourse	1,1
Fonds communs de placement	0,8
Autres éléments d'actif (de passif)	0,6
Fonds privés	0,2
Options sur swaps achetées	–

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	59,9
États-Unis	24,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	6,1
Irlande	5,4
France	2,9
Autres éléments d'actif (de passif)	0,6
Mexique	0,5
Royaume-Uni	0,3
Brésil	0,1
Australie	0,1

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Produits industriels	19,2
Obligations de sociétés	15,1
Services financiers	14,8
Technologie de l'information	10,9
Obligations provinciales	7,0
Trésorerie et équivalents de trésorerie	6,1
Consommation de base	5,4
Obligations fédérales	4,4
Matériaux	3,5
Consommation discrétionnaire	3,3
Biens immobiliers	2,4
Soins de santé	2,3
Obligations d'État étrangères	1,6
Autre	1,4
Fonds/billets négociés en bourse	1,1
Services de communication	0,9
Autres éléments d'actif (de passif)	0,6

FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

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	230 857 000	Vente	18 décembre 2024	65,00	USD	306	193
Option de vente sur devises CAD/USD	11 906 500	Vente	22 juillet 2025	1,36	USD	348	381
Option d'achat sur devises CAD/USD	14 288 000	Achat	22 juillet 2025	1,36	USD	418	277
Indice Markit North American Investment Grade CDX	171 018 859	Vente	20 novembre 2024	72,50	USD	688	45
Indice Markit North American Investment Grade CDX	242 414 000	Vente	16 octobre 2024	62,50	USD	249	9
Total des options						2 009	905

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	(230 857 000)	Option de vente vendue	18 décembre 2024	80,00	USD	(154)	(89)
Indice Markit North American Investment Grade CDX	(171 018 859)	Option de vente vendue	20 novembre 2024	87,50	USD	(427)	(21)
Indice Markit North American Investment Grade CDX	(242 414 000)	Option de vente vendue	16 octobre 2024	80,00	USD	(105)	–
Total des options						(686)	(110)

FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

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	167	18 décembre 2024	124,89 CAD	20 877	20	–
Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 5 ans, décembre 2024	432	18 décembre 2024	114,55 CAD	49 870	386	–
Contrats à terme standardisés à très long terme sur obligations du Trésor américain, décembre 2024	(566)	19 décembre 2024	133,83 USD	(101 874)	904	–
Total des contrats à terme standardisés				(31 127)	1 310	–

* 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	15 720 CAD	(11 465) USD	11 octobre 2024	(15 720)	(15 502)	218	–
A	18 005 CAD	(13 359) USD	11 octobre 2024	(18 005)	(18 062)	–	(57)
A	13 753 CAD	(10 070) USD	11 octobre 2024	(13 753)	(13 615)	138	–
A	1 612 CAD	(1 180) USD	11 octobre 2024	(1 612)	(1 596)	16	–
A	26 981 CAD	(19 650) USD	18 octobre 2024	(26 981)	(26 564)	417	–
A	42 110 CAD	(30 655) USD	18 octobre 2024	(42 110)	(41 442)	668	–
A	339 USD	(466) CAD	18 octobre 2024	466	458	–	(8)
A	3 229 CAD	(2 350) USD	18 octobre 2024	(3 229)	(3 177)	52	–
A	7 555 CAD	(5 568) USD	18 octobre 2024	(7 555)	(7 528)	27	–
A	732 CAD	(488) EUR	25 octobre 2024	(732)	(735)	–	(3)
A	23 EUR	(35) CAD	25 octobre 2024	35	35	–	–
A	5 646 CAD	(4 142) USD	25 octobre 2024	(5 646)	(5 599)	47	–
A	206 804 CAD	(150 149) USD	8 novembre 2024	(206 804)	(202 887)	3 917	–
A	45 148 CAD	(32 765) USD	8 novembre 2024	(45 148)	(44 273)	875	–
A	8 177 CAD	(5 935) USD	8 novembre 2024	(8 177)	(8 020)	157	–
A	12 871 CAD	(9 341) USD	8 novembre 2024	(12 871)	(12 622)	249	–
A	9 552 CAD	(7 085) USD	15 novembre 2024	(9 552)	(9 572)	–	(20)
A	1 CAD	(1) EUR	15 novembre 2024	(1)	(1)	–	–
A	13 CAD	(9) EUR	15 novembre 2024	(13)	(13)	–	–
A	23 755 CAD	(17 623) USD	15 novembre 2024	(23 755)	(23 808)	–	(53)
A	4 062 CAD	(3 013) USD	15 novembre 2024	(4 062)	(4 071)	–	(9)
A	39 271 CAD	(28 672) USD	22 novembre 2024	(39 271)	(38 729)	542	–
A	90 070 CAD	(65 730) USD	22 novembre 2024	(90 070)	(88 786)	1 284	–
A	59 939 CAD	(44 151) USD	22 novembre 2024	(59 939)	(59 637)	302	–
A	12 748 CAD	(9 478) USD	22 novembre 2024	(12 748)	(12 803)	–	(55)
A	5 297 USD	(7 255) CAD	22 novembre 2024	7 255	7 155	–	(100)
A	34 791 CAD	(25 632) USD	22 novembre 2024	(34 791)	(34 623)	168	–
A	7 720 CAD	(5 685) USD	22 novembre 2024	(7 720)	(7 679)	41	–
Total des contrats de change à terme de gré à gré						9 118	(305)

Total des actifs dérivés

10 428

Total des passifs dérivés

(305)

FONDS ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

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 ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

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 ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

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 ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

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 ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

NOTES ANNEXES

6. Frais de gestion et frais d'exploitation

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

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

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

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

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

7. Capital du Fonds

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

8. Risques découlant des instruments financiers

i. Exposition au risque et gestion du risque

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

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

ii. Risque de liquidité

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

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

iii. Risque de change

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

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

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

FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

NOTES ANNEXES

8. Risques découlant des instruments financiers (suite)

iv. Risque de taux d'intérêt

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

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

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

v. Autre risque de prix

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

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

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

vi. Risque de crédit

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

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

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

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

vii. Fonds sous-jacents

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

FONDS ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

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 ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

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 : 20 novembre 1996

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

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

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

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

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

Les titres des séries F, F5 et F8 sont offerts aux investisseurs qui participent à un programme de services rémunérés à l'acte ou de comptes intégrés parrainé par le courtier, qui sont assujettis à des frais établis en fonction de l'actif plutôt qu'à des commissions pour chaque opération et qui investissent un minimum de 500 \$ (5 000 \$ pour les séries F5 et F8); ils sont également proposés aux employés de Mackenzie et de ses filiales, et aux administrateurs de Mackenzie. Les investisseurs des séries F5 et F8 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % ou de 8 % par année, respectivement.

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

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

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

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

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

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

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 G 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.

Les titres des séries Investisseur et Conseiller, ainsi que les titres de série-B ont été créés exclusivement afin de mettre en œuvre les fusions touchant le Fonds et ne sont pas offerts à la vente.

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

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

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

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

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

FONDS ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

NOTES ANNEXES

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

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

Série	Date d'établissement/ de rétablissement	Frais de gestion	Frais d'administration
Série A	28 novembre 1996	1,85 %	0,21 %
Série AR	18 janvier 2017	1,85 %	0,24 %
Série D	17 janvier 2014	0,85 %	0,16 %
Série F	6 décembre 1999	0,70 %	0,15 %
Série F5	16 octobre 2017	0,70 %	0,15 %
Série F8	16 octobre 2017	0,70 %	0,15 %
Série FB	26 octobre 2015	0,85 %	0,21 %
Série FB5	24 octobre 2018	0,85 %	0,21 %
Série G	12 avril 2005	1,35 %	0,21 %
Série I	25 octobre 1999	1,35 %	0,21 %
Série O	21 novembre 2001	— ¹⁾	s.o.
Série O5	12 janvier 2016	— ¹⁾	s.o.
Série PW	4 novembre 2013	1,70 %	0,15 %
Série PWFB	3 avril 2017	0,70 %	0,15 %
Série PWFB5	24 octobre 2018	0,70 %	0,15 %
Série PWR	1 ^{er} avril 2019	1,70 %	0,15 %
Série PWT5	3 avril 2017	1,70 %	0,15 %
Série PWT8	4 décembre 2014	1,70 %	0,15 %
Série PWX	16 janvier 2014	— ²⁾	— ²⁾
Série PWX8	16 octobre 2017	— ²⁾	— ²⁾
Série R	8 décembre 2008	s.o.	s.o.
Série S	6 juillet 2018	— ¹⁾	0,025 %
Série T5	24 août 2007	1,85 %	0,21 %
Série T8	8 mars 2002	1,85 %	0,21 %
Série Investisseur	6 juillet 2018	1,45 %	0,21 %
Série-B	6 juillet 2018	— ¹⁾	s.o.
Série Conseiller	6 juillet 2018	1,85 %	0,14 %
Série LB	6 juillet 2018	1,85 %	0,21 %
Série LF	7 décembre 2018	0,70 %	0,15 %
Série LF5	7 décembre 2018	0,70 %	0,15 %
Série LW	6 juillet 2018	1,70 %	0,15 %
Série LW5	6 juillet 2018	1,70 %	0,15 %
Série LX	6 juillet 2018	1,85 %	0,21 %

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

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

b) Reports prospectifs de pertes fiscales

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

FONDS ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

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	181 849		67 923	
Valeur des biens reçus en garantie	191 343		71 367	

	30 septembre 2024		30 septembre 2023	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
Revenus de prêts de titres bruts	57	100,0	123	100,0
Impôt retenu à la source	–	–	(1)	(0,8)
	57	100,0	122	99,2
Paiements à l'agent de prêt de titres	(10)	(17,5)	(23)	(18,7)
Revenu tiré du prêt de titres	47	82,5	99	80,5

d) Commissions

	(\$)
30 septembre 2024	142
30 septembre 2023	241

e) Risques découlant des instruments financiers

i. Exposition au risque et gestion du risque

Le Fonds vise une croissance du capital à long terme assortie d'un revenu, de même qu'une protection du capital raisonnable, en investissant principalement dans des actions et des titres à revenu fixe canadiens. Les actifs du Fonds seront généralement répartis dans une proportion de 60 % à 90 % dans des actions et dans une proportion de 10 % à 40 % dans des titres à revenu fixe et dans la trésorerie et les équivalents de trésorerie. Le Fonds peut consacrer jusqu'à 40 % de son actif aux placements étrangers.

ii. Risque de change

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

30 septembre 2024								
Devise	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Incidence sur l'actif net			
					Renforcement de 5 % (\$)	%	Affaiblissement de 5 % (\$)	%
USD	1 750 148	57 666	(675 400)	1 132 414				
EUR	107 235	16	(714)	106 537				
BRL	4 276	–	–	4 276				
Total	1 861 659	57 682	(676 114)	1 243 227				
% de l'actif net	33,8	1,0	(12,3)	22,5				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					(61 298)	(1,1)	63 153	1,1

31 mars 2024								
Devise	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Incidence sur l'actif net			
					Renforcement de 5 % (\$)	%	Affaiblissement de 5 % (\$)	%
USD	1 609 624	16 514	(596 536)	1 029 602				
EUR	165 430	1	(928)	164 503				
MXN	24 994	–	–	24 994				
BRL	4 843	–	–	4 843				
Total	1 804 891	16 515	(597 464)	1 223 942				
% de l'actif net	32,3	0,3	(10,7)	21,9				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					(61 197)	(1,1)	61 197	1,1

* Comprend les instruments financiers monétaires et non monétaires.

FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

NOTES ANNEXES

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

e) Risques découlant des instruments financiers (suite)

iii. Risque de taux d'intérêt

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

	Obligations (\$)	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
			Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
30 septembre 2024			(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	81 051	(31 127)				
1 an à 5 ans	462 591	–				
5 ans à 10 ans	534 608	–				
Plus de 10 ans	601 156	–				
Total	1 679 406	(31 127)				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt			(121 702)	(2,2)	121 702	2,2

	Obligations (\$)	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
			Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
31 mars 2024			(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	38 696	65 400				
1 an à 5 ans	439 047	–				
5 ans à 10 ans	451 025	–				
Plus de 10 ans	517 980	–				
Total	1 446 748	65 400				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt			(121 329)	(2,2)	121 329	2,2

iv. Autre risque de prix

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

Incidence sur l'actif net	Augmentation de 10 %		Diminution de 10 %	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
30 septembre 2024	368 305	6,7	(368 304)	(6,7)
31 mars 2024	362 620	6,5	(362 467)	(6,5)

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 3,6 % de l'actif net du Fonds (3,2 % 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	4,0	2,1
AA	5,3	4,7
A	8,2	8,1
BBB	8,6	7,1
Inférieure à BBB	1,4	1,6
Sans note	3,0	2,3
Total	30,5	25,9

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

FONDS ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

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	–	1 679 262	144	1 679 406	–	1 446 604	144	1 446 748
Actions	3 455 034	106 518	8	3 561 560	3 509 670	–	8	3 509 678
Options	–	905	–	905	–	112	–	112
Fonds/billets négociés en bourse	27 557	–	–	27 557	63 441	–	–	63 441
Fonds communs de placement	84 354	–	–	84 354	43 643	–	–	43 643
Fonds privés	–	–	9 409	9 409	–	–	9 819	9 819
Actifs dérivés	1 310	9 118	–	10 428	208	267	–	475
Passifs dérivés	–	(415)	–	(415)	–	(3 640)	–	(3 640)
Placements à court terme	–	75 931	–	75 931	–	468 568	–	468 568
Total	3 568 255	1 871 319	9 561	5 449 135	3 616 962	1 911 911	9 971	5 538 844

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

Au cours de la période close le 30 septembre 2024, les actions autres que nord-américaines étaient fréquemment transférées entre le niveau 1 (prix non rajustés cotés) et le niveau 2 (prix rajustés). Au 30 septembre 2024, ces titres étaient classés dans le niveau 2 (niveau 1 au 31 mars 2024).

Au cours de la période close le 30 septembre 2024, des placements d'une juste valeur de néant (147 \$ au 31 mars 2024) ont été transférés du niveau 2 au niveau 3 en raison de changements en matière de données utilisées pour l'évaluation.

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

	30 septembre 2024				31 mars 2024			
	Fonds privés (\$)	Obligations (\$)	Actions (\$)	Total (\$)	Fonds privés (\$)	Obligations (\$)	Actions (\$)	Total (\$)
Solde, à l'ouverture	9 819	144	8	9 971	9 729	–	19	9 748
Achats	170	–	–	170	261	–	–	261
Ventes	(270)	–	–	(270)	–	–	–	–
Transferts entrants	–	–	–	–	–	147	–	147
Transferts sortants	–	–	–	–	–	–	–	–
Profits (pertes) au cours de la période :								
Réalisé(e)s	26	–	–	26	–	–	–	–
Latent(e)s	(336)	–	–	(336)	(171)	(3)	(11)	(185)
Solde, à la clôture	9 409	144	8	9 561	9 819	144	8	9 971
Variation des profits (pertes) latent(e)s au cours de la période attribuables aux titres détenus à la clôture de la période	(336)	–	–	(336)	(171)	(3)	(11)	(185)

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

g) Placements détenus par le gestionnaire et des sociétés affiliées

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

	30 septembre 2024	31 mars 2024
	(\$)	(\$)
Gestionnaire	498	471
Autres fonds gérés par le gestionnaire	7 255	7 804
Fonds gérés par des sociétés affiliées au gestionnaire	17 580	18 589

FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

NOTES ANNEXES

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

h) Compensation d'actifs financiers et de passifs financiers

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

	30 septembre 2024			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	9 374	(239)	–	9 135
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(239)	239	5 167	5 167
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	9 135	–	5 167	14 302

	31 mars 2024			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	385	(177)	–	208
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(3 137)	177	7 341	4 381
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	(2 752)	–	7 341	4 589

i) Intérêts dans des entités structurées non consolidées

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

30 septembre 2024	% de l'actif net du Fonds sous-jacent	Juste valeur des placements du Fonds (\$)
FINB Obligations canadiennes totales Mackenzie	0,3	2 628
FINB Obligations à long terme du gouvernement canadien Mackenzie	22,4	15 389
Fonds à rendement absolu de titres de créance Mackenzie, série R	20,8	20 900
Fonds de titres à revenu fixe de sociétés mondiales Mackenzie, série R	12,2	19 401
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	4,9	9 540
Fonds de titres à taux variable de qualité Mackenzie, série R	7,2	18 816
Fonds d'obligations de sociétés nord-américaines Mackenzie, série R	2,3	25 237
Northleaf Private Credit II LP	0,7	6 133
Sagard Credit Partners II LP	0,6	3 276

31 mars 2024	% de l'actif net du Fonds sous-jacent	Juste valeur des placements du Fonds (\$)
FINB Obligations canadiennes totales Mackenzie	4,5	39 406
FINB Obligations à long terme du gouvernement canadien Mackenzie	22,4	14 739
Fonds à rendement absolu de titres de créance Mackenzie, série R	20,6	19 821
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	5,0	9 296
Fonds d'obligations de sociétés nord-américaines Mackenzie, série R	2,2	23 822
Northleaf Private Credit II LP	0,7	6 516
Sagard Credit Partners II LP	0,5	3 303

FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

NOTES ANNEXES

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

j) Engagement

	30 septembre 2024		31 mars 2024	
	Montant appelé (\$ US)	Engagement d'investissement total (\$ US)	Montant appelé (\$ US)	Engagement d'investissement total (\$ US)
Northleaf Private Credit II LP ¹⁾	4 994	6 181	4 994	6 181
Sagard Credit Partners II LP ²⁾	2 081	6 181	2 189	6 181

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

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