

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

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



FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

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

	30 sept. 2024	31 mars 2024 (Audité)
	\$	\$
ACTIF		
Actifs courants		
Placements à la juste valeur	19 310	41 115
Trésorerie et équivalents de trésorerie	584 015	567 560
Intérêts courus à recevoir	202	1
Sommes à recevoir pour placements vendus	–	–
Sommes à recevoir pour titres émis	–	177
Marge sur instruments dérivés	78 487	49 969
Actifs dérivés	58 315	38 285
Total de l'actif	740 329	697 107
PASSIF		
Passifs courants		
Sommes à payer pour placements achetés	1	1
Sommes à payer pour titres rachetés	13	205
Sommes à payer au gestionnaire	5	5
Passifs dérivés	59 134	33 970
Total du passif	59 153	34 181
Actif net attribuable aux porteurs de titres	681 176	662 926

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

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

	2024 \$	2023 \$
Revenus		
Dividendes	258	333
Revenus d'intérêts aux fins de distribution	15 902	11 467
Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets		
Profit (perte) net(te) réalisé(e)	1 438	32 361
Profit (perte) net(te) latent(e)	(5 555)	4 080
Revenu tiré du prêt de titres	27	14
Total des revenus (pertes)	12 070	48 255
Charges (note 6)		
Frais de gestion	268	107
Frais d'administration	33	16
Intérêts débiteurs	360	71
Commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille	516	130
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Charges avant les montants absorbés par le gestionnaire	1 178	325
Charges absorbées par le gestionnaire	–	–
Charges nettes	1 178	325
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, avant impôt	10 892	47 930
Charge (économie) d'impôt étranger retenu à la source	39	59
Charge d'impôt étranger sur le résultat (recouvrée)	–	–
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation	10 853	47 871

Actif net attribuable aux porteurs de titres (note 3)

	par titre		par série	
	30 sept. 2024	31 mars 2024 (Audité)	30 sept. 2024	31 mars 2024 (Audité)
Série A	10,22	10,25	1 752	1 925
Série F	10,41	10,45	30 114	31 307
Série FB	10,39	10,42	13	12
Série IG	9,87	9,90	457 508	426 146
Série O	10,48	10,52	2 195	2 484
Série PW	10,28	10,32	8 793	5 811
Série PWFB	10,42	10,45	42	30
Série PWX	10,48	10,51	203	392
Série R	10,48	10,51	180 556	194 819
			681 176	662 926

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

	par titre		par série	
	2024	2023	2024	2023
Série A	0,07	0,78	12	50
Série F	0,15	0,86	420	1 498
Série FB	(0,01)	0,69	(1)	–
Série IG	0,19	0,90	8 502	30 140
Série O	0,25	0,93	53	51
Série PW	0,06	0,78	41	35
Série PWFB	0,13	0,91	1	–
Série PWX	0,24	0,96	6	46
Série R	0,10	0,94	1 819	16 051
			10 853	47 871

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE LA SITUATION FINANCIÈRE

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

	Total		Série A		Série F		Série FB		Série IG	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	662 926	488 881	1 925	445	31 307	18 665	12	1	426 146	290 331
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	10 853	47 871	12	50	420	1 498	(1)	–	8 502	30 140
Distributions versées aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(14 943)	(11 161)	(18)	(5)	(493)	(251)	–	–	(10 106)	(7 232)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Total des distributions versées aux porteurs de titres	(14 943)	(11 161)	(18)	(5)	(493)	(251)	–	–	(10 106)	(7 232)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	126 177	92 242	492	519	4 283	976	12	3	28 232	79 608
Réinvestissement des distributions	14 933	7 515	18	5	483	249	–	–	10 106	7 232
Paiements au rachat de titres	(118 770)	(60 056)	(677)	(327)	(5 886)	(3 561)	(10)	–	(5 372)	(34 731)
Total des opérations sur les titres	22 340	39 701	(167)	197	(1 120)	(2 336)	2	3	32 966	52 109
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	18 250	76 411	(173)	242	(1 193)	(1 089)	1	3	31 362	75 017
À la clôture	681 176	565 292	1 752	687	30 114	17 576	13	4	457 508	365 348
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :										
Titres en circulation, à l'ouverture			Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres
Émis			188	45	2 996	1 855	1	–	43 059	30 508
Réinvestissement des distributions			47	52	408	95	1	–	2 835	8 148
Rachetés			2	–	46	24	–	–	1 016	726
Titres en circulation, à la clôture			(66)	(32)	(559)	(344)	(1)	–	(536)	(3 566)
			171	65	2 891	1 630	1	–	46 374	35 816

	Série O		Série PW		Série PWFB		Série PWX		Série R	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	2 484	746	5 811	545	30	8	392	561	194 819	177 579
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	53	51	41	35	1	–	6	46	1 819	16 051
Distributions versées aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(51)	(15)	(90)	(4)	(1)	–	(5)	(10)	(4 179)	(3 644)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Total des distributions versées aux porteurs de titres	(51)	(15)	(90)	(4)	(1)	–	(5)	(10)	(4 179)	(3 644)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	716	601	3 452	242	21	3	13	58	88 956	10 232
Réinvestissement des distributions	51	15	90	4	1	–	5	10	4 179	–
Paiements au rachat de titres	(1 058)	(358)	(511)	(361)	(10)	(3)	(208)	(163)	(105 038)	(20 552)
Total des opérations sur les titres	(291)	258	3 031	(115)	12	–	(190)	(95)	(11 903)	(10 320)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	(289)	294	2 982	(84)	12	–	(189)	(59)	(14 263)	2 087
À la clôture	2 195	1 040	8 793	461	42	8	203	502	180 556	179 666
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :										
Titres en circulation, à l'ouverture			Titres	Titres						
Émis			236	74	563	55	3	1	37	55
Réinvestissement des distributions			67	56	332	23	2	–	2	6
Rachetés			5	1	9	–	–	–	–	1
Titres en circulation, à la clôture			(99)	(35)	(49)	(35)	(1)	–	(20)	(16)
			209	96	855	43	4	1	19	46

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

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

	2024	2023
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation	10 853	47 871
Ajustements pour :		
Perte (profit) net(te) réalisé(e) sur les placements	1 112	11 183
Variation de la perte (du profit) net(te) latent(e) sur les placements	5 555	(4 080)
Achat de placements	(25 945)	(45 427)
Produit de la vente et de l'échéance de placements	46 143	13 644
(Augmentation) diminution des sommes à recevoir et autres actifs	(28 719)	9 873
Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités d'exploitation	8 999	33 064
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de titres	126 055	92 079
Paiements au rachat de titres	(118 663)	(59 809)
Distributions versées, déduction faite des réinvestissements	(10)	(3 646)
Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités de financement	7 382	28 624
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie	16 381	61 688
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à l'ouverture	567 560	397 608
Incidence des fluctuations des taux de change sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie	74	2
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture	584 015	459 298
Trésorerie	2 264	3 114
Équivalents de trésorerie	581 751	456 184
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture	584 015	459 298
Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :		
Dividendes reçus	258	333
Impôts étrangers payés	39	59
Intérêts reçus	15 701	11 449
Intérêts versés	360	71

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

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 \$)
OPTIONS					
Options achetées (se reporter au tableau des options achetées)				12 316	10 382
Total des options				12 316	10 382
FONDS/BILLETS NÉGOCIÉS EN BOURSE					
iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	16 000	2 368	2 445
iShares TIPS Bond ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	24 100	3 525	3 600
SPDR Bloomberg High Yield Bond ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	21 800	2 769	2 883
Total des fonds/billets négociés en bourse				8 662	8 928
Coûts de transaction				(54)	–
Total des placements				20 924	19 310
Instruments dérivés (se reporter au tableau des instruments dérivés)					(819)
¹ Trésorerie et équivalents de trésorerie					584 015
Autres éléments d'actif moins le passif					78 670
Actif net attribuable aux porteurs de titres					681 176

¹ Comprend 567 098 \$ détenus dans le Fonds du marché monétaire canadien Mackenzie, série R, un fonds géré par Mackenzie.

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

APERÇU DU PORTEFEUILLE

30 SEPTEMBRE 2024

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Autres éléments d'actif (de passif)	5,2	72,6	77,8
Obligations	30,5	(13,4)	17,1
<i>Contrats à terme standardisés</i>	29,2	(13,4)	15,8
<i>Obligations</i>	1,3	–	1,3
Actions	60,5	(53,9)	6,6
<i>Contrats à terme standardisés</i>	59,0	(53,9)	5,1
<i>Actions</i>	–	–	–
<i>Options achetées</i>	1,5	–	1,5
Contrats à terme standardisés sur marchandises	5,2	(6,7)	(1,5)
Swaps	–	–	–

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Autres éléments d'actif (de passif)	5,2	72,6	77,8
États-Unis	51,4	(18,3)	33,1
Allemagne	8,8	–	8,8
Mexique	6,5	–	6,5
Taiwan	5,7	–	5,7
Espagne	4,4	–	4,4
Italie	3,5	–	3,5
Japon	3,2	–	3,2
Pologne	2,4	–	2,4
Afrique du Sud	2,1	–	2,1
Suède	1,7	–	1,7
Suisse	–	(1,9)	(1,9)
Chine	–	(2,9)	(2,9)
Singapour	–	(3,6)	(3,6)
Autre	6,5	(10,6)	(4,1)
Thaïlande	–	(4,7)	(4,7)
Australie	–	(14,2)	(14,2)
Canada	–	(17,8)	(17,8)

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Autres éléments d'actif (de passif)	5,2	72,6	77,8
Obligations d'État étrangères	29,1	(4,9)	24,2
Contrats à terme standardisés sur actions	59,0	(53,9)	5,1
Autre	1,6	–	1,6
Obligations de sociétés	0,8	–	0,8
Marchandises	5,2	(6,7)	(1,5)
Obligations fédérales	0,5	(8,5)	(8,0)

31 MARS 2024

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

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

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

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

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS 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 S&P 500	245	Vente	20 juin 2025	5 150,00 USD	5 187	4 016
Indice S&P 500	33	Vente	20 juin 2025	5 325,00 USD	683	665
Indice S&P 500	127	Vente	19 septembre 2025	5 125,00 USD	3 178	2 662
Indice S&P 500	134	Vente	19 septembre 2025	5 200,00 USD	3 268	3 039
Total des options					12 316	10 382

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS

Au 30 septembre 2024

Tableau des contrats de swap

Note de crédit de la contrepartie	Nombre de contrats	Échéance	Rendement payé par le Fonds, en fonction de	Rendement reçu par le Fonds, en fonction de	Montant notionnel* (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	287 800	22 novembre 2024	Indice sur mesure RBC Commodity majoré de 0,68 %	Swap sur actions réglé au comptant	69 981	–	(86)
Total des contrats de swap					69 981	–	(86)

Tableau des contrats à terme standardisés

Type de contrat	Nombre de contrats	Date d'échéance	Prix moyen des contrats (\$)	Montant notionnel* (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
Contrats à terme standardisés sur le gazole à faible teneur en soufre, octobre 2024	(14)	10 octobre 2024	655,98 USD	(1 258)	–	(20)
Contrats à terme standardisés sur l'indice CAC 40 (10 euros), octobre 2024	(75)	18 octobre 2024	7 479,55 EUR	(8 639)	–	(192)
Contrats à terme standardisés sur l'indice IBEX 35, octobre 2024	163	18 octobre 2024	11 701,00 EUR	29 187	467	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice OMXS30, octobre 2024	312	18 octobre 2024	2 546,05 SEK	10 911	331	–
Contrats à terme standardisés sur le pétrole brut WTI, novembre 2024	16	22 octobre 2024	68,83 USD	1 475	13	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice MSCI Singapore, octobre 2024	(673)	29 octobre 2024	345,50 SGD	(24 318)	149	–
Contrats à terme standardisés sur le gaz naturel, novembre 2024	(60)	29 octobre 2024	2,59 USD	(2 372)	–	(271)
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE China A50, octobre 2024	(935)	30 octobre 2024	12 231,26 USD	(17 576)	–	(2 102)
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE Taiwan, octobre 2024	388	30 octobre 2024	1 890,75 USD	39 165	–	(519)
Contrats à terme standardisés sur le pétrole brut Brent, décembre 2024	20	31 octobre 2024	72,16 USD	1 939	–	(12)
Contrats à terme standardisés sur le carburant diesel à très faible teneur en soufre au port de New York, novembre 2024	5	31 octobre 2024	216,18 USD	612	–	(2)
Contrats à terme standardisés sur l'essence RBOB, novembre 2024	(9)	31 octobre 2024	194,19 USD	(989)	3	–
Contrats à terme standardisés sur le soja, novembre 2024	24	14 novembre 2024	1 002,26 USD	1 715	20	–
Contrats à terme standardisés sur le pétrole brut WTI, décembre 2024	5	20 novembre 2024	77,13 USD	458	–	(63)
Contrats à terme standardisés sur le coton n° 2, décembre 2024	(32)	6 décembre 2024	70,21 USD	(1 593)	–	(68)
Contrats à terme standardisés sur euro-obligations, décembre 2024	290	6 décembre 2024	134,41 EUR	58 917	378	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice Tokyo TOPIX, décembre 2024	84	12 décembre 2024	2 559,99 JPY	20 922	692	–
Contrats à terme standardisés sur le maïs, décembre 2024	(159)	13 décembre 2024	404,96 USD	(4 567)	–	(275)
Contrats à terme standardisés sur le blé RVH de KC, décembre 2024	(257)	13 décembre 2024	576,34 USD	(10 144)	–	(109)
Contrats à terme standardisés sur la farine de soja, décembre 2024	155	13 décembre 2024	322,20 USD	7 160	407	–
Contrats à terme standardisés sur l'huile de soja, décembre 2024	20	13 décembre 2024	42,19 USD	703	8	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor américain à 10 ans, décembre 2024	(308)	16 décembre 2024	117,36 AUD	(33 522)	288	–
Contrats à terme standardisés sur l'aluminium LME, décembre 2024	(112)	16 décembre 2024	2 448,03 USD	(9 895)	–	(634)
Contrats à terme standardisés sur le cuivre LME, décembre 2024	(14)	16 décembre 2024	9 387,19 USD	(4 648)	–	(426)
Contrats à terme standardisés sur le plomb LME, décembre 2024	149	16 décembre 2024	2 005,63 USD	10 538	353	–
Contrats à terme standardisés sur le zinc LME, décembre 2024	(73)	16 décembre 2024	2 884,34 USD	(7 633)	–	(679)
Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 10 ans, décembre 2024	(461)	18 décembre 2024	124,94 CAD	(57 630)	–	(324)
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor américain à 10 ans, décembre 2024	628	19 décembre 2024	114,73 USD	97 057	–	(240)
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE/JSE Top 40, décembre 2024	215	19 décembre 2024	75 747,34 ZAR	13 405	713	–

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

Au 30 septembre 2024

Tableau des contrats à terme standardisés (suite)

Type de contrat	Nombre de contrats	Date d'échéance	Prix moyen des contrats (\$)	Montant notionnel* (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
Contrats à terme standardisés sur l'indice S&P/TSX 60, décembre 2024	(215)	19 décembre 2024	1 433,43 CAD	(62 109)	–	(889)
Contrats à terme standardisés sur l'indice SPI 200, décembre 2024	(322)	19 décembre 2024	8 203,40 AUD	(62 521)	–	(921)
Contrats à terme standardisés E-mini sur l'indice Standard & Poor's 500 de CME, décembre 2024	217	20 décembre 2024	5 720,24 USD	85 313	1 615	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice DAX, décembre 2024	1	20 décembre 2024	19 100,00 EUR	734	15	–
Contrats à terme standardisés E-mini sur l'indice Communication Services Select Sector, décembre 2024	205	20 décembre 2024	464,78 USD	33 095	959	–
Contrats à terme standardisés E-mini sur l'indice Consumer Discretionary Select Sector, décembre 2024	17	20 décembre 2024	2 005,78 USD	4 706	127	–
Contrats à terme standardisés E-mini sur l'indice Consumer Staples Select Sector, décembre 2024	(237)	20 décembre 2024	848,95 USD	(27 137)	72	–
Contrats à terme standardisés E-mini sur l'indice Energy Select Sector, décembre 2024	61	20 décembre 2024	931,41 USD	7 657	44	–
Contrats à terme standardisés E-mini sur l'indice Financials Select Sector, décembre 2024	41	20 décembre 2024	563,20 USD	7 820	13	–
Contrats à terme standardisés E-mini sur l'indice Health Care Select Sector, décembre 2024	(105)	20 décembre 2024	1 582,92 USD	(22 308)	191	–
Contrats à terme standardisés E-mini sur l'indice Industrials Select Sector, décembre 2024	(52)	20 décembre 2024	1 348,00 USD	(9 687)	–	(204)
Contrats à terme standardisés E-mini sur l'indice Information Technology Select Sector, décembre 2024	50	20 décembre 2024	2 249,10 USD	15 549	438	–
Contrats à terme standardisés E-mini sur l'indice NASDAQ 100, décembre 2024	6	20 décembre 2024	19 710,17 USD	3 288	92	–
Contrats à terme standardisés E-mini sur l'indice Real Estate Select Sector, décembre 2024	320	20 décembre 2024	222,16 USD	23 899	–	(65)
Contrats à terme standardisés E-mini sur l'indice Russell 2000, décembre 2024	101	20 décembre 2024	2 236,90 USD	15 361	122	–
Contrats à terme standardisés E-mini sur l'indice S&P Materials Select Sector, décembre 2024	(408)	20 décembre 2024	1 012,61 USD	(56 975)	–	(1 690)
Contrats à terme standardisés E-mini sur l'indice Utilities Select Sector, décembre 2024	(55)	20 décembre 2024	801,50 USD	(6 123)	–	(161)
Contrats à terme standardisés sur l'indice Euro STOXX 50, décembre 2024	3	20 décembre 2024	4 877,50 EUR	228	7	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE 100, décembre 2024	(110)	20 décembre 2024	8 343,83 GBP	(16 535)	21	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE/MIB 100, décembre 2024	91	20 décembre 2024	33 645,00 EUR	23 331	280	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice Bolsa Mexicana, décembre 2024	1 221	20 décembre 2024	53 318,76 MXN	44 642	–	(87)
Contrats à terme standardisés sur l'indice POLAND WIG 20, décembre 2024	969	20 décembre 2024	2 359,12 PLN	16 060	6	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice Swiss Market, décembre 2024	(65)	20 décembre 2024	12 088,61 CHF	(12 674)	–	(124)
Contrats à terme standardisés sur l'or, 100 oz, décembre 2024	4	27 décembre 2024	2 432,95 USD	1 439	128	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du Royaume-Uni, décembre 2024	41	27 décembre 2024	98,61 GBP	7 300	–	(13)
Contrats à terme standardisés sur l'indice SET50, décembre 2024	(4 263)	27 décembre 2024	926,69 THB	(32 554)	427	–
Contrats à terme standardisés sur l'argent, décembre 2024	2	27 décembre 2024	31,72 USD	425	–	(3)
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor américain à 2 ans, décembre 2024	125	31 décembre 2024	104,33 USD	35 202	–	(71)
Contrats à terme standardisés sur le sucre n° 11 (monde), mars 2025	210	28 février 2025	21,35 USD	7 147	706	–
Total des contrats à terme standardisés				133 953	9 085	(10 164)

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

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

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	6 730 USD	(9 887) AUD	25 octobre 2024	(9 101)	(9 246)	–	(145)
A	21 984 AUD	(14 964) USD	25 octobre 2024	20 237	20 559	322	–
A	1 550 AUD	(1 045) USD	25 octobre 2024	1 413	1 450	37	–
A	1 072 AUD	(711) USD	25 octobre 2024	961	1 003	42	–
A	1 874 AUD	(1 227) USD	25 octobre 2024	1 660	1 752	92	–
A	198 AUD	(131) USD	25 octobre 2024	177	185	8	–
A	143 USD	(211) AUD	25 octobre 2024	(193)	(198)	–	(5)
A	6 USD	(9) AUD	25 octobre 2024	(8)	(8)	–	–
A	308 AUD	(207) USD	25 octobre 2024	280	288	8	–
A	85 USD	(128) AUD	25 octobre 2024	(115)	(120)	–	(5)
A	794 USD	(1 174) AUD	25 octobre 2024	(1 074)	(1 097)	–	(23)
A	384 USD	(559) AUD	25 octobre 2024	(519)	(522)	–	(3)
A	54 742 BRL	(9 917) USD	25 octobre 2024	13 411	13 544	133	–
A	776 USD	(4 283) BRL	25 octobre 2024	(1 050)	(1 059)	–	(9)
A	24 USD	(132) BRL	25 octobre 2024	(33)	(33)	–	–
A	1 016 BRL	(180) USD	25 octobre 2024	244	251	7	–
A	135 USD	(770) BRL	25 octobre 2024	(183)	(191)	–	(8)
A	1 279 USD	(7 080) BRL	25 octobre 2024	(1 730)	(1 751)	–	(21)
A	709 USD	(3 904) BRL	25 octobre 2024	(959)	(966)	–	(7)
A	1 421 BRL	(257) USD	25 octobre 2024	347	351	4	–
A	97 USD	(547) BRL	25 octobre 2024	(131)	(135)	–	(4)
A	353 USD	(2 002) BRL	25 octobre 2024	(478)	(495)	–	(17)
A	871 USD	(4 814) BRL	25 octobre 2024	(1 178)	(1 191)	–	(13)
A	349 USD	(1 916) BRL	25 octobre 2024	(472)	(474)	–	(2)
A	19 646 USD	(26 696) CAD	25 octobre 2024	19 750	19 610	–	(140)
A	2 371 USD	(3 223) CAD	25 octobre 2024	2 384	2 367	–	(17)
A	2 121 USD	(2 899) CAD	25 octobre 2024	2 145	2 114	–	(31)
A	470 USD	(647) CAD	25 octobre 2024	478	468	–	(10)
A	1 015 CAD	(735) USD	25 octobre 2024	(1 016)	(994)	22	–
A	2 068 CAD	(1 510) USD	25 octobre 2024	(2 069)	(2 042)	27	–
A	249 CAD	(183) USD	25 octobre 2024	(249)	(247)	2	–
A	1 366 CAD	(1 017) USD	25 octobre 2024	(1 367)	(1 376)	–	(9)
A	1 439 CAD	(1 066) USD	25 octobre 2024	(1 439)	(1 441)	–	(2)
A	1 690 CAD	(1 244) USD	25 octobre 2024	(1 691)	(1 682)	9	–
A	534 USD	(725) CAD	25 octobre 2024	536	533	–	(3)
A	416 USD	(560) CAD	25 octobre 2024	414	416	2	–
A	1 069 USD	(974 591) CLP	25 octobre 2024	(1 445)	(1 466)	–	(21)
A	3 134 443 CLP	(3 438) USD	25 octobre 2024	4 650	4 715	65	–
A	610 USD	(562 074) CLP	25 octobre 2024	(825)	(846)	–	(21)
A	263 314 CLP	(278) USD	25 octobre 2024	376	396	20	–
A	91 USD	(87 369) CLP	25 octobre 2024	(123)	(131)	–	(8)
A	205 USD	(191 681) CLP	25 octobre 2024	(277)	(288)	–	(11)
A	86 617 CLP	(94) USD	25 octobre 2024	127	130	3	–
A	55 614 CLP	(61) USD	25 octobre 2024	83	84	1	–
A	66 387 CLP	(70) USD	25 octobre 2024	95	100	5	–
A	352 239 CLP	(370) USD	25 octobre 2024	501	530	29	–
A	74 004 CLP	(80) USD	25 octobre 2024	108	112	4	–
A	275 360 CLP	(302) USD	25 octobre 2024	409	414	5	–
A	32 396 CNY	(4 488) USD	25 octobre 2024	6 070	6 271	201	–
A	14 389 USD	(103 862) CNY	25 octobre 2024	(19 459)	(20 104)	–	(645)
A	769 USD	(5 570) CNY	25 octobre 2024	(1 040)	(1 079)	–	(39)

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

Au 30 septembre 2024

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	109 USD	(791) CNY	25 octobre 2024	(148)	(153)	–	(5)
A	1 483 CNY	(206) USD	25 octobre 2024	278	287	9	–
A	6 563 CNY	(924) USD	25 octobre 2024	1 249	1 271	22	–
A	2 412 CNY	(341) USD	25 octobre 2024	461	467	6	–
A	1 399 CNY	(197) USD	25 octobre 2024	267	271	4	–
A	207 CNY	(30) USD	25 octobre 2024	40	40	–	–
A	703 CNY	(99) USD	25 octobre 2024	134	136	2	–
A	80 USD	(568) CNY	25 octobre 2024	(108)	(110)	–	(2)
A	371 CNY	(53) USD	25 octobre 2024	72	72	–	–
A	18 268 182 COP	(4 553) USD	25 octobre 2024	6 157	5 846	–	(311)
A	24 641 671 COP	(6 143) USD	25 octobre 2024	8 307	7 886	–	(421)
A	99 172 COP	(24) USD	25 octobre 2024	33	32	–	(1)
A	79 651 COP	(19) USD	25 octobre 2024	26	25	–	(1)
A	578 USD	(2 391 996) COP	25 octobre 2024	(782)	(766)	16	–
A	713 USD	(2 914 618) COP	25 octobre 2024	(964)	(933)	31	–
A	158 USD	(641 689) COP	25 octobre 2024	(214)	(205)	9	–
A	277 USD	(1 132 415) COP	25 octobre 2024	(375)	(362)	13	–
A	394 USD	(1 660 231) COP	25 octobre 2024	(533)	(531)	2	–
A	471 USD	(2 036 058) COP	25 octobre 2024	(637)	(651)	–	(14)
A	170 USD	(724 981) COP	25 octobre 2024	(230)	(232)	–	(2)
A	91 USD	(378 805) COP	25 octobre 2024	(123)	(121)	2	–
A	5 777 USD	(133 752) CZK	25 octobre 2024	(7 812)	(7 991)	–	(179)
A	124 841 CZK	(5 391) USD	25 octobre 2024	7 291	7 458	167	–
A	12 598 CZK	(543) USD	25 octobre 2024	734	753	19	–
A	9 124 CZK	(390) USD	25 octobre 2024	528	545	17	–
A	21 638 CZK	(922) USD	25 octobre 2024	1 247	1 293	46	–
A	4 342 CZK	(189) USD	25 octobre 2024	256	260	4	–
A	8 006 CZK	(354) USD	25 octobre 2024	479	478	–	(1)
A	603 USD	(13 505) CZK	25 octobre 2024	(816)	(807)	9	–
A	3 503 CZK	(155) USD	25 octobre 2024	210	209	–	(1)
A	11 777 CZK	(518) USD	25 octobre 2024	700	703	3	–
A	4 224 CZK	(187) USD	25 octobre 2024	253	252	–	(1)
A	840 CZK	(37) USD	25 octobre 2024	50	50	–	–
A	3 350 EUR	(3 672) USD	25 octobre 2024	4 966	5 049	83	–
A	4 061 EUR	(4 451) USD	25 octobre 2024	6 020	6 121	101	–
A	1 956 EUR	(2 138) USD	25 octobre 2024	2 891	2 948	57	–
A	339 EUR	(369) USD	25 octobre 2024	499	511	12	–
A	238 USD	(220) EUR	25 octobre 2024	(322)	(331)	–	(9)
A	788 USD	(717) EUR	25 octobre 2024	(1 065)	(1 080)	–	(15)
A	1 018 USD	(914) EUR	25 octobre 2024	(1 377)	(1 377)	–	–
A	403 USD	(360) EUR	25 octobre 2024	(545)	(543)	2	–
A	758 USD	(683) EUR	25 octobre 2024	(1 025)	(1 029)	–	(4)
A	788 USD	(714) EUR	25 octobre 2024	(1 066)	(1 076)	–	(10)
A	186 USD	(167) EUR	25 octobre 2024	(251)	(251)	–	–
A	268 USD	(241) EUR	25 octobre 2024	(363)	(362)	1	–
A	1 670 GBP	(2 171) USD	25 octobre 2024	2 936	3 020	84	–
A	1 032 GBP	(1 341) USD	25 octobre 2024	1 814	1 866	52	–
A	358 GBP	(464) USD	25 octobre 2024	627	647	20	–
A	795 USD	(616) GBP	25 octobre 2024	(1 075)	(1 113)	–	(38)
A	12 USD	(9) GBP	25 octobre 2024	(16)	(17)	–	(1)
A	1 053 GBP	(1 351) USD	25 octobre 2024	1 827	1 904	77	–

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

Au 30 septembre 2024

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	485 GBP	(632) USD	25 octobre 2024	855	877	22	–
A	569 GBP	(753) USD	25 octobre 2024	1 018	1 028	10	–
A	570 GBP	(750) USD	25 octobre 2024	1 014	1 030	16	–
A	295 GBP	(385) USD	25 octobre 2024	520	532	12	–
A	99 GBP	(130) USD	25 octobre 2024	176	178	2	–
A	413 USD	(309) GBP	25 octobre 2024	(559)	(558)	1	–
A	23 088 694 IDR	(1 431) USD	25 octobre 2024	1 935	2 052	117	–
A	102 USD	(1 652 867) IDR	25 octobre 2024	(138)	(147)	–	(9)
A	1 476 637 IDR	(91) USD	25 octobre 2024	123	131	8	–
A	8 554 488 IDR	(523) USD	25 octobre 2024	707	760	53	–
A	331 USD	(5 255 622) IDR	25 octobre 2024	(448)	(467)	–	(19)
A	2 846 655 IDR	(184) USD	25 octobre 2024	249	253	4	–
A	881 082 IDR	(57) USD	25 octobre 2024	77	79	2	–
A	6 784 579 IDR	(440) USD	25 octobre 2024	595	603	8	–
A	4 711 539 IDR	(305) USD	25 octobre 2024	412	419	7	–
A	14 748 383 IDR	(960) USD	25 octobre 2024	1 298	1 311	13	–
A	965 006 IDR	(64) USD	25 octobre 2024	86	86	–	–
A	2 115 ILS	(588) USD	25 octobre 2024	795	768	–	(27)
A	9 100 USD	(32 736) ILS	25 octobre 2024	(12 306)	(11 887)	419	–
A	1 347 USD	(4 864) ILS	25 octobre 2024	(1 822)	(1 766)	56	–
A	473 USD	(1 707) ILS	25 octobre 2024	(639)	(620)	19	–
A	397 USD	(1 482) ILS	25 octobre 2024	(537)	(538)	–	(1)
A	1 863 ILS	(503) USD	25 octobre 2024	680	677	–	(3)
A	65 USD	(240) ILS	25 octobre 2024	(88)	(87)	1	–
A	1 812 ILS	(493) USD	25 octobre 2024	667	658	–	(9)
A	570 ILS	(154) USD	25 octobre 2024	208	207	–	(1)
A	1 130 ILS	(301) USD	25 octobre 2024	407	410	3	–
A	235 USD	(889) ILS	25 octobre 2024	(318)	(323)	–	(5)
A	981 ILS	(262) USD	25 octobre 2024	354	357	3	–
A	14 USD	(1 153) INR	25 octobre 2024	(19)	(19)	–	–
A	112 564 INR	(1 344) USD	25 octobre 2024	1 817	1 814	–	(3)
A	3 479 INR	(41) USD	25 octobre 2024	56	56	–	–
A	18 USD	(1 564) INR	25 octobre 2024	(25)	(25)	–	–
A	50 USD	(4 246) INR	25 octobre 2024	(68)	(68)	–	–
A	94 USD	(7 905) INR	25 octobre 2024	(127)	(127)	–	–
A	47 USD	(3 977) INR	25 octobre 2024	(64)	(64)	–	–
A	19 411 INR	(231) USD	25 octobre 2024	312	313	1	–
A	13 382 INR	(159) USD	25 octobre 2024	215	216	1	–
A	9 407 INR	(112) USD	25 octobre 2024	151	151	–	–
A	10 068 INR	(120) USD	25 octobre 2024	162	162	–	–
A	12 926 INR	(155) USD	25 octobre 2024	209	209	–	–
A	1 359 223 JPY	(8 747) USD	25 octobre 2024	11 829	12 839	1 010	–
A	3 217 USD	(499 851) JPY	25 octobre 2024	(4 350)	(4 722)	–	(372)
A	789 USD	(123 346) JPY	25 octobre 2024	(1 067)	(1 165)	–	(98)
A	1 143 USD	(175 921) JPY	25 octobre 2024	(1 546)	(1 662)	–	(116)
A	3 666 USD	(559 821) JPY	25 octobre 2024	(4 958)	(5 288)	–	(330)
A	3 033 USD	(441 355) JPY	25 octobre 2024	(4 102)	(4 169)	–	(67)
A	973 USD	(140 415) JPY	25 octobre 2024	(1 316)	(1 326)	–	(10)
A	131 USD	(18 756) JPY	25 octobre 2024	(177)	(177)	–	–
A	19 226 JPY	(135) USD	25 octobre 2024	182	182	–	–
A	717 USD	(101 595) JPY	25 octobre 2024	(969)	(960)	9	–

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

Au 30 septembre 2024

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	297 USD	(41 838) JPY	25 octobre 2024	(401)	(395)	6	–
A	103 988 JPY	(727) USD	25 octobre 2024	983	983	–	–
A	5 079 USD	(6 946 344) KOR	25 octobre 2024	(6 868)	(7 135)	–	(267)
A	521 580 KOR	(382) USD	25 octobre 2024	516	536	20	–
A	757 USD	(1 044 131) KOR	25 octobre 2024	(1 024)	(1 072)	–	(48)
A	387 USD	(533 910) KOR	25 octobre 2024	(524)	(549)	–	(25)
A	784 USD	(1 080 497) KOR	25 octobre 2024	(1 060)	(1 110)	–	(50)
A	537 USD	(731 666) KOR	25 octobre 2024	(726)	(751)	–	(25)
A	197 USD	(262 270) KOR	25 octobre 2024	(267)	(269)	–	(2)
A	109 USD	(144 957) KOR	25 octobre 2024	(148)	(149)	–	(1)
A	167 294 KOR	(126) USD	25 octobre 2024	170	172	2	–
A	538 836 KOR	(402) USD	25 octobre 2024	544	554	10	–
A	1 420 729 KOR	(1 076) USD	25 octobre 2024	1 455	1 459	4	–
A	1 508 479 KOR	(1 137) USD	25 octobre 2024	1 537	1 549	12	–
A	110 718 MXN	(6 159) USD	25 octobre 2024	8 329	7 575	–	(754)
A	4 207 USD	(75 635) MXN	25 octobre 2024	(5 689)	(5 175)	514	–
A	13 207 MXN	(735) USD	25 octobre 2024	994	904	–	(90)
A	6 196 MXN	(337) USD	25 octobre 2024	456	423	–	(33)
A	9 459 MXN	(498) USD	25 octobre 2024	673	647	–	(26)
A	251 USD	(4 845) MXN	25 octobre 2024	(340)	(331)	9	–
A	760 USD	(14 515) MXN	25 octobre 2024	(1 028)	(993)	35	–
A	18 USD	(348) MXN	25 octobre 2024	(24)	(24)	–	–
A	18 USD	(368) MXN	25 octobre 2024	(25)	(25)	–	–
A	847 MXN	(42) USD	25 octobre 2024	57	58	1	–
A	1 470 USD	(28 515) MXN	25 octobre 2024	(1 988)	(1 951)	37	–
A	590 USD	(11 454) MXN	25 octobre 2024	(798)	(783)	15	–
A	4 794 NOK	(448) USD	25 octobre 2024	606	615	9	–
A	18 622 NOK	(1 740) USD	25 octobre 2024	2 353	2 387	34	–
A	2 799 NOK	(259) USD	25 octobre 2024	350	359	9	–
A	4 145 NOK	(376) USD	25 octobre 2024	509	532	23	–
A	20 USD	(220) NOK	25 octobre 2024	(27)	(28)	–	(1)
A	15 440 NOK	(1 435) USD	25 octobre 2024	1 941	1 979	38	–
A	12 026 NOK	(1 145) USD	25 octobre 2024	1 549	1 541	–	(8)
A	7 955 NOK	(759) USD	25 octobre 2024	1 027	1 019	–	(8)
A	30 USD	(314) NOK	25 octobre 2024	(40)	(40)	–	–
A	129 NOK	(12) USD	25 octobre 2024	16	16	–	–
A	2 593 NOK	(245) USD	25 octobre 2024	331	332	1	–
A	4 079 NOK	(391) USD	25 octobre 2024	529	523	–	(6)
A	174 USD	(284) NZD	25 octobre 2024	(235)	(244)	–	(9)
A	4 818 USD	(7 872) NZD	25 octobre 2024	(6 516)	(6 762)	–	(246)
A	795 USD	(1 315) NZD	25 octobre 2024	(1 075)	(1 130)	–	(55)
A	6 USD	(9) NZD	25 octobre 2024	(8)	(9)	–	(1)
A	70 USD	(119) NZD	25 octobre 2024	(95)	(102)	–	(7)
A	251 USD	(414) NZD	25 octobre 2024	(339)	(356)	–	(17)
A	143 NZD	(88) USD	25 octobre 2024	119	123	4	–
A	915 USD	(1 469) NZD	25 octobre 2024	(1 238)	(1 262)	–	(24)
A	280 USD	(452) NZD	25 octobre 2024	(379)	(388)	–	(9)
A	1 031 NZD	(634) USD	25 octobre 2024	857	885	28	–
A	2 077 NZD	(1 286) USD	25 octobre 2024	1 739	1 784	45	–
A	480 NZD	(304) USD	25 octobre 2024	411	413	2	–
A	12 040 USD	(703 686) PHP	25 octobre 2024	(16 283)	(16 954)	–	(671)

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

Au 30 septembre 2024

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	7 158 USD	(418 298) PHP	25 octobre 2024	(9 680)	(10 078)	–	(398)
A	1 210 USD	(70 772) PHP	25 octobre 2024	(1 637)	(1 705)	–	(68)
A	626 USD	(36 627) PHP	25 octobre 2024	(846)	(882)	–	(36)
A	34 162 PHP	(582) USD	25 octobre 2024	787	823	36	–
A	57 681 PHP	(1 011) USD	25 octobre 2024	1 367	1 390	23	–
A	70 015 PHP	(1 241) USD	25 octobre 2024	1 678	1 687	9	–
A	33 899 PHP	(602) USD	25 octobre 2024	814	817	3	–
A	34 225 PHP	(610) USD	25 octobre 2024	825	824	–	(1)
A	20 389 PHP	(365) USD	25 octobre 2024	494	491	–	(3)
A	737 USD	(41 312) PHP	25 octobre 2024	(997)	(995)	2	–
A	26 652 PLN	(6 824) USD	25 octobre 2024	9 228	9 359	131	–
A	7 471 PLN	(1 913) USD	25 octobre 2024	2 587	2 623	36	–
A	197 USD	(775) PLN	25 octobre 2024	(266)	(272)	–	(6)
A	52 USD	(204) PLN	25 octobre 2024	(70)	(72)	–	(2)
A	67 USD	(267) PLN	25 octobre 2024	(91)	(94)	–	(3)
A	1 987 PLN	(507) USD	25 octobre 2024	686	698	12	–
A	2 183 PLN	(567) USD	25 octobre 2024	767	767	–	–
A	2 847 PLN	(741) USD	25 octobre 2024	1 002	1 000	–	(2)
A	1 971 PLN	(509) USD	25 octobre 2024	689	692	3	–
A	1 442 PLN	(370) USD	25 octobre 2024	501	506	5	–
A	597 PLN	(155) USD	25 octobre 2024	210	209	–	(1)
A	217 PLN	(57) USD	25 octobre 2024	77	76	–	(1)
A	122 102 SEK	(11 665) USD	25 octobre 2024	15 775	16 279	504	–
A	5 095 USD	(53 327) SEK	25 octobre 2024	(6 890)	(7 110)	–	(220)
A	4 910 SEK	(465) USD	25 octobre 2024	629	655	26	–
A	3 969 SEK	(370) USD	25 octobre 2024	501	530	29	–
A	3 763 SEK	(350) USD	25 octobre 2024	474	502	28	–
A	896 USD	(9 383) SEK	25 octobre 2024	(1 212)	(1 251)	–	(39)
A	440 USD	(4 487) SEK	25 octobre 2024	(595)	(599)	–	(4)
A	1 018 USD	(10 333) SEK	25 octobre 2024	(1 377)	(1 378)	–	(1)
A	592 USD	(6 070) SEK	25 octobre 2024	(800)	(810)	–	(10)
A	592 USD	(6 143) SEK	25 octobre 2024	(801)	(819)	–	(18)
A	4 141 SEK	(407) USD	25 octobre 2024	551	552	1	–
A	496 SEK	(49) USD	25 octobre 2024	66	66	–	–
A	5 761 USD	(206 775) THB	25 octobre 2024	(7 791)	(8 643)	–	(852)
A	146 336 THB	(4 073) USD	25 octobre 2024	5 508	6 117	609	–
A	40 715 THB	(1 137) USD	25 octobre 2024	1 537	1 702	165	–
A	46 402 THB	(1 291) USD	25 octobre 2024	1 746	1 940	194	–
A	32 797 THB	(918) USD	25 octobre 2024	1 241	1 371	130	–
A	15 195 THB	(436) USD	25 octobre 2024	590	635	45	–
A	175 USD	(5 933) THB	25 octobre 2024	(236)	(248)	–	(12)
A	961 USD	(32 579) THB	25 octobre 2024	(1 300)	(1 362)	–	(62)
A	569 USD	(19 062) THB	25 octobre 2024	(769)	(797)	–	(28)
A	100 USD	(3 356) THB	25 octobre 2024	(135)	(140)	–	(5)
A	47 135 THB	(1 417) USD	25 octobre 2024	1 916	1 970	54	–
A	37 181 THB	(1 139) USD	25 octobre 2024	1 541	1 555	14	–
A	378 782 ZAR	(20 902) USD	25 octobre 2024	28 267	29 582	1 315	–
A	10 241 USD	(185 611) ZAR	25 octobre 2024	(13 850)	(14 496)	–	(646)
A	16 660 ZAR	(914) USD	25 octobre 2024	1 236	1 301	65	–
A	4 968 ZAR	(268) USD	25 octobre 2024	363	388	25	–
A	4 494 ZAR	(243) USD	25 octobre 2024	329	351	22	–

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

Au 30 septembre 2024

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	16 401 ZAR	(898) USD	25 octobre 2024	1 215	1 281	66	–
A	9 167 ZAR	(510) USD	25 octobre 2024	690	716	26	–
A	148 USD	(2 630) ZAR	25 octobre 2024	(200)	(206)	–	(6)
A	166 USD	(2 948) ZAR	25 octobre 2024	(224)	(230)	–	(6)
A	429 USD	(7 718) ZAR	25 octobre 2024	(580)	(603)	–	(23)
A	5 039 ZAR	(285) USD	25 octobre 2024	385	393	8	–
A	482 USD	(8 372) ZAR	25 octobre 2024	(652)	(654)	–	(2)
A	1 926 USD	(2 830) AUD	25 octobre 2024	(2 605)	(2 647)	–	(42)
A	8 192 AUD	(5 576) USD	25 octobre 2024	7 541	7 661	120	–
A	677 AUD	(456) USD	25 octobre 2024	617	633	16	–
A	441 AUD	(292) USD	25 octobre 2024	395	412	17	–
A	902 AUD	(591) USD	25 octobre 2024	799	843	44	–
A	34 AUD	(23) USD	25 octobre 2024	31	32	1	–
A	184 USD	(273) AUD	25 octobre 2024	(249)	(255)	–	(6)
A	98 USD	(144) AUD	25 octobre 2024	(132)	(134)	–	(2)
A	53 USD	(80) AUD	25 octobre 2024	(72)	(75)	–	(3)
A	347 USD	(513) AUD	25 octobre 2024	(469)	(479)	–	(10)
A	166 USD	(241) AUD	25 octobre 2024	(224)	(225)	–	(1)
A	14 812 BRL	(2 683) USD	25 octobre 2024	3 629	3 665	36	–
A	7 588 BRL	(1 376) USD	25 octobre 2024	1 861	1 878	17	–
A	17 USD	(95) BRL	25 octobre 2024	(23)	(23)	–	–
A	333 BRL	(59) USD	25 octobre 2024	80	82	2	–
A	29 USD	(164) BRL	25 octobre 2024	(39)	(41)	–	(2)
A	585 USD	(3 235) BRL	25 octobre 2024	(791)	(801)	–	(10)
A	379 USD	(2 084) BRL	25 octobre 2024	(512)	(516)	–	(4)
A	208 BRL	(38) USD	25 octobre 2024	51	52	1	–
A	96 USD	(541) BRL	25 octobre 2024	(130)	(134)	–	(4)
A	158 USD	(895) BRL	25 octobre 2024	(214)	(222)	–	(8)
A	371 USD	(2 052) BRL	25 octobre 2024	(502)	(508)	–	(6)
A	150 USD	(824) BRL	25 octobre 2024	(203)	(204)	–	(1)
A	5 822 USD	(7 910) CAD	25 octobre 2024	5 852	5 811	–	(41)
A	3 950 USD	(5 368) CAD	25 octobre 2024	3 971	3 943	–	(28)
A	920 USD	(1 257) CAD	25 octobre 2024	930	917	–	(13)
A	156 USD	(215) CAD	25 octobre 2024	159	156	–	(3)
A	337 CAD	(244) USD	25 octobre 2024	(337)	(330)	7	–
A	993 CAD	(725) USD	25 octobre 2024	(994)	(981)	13	–
A	443 CAD	(325) USD	25 octobre 2024	(443)	(440)	3	–
A	807 CAD	(601) USD	25 octobre 2024	(808)	(813)	–	(5)
A	801 CAD	(593) USD	25 octobre 2024	(801)	(802)	–	(1)
A	748 CAD	(550) USD	25 octobre 2024	(748)	(744)	4	–
A	171 USD	(232) CAD	25 octobre 2024	172	171	–	(1)
A	153 USD	(207) CAD	25 octobre 2024	153	154	1	–
A	81 USD	(74 520) CLP	25 octobre 2024	(110)	(112)	–	(2)
A	1 029 293 CLP	(1 129) USD	25 octobre 2024	1 527	1 548	21	–
A	270 USD	(248 659) CLP	25 octobre 2024	(365)	(374)	–	(9)
A	111 800 CLP	(118) USD	25 octobre 2024	160	169	9	–
A	33 USD	(31 691) CLP	25 octobre 2024	(45)	(48)	–	(3)
A	95 USD	(88 838) CLP	25 octobre 2024	(129)	(134)	–	(5)
A	17 851 CLP	(19) USD	25 octobre 2024	26	27	1	–
A	9 796 CLP	(11) USD	25 octobre 2024	15	15	–	–
A	14 510 CLP	(16) USD	25 octobre 2024	21	22	1	–

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

Au 30 septembre 2024

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	141 690 CLP	(149) USD	25 octobre 2024	202	214	12	–
A	27 607 CLP	(30) USD	25 octobre 2024	40	41	1	–
A	111 797 CLP	(123) USD	25 octobre 2024	166	168	2	–
A	8 016 CNY	(1 111) USD	25 octobre 2024	1 502	1 552	50	–
A	5 504 USD	(39 729) CNY	25 octobre 2024	(7 443)	(7 690)	–	(247)
A	331 USD	(2 403) CNY	25 octobre 2024	(448)	(465)	–	(17)
A	25 USD	(184) CNY	25 octobre 2024	(34)	(35)	–	(1)
A	391 CNY	(54) USD	25 octobre 2024	73	75	2	–
A	3 080 CNY	(433) USD	25 octobre 2024	586	596	10	–
A	1 766 CNY	(250) USD	25 octobre 2024	338	342	4	–
A	1 158 CNY	(163) USD	25 octobre 2024	221	224	3	–
A	602 CNY	(85) USD	25 octobre 2024	115	116	1	–
A	404 CNY	(57) USD	25 octobre 2024	77	78	1	–
A	12 USD	(84) CNY	25 octobre 2024	(16)	(16)	–	–
A	195 CNY	(28) USD	25 octobre 2024	38	38	–	–
A	9 405 026 COP	(2 344) USD	25 octobre 2024	3 170	3 010	–	(160)
A	9 576 855 COP	(2 387) USD	25 octobre 2024	3 228	3 065	–	(163)
A	32 597 COP	(8) USD	25 octobre 2024	11	11	–	–
A	11 USD	(43 863) COP	25 octobre 2024	(15)	(14)	1	–
A	221 USD	(913 785) COP	25 octobre 2024	(299)	(293)	6	–
A	338 USD	(1 382 220) COP	25 octobre 2024	(457)	(442)	15	–
A	166 USD	(674 845) COP	25 octobre 2024	(225)	(216)	9	–
A	189 USD	(773 196) COP	25 octobre 2024	(256)	(247)	9	–
A	225 USD	(946 740) COP	25 octobre 2024	(304)	(303)	1	–
A	208 USD	(898 356) COP	25 octobre 2024	(281)	(287)	–	(6)
A	88 USD	(375 994) COP	25 octobre 2024	(119)	(120)	–	(1)
A	44 USD	(184 478) COP	25 octobre 2024	(60)	(59)	1	–
A	3 282 USD	(75 997) CZK	25 octobre 2024	(4 439)	(4 541)	–	(102)
A	72 015 CZK	(3 110) USD	25 octobre 2024	4 206	4 302	96	–
A	5 566 CZK	(240) USD	25 octobre 2024	324	332	8	–
A	3 980 CZK	(170) USD	25 octobre 2024	230	237	7	–
A	9 830 CZK	(419) USD	25 octobre 2024	566	587	21	–
A	1 770 CZK	(77) USD	25 octobre 2024	104	105	1	–
A	2 817 CZK	(125) USD	25 octobre 2024	169	169	–	–
A	259 USD	(5 794) CZK	25 octobre 2024	(350)	(346)	4	–
A	1 106 CZK	(49) USD	25 octobre 2024	66	66	–	–
A	4 766 CZK	(209) USD	25 octobre 2024	283	284	1	–
A	1 621 CZK	(72) USD	25 octobre 2024	97	97	–	–
A	318 CZK	(14) USD	25 octobre 2024	19	19	–	–
A	981 EUR	(1 075) USD	25 octobre 2024	1 454	1 478	24	–
A	2 302 EUR	(2 523) USD	25 octobre 2024	3 412	3 469	57	–
A	859 EUR	(939) USD	25 octobre 2024	1 270	1 295	25	–
A	132 EUR	(143) USD	25 octobre 2024	194	198	4	–
A	69 USD	(63) EUR	25 octobre 2024	(93)	(96)	–	(3)
A	373 USD	(339) EUR	25 octobre 2024	(504)	(511)	–	(7)
A	525 USD	(471) EUR	25 octobre 2024	(710)	(710)	–	–
A	245 USD	(218) EUR	25 octobre 2024	(331)	(330)	1	–
A	372 USD	(335) EUR	25 octobre 2024	(503)	(505)	–	(2)
A	344 USD	(312) EUR	25 octobre 2024	(465)	(469)	–	(4)
A	95 USD	(86) EUR	25 octobre 2024	(129)	(129)	–	–
A	118 USD	(106) EUR	25 octobre 2024	(159)	(159)	–	–

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

Au 30 septembre 2024

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	157 USD	(120) GBP	25 octobre 2024	(212)	(218)	–	(6)
A	1 319 GBP	(1 714) USD	25 octobre 2024	2 318	2 384	66	–
A	156 GBP	(201) USD	25 octobre 2024	272	281	9	–
A	355 USD	(275) GBP	25 octobre 2024	(480)	(497)	–	(17)
A	4 GBP	(5) USD	25 octobre 2024	7	7	–	–
A	452 GBP	(580) USD	25 octobre 2024	784	817	33	–
A	161 GBP	(210) USD	25 octobre 2024	284	291	7	–
A	202 GBP	(268) USD	25 octobre 2024	362	366	4	–
A	200 GBP	(264) USD	25 octobre 2024	357	363	6	–
A	119 GBP	(155) USD	25 octobre 2024	210	215	5	–
A	35 GBP	(46) USD	25 octobre 2024	62	63	1	–
A	169 USD	(126) GBP	25 octobre 2024	(228)	(228)	–	–
A	10 040 710 IDR	(623) USD	25 octobre 2024	842	893	51	–
A	41 USD	(666 325) IDR	25 octobre 2024	(56)	(60)	–	(4)
A	629 230 IDR	(38) USD	25 octobre 2024	52	56	4	–
A	3 984 484 IDR	(243) USD	25 octobre 2024	329	354	25	–
A	150 USD	(2 384 699) IDR	25 octobre 2024	(203)	(212)	–	(9)
A	872 678 IDR	(56) USD	25 octobre 2024	76	77	1	–
A	125 458 IDR	(8) USD	25 octobre 2024	11	11	–	–
A	2 494 665 IDR	(162) USD	25 octobre 2024	219	222	3	–
A	1 923 951 IDR	(124) USD	25 octobre 2024	168	171	3	–
A	5 953 270 IDR	(387) USD	25 octobre 2024	524	529	5	–
A	409 158 IDR	(27) USD	25 octobre 2024	36	36	–	–
A	282 ILS	(78) USD	25 octobre 2024	106	102	–	(4)
A	3 857 USD	(13 877) ILS	25 octobre 2024	(5 216)	(5 038)	178	–
A	586 USD	(2 118) ILS	25 octobre 2024	(793)	(769)	24	–
A	187 USD	(677) ILS	25 octobre 2024	(253)	(245)	8	–
A	217 USD	(809) ILS	25 octobre 2024	(293)	(294)	–	(1)
A	932 ILS	(251) USD	25 octobre 2024	340	338	–	(2)
A	316 ILS	(86) USD	25 octobre 2024	116	115	–	(1)
A	1 043 ILS	(284) USD	25 octobre 2024	384	379	–	(5)
A	503 ILS	(136) USD	25 octobre 2024	184	183	–	(1)
A	525 ILS	(140) USD	25 octobre 2024	189	190	1	–
A	75 USD	(283) ILS	25 octobre 2024	(101)	(102)	–	(1)
A	428 ILS	(114) USD	25 octobre 2024	154	155	1	–
A	284 USD	(23 798) INR	25 octobre 2024	(384)	(383)	1	–
A	73 307 INR	(875) USD	25 octobre 2024	1 183	1 181	–	(2)
A	1 376 INR	(16) USD	25 octobre 2024	22	22	–	–
A	10 USD	(841) INR	25 octobre 2024	(14)	(14)	–	–
A	18 USD	(1 473) INR	25 octobre 2024	(24)	(24)	–	–
A	44 USD	(3 761) INR	25 octobre 2024	(60)	(60)	–	–
A	34 USD	(2 827) INR	25 octobre 2024	(46)	(46)	–	–
A	7 041 INR	(84) USD	25 octobre 2024	113	113	–	–
A	4 605 INR	(55) USD	25 octobre 2024	74	74	–	–
A	3 801 INR	(45) USD	25 octobre 2024	61	61	–	–
A	3 932 INR	(47) USD	25 octobre 2024	63	63	–	–
A	5 247 INR	(63) USD	25 octobre 2024	85	85	–	–
A	525 734 JPY	(3 383) USD	25 octobre 2024	4 575	4 966	391	–
A	921 USD	(143 087) JPY	25 octobre 2024	(1 245)	(1 351)	–	(106)
A	355 USD	(55 531) JPY	25 octobre 2024	(480)	(524)	–	(44)
A	512 USD	(78 705) JPY	25 octobre 2024	(692)	(744)	–	(52)

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

Au 30 septembre 2024

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	1 645 USD	(251 185) JPY	25 octobre 2024	(2 225)	(2 373)	–	(148)
A	1 313 USD	(191 034) JPY	25 octobre 2024	(1 776)	(1 805)	–	(29)
A	366 USD	(52 759) JPY	25 octobre 2024	(495)	(499)	–	(4)
A	27 USD	(3 963) JPY	25 octobre 2024	(37)	(37)	–	–
A	11 138 JPY	(78) USD	25 octobre 2024	105	105	–	–
A	291 USD	(41 295) JPY	25 octobre 2024	(394)	(390)	4	–
A	113 USD	(15 965) JPY	25 octobre 2024	(153)	(151)	2	–
A	42 577 JPY	(297) USD	25 octobre 2024	402	402	–	–
A	2 182 USD	(2 984 997) KOR	25 octobre 2024	(2 951)	(3 066)	–	(115)
A	145 498 KOR	(106) USD	25 octobre 2024	144	150	6	–
A	333 USD	(459 326) KOR	25 octobre 2024	(451)	(472)	–	(21)
A	160 USD	(221 302) KOR	25 octobre 2024	(217)	(227)	–	(10)
A	376 USD	(519 231) KOR	25 octobre 2024	(509)	(533)	–	(24)
A	213 USD	(290 364) KOR	25 octobre 2024	(288)	(298)	–	(10)
A	21 788 KOR	(16) USD	25 octobre 2024	22	22	–	–
A	142 280 KOR	(106) USD	25 octobre 2024	144	146	2	–
A	235 515 KOR	(176) USD	25 octobre 2024	238	242	4	–
A	597 786 KOR	(453) USD	25 octobre 2024	612	614	2	–
A	623 460 KOR	(470) USD	25 octobre 2024	635	640	5	–
A	33 713 MXN	(1 875) USD	25 octobre 2024	2 536	2 307	–	(229)
A	1 017 USD	(18 286) MXN	25 octobre 2024	(1 375)	(1 251)	124	–
A	5 830 MXN	(325) USD	25 octobre 2024	439	399	–	(40)
A	2 645 MXN	(144) USD	25 octobre 2024	195	181	–	(14)
A	4 511 MXN	(237) USD	25 octobre 2024	321	308	–	(13)
A	120 USD	(2 305) MXN	25 octobre 2024	(162)	(158)	4	–
A	345 USD	(6 594) MXN	25 octobre 2024	(467)	(451)	16	–
A	31 USD	(609) MXN	25 octobre 2024	(42)	(42)	–	–
A	28 USD	(560) MXN	25 octobre 2024	(38)	(39)	–	(1)
A	231 MXN	(11) USD	25 octobre 2024	15	15	–	–
A	604 USD	(11 713) MXN	25 octobre 2024	(817)	(802)	15	–
A	245 USD	(4 767) MXN	25 octobre 2024	(332)	(326)	6	–
A	385 USD	(4 116) NOK	25 octobre 2024	(520)	(528)	–	(8)
A	14 542 NOK	(1 358) USD	25 octobre 2024	1 837	1 864	27	–
A	1 207 NOK	(112) USD	25 octobre 2024	151	155	4	–
A	1 745 NOK	(158) USD	25 octobre 2024	214	223	9	–
A	6 629 NOK	(616) USD	25 octobre 2024	833	849	16	–
A	4 435 NOK	(422) USD	25 octobre 2024	571	568	–	(3)
A	2 858 NOK	(273) USD	25 octobre 2024	369	366	–	(3)
A	47 USD	(497) NOK	25 octobre 2024	(63)	(64)	–	(1)
A	992 NOK	(94) USD	25 octobre 2024	127	127	–	–
A	1 664 NOK	(160) USD	25 octobre 2024	216	213	–	(3)
A	206 USD	(337) NZD	25 octobre 2024	(279)	(290)	–	(11)
A	2 010 USD	(3 283) NZD	25 octobre 2024	(2 718)	(2 821)	–	(103)
A	348 USD	(575) NZD	25 octobre 2024	(470)	(494)	–	(24)
A	17 NZD	(10) USD	25 octobre 2024	13	14	1	–
A	53 USD	(89) NZD	25 octobre 2024	(71)	(76)	–	(5)
A	91 USD	(150) NZD	25 octobre 2024	(123)	(129)	–	(6)
A	168 NZD	(104) USD	25 octobre 2024	140	145	5	–
A	320 USD	(514) NZD	25 octobre 2024	(433)	(441)	–	(8)
A	64 USD	(102) NZD	25 octobre 2024	(86)	(88)	–	(2)
A	432 NZD	(265) USD	25 octobre 2024	359	371	12	–

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

Au 30 septembre 2024

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	864 NZD	(535) USD	25 octobre 2024	723	742	19	–
A	204 NZD	(129) USD	25 octobre 2024	174	175	1	–
A	3 391 USD	(198 191) PHP	25 octobre 2024	(4 586)	(4 775)	–	(189)
A	5 126 USD	(299 536) PHP	25 octobre 2024	(6 932)	(7 217)	–	(285)
A	521 USD	(30 420) PHP	25 octobre 2024	(704)	(733)	–	(29)
A	231 USD	(13 533) PHP	25 octobre 2024	(313)	(326)	–	(13)
A	10 884 PHP	(186) USD	25 octobre 2024	251	262	11	–
A	28 596 PHP	(501) USD	25 octobre 2024	678	689	11	–
A	41 164 PHP	(729) USD	25 octobre 2024	986	991	5	–
A	23 164 PHP	(411) USD	25 octobre 2024	556	558	2	–
A	21 966 PHP	(392) USD	25 octobre 2024	530	530	–	–
A	2 137 PHP	(38) USD	25 octobre 2024	51	51	–	–
A	10 641 PHP	(191) USD	25 octobre 2024	258	256	–	(2)
A	286 USD	(16 022) PHP	25 octobre 2024	(387)	(386)	1	–
A	14 634 PLN	(3 747) USD	25 octobre 2024	5 067	5 139	72	–
A	520 PLN	(133) USD	25 octobre 2024	180	183	3	–
A	95 USD	(373) PLN	25 octobre 2024	(128)	(131)	–	(3)
A	41 USD	(160) PLN	25 octobre 2024	(55)	(56)	–	(1)
A	763 PLN	(194) USD	25 octobre 2024	263	268	5	–
A	505 PLN	(131) USD	25 octobre 2024	177	177	–	–
A	860 PLN	(224) USD	25 octobre 2024	303	302	–	(1)
A	518 PLN	(134) USD	25 octobre 2024	181	182	1	–
A	552 PLN	(142) USD	25 octobre 2024	192	194	2	–
A	177 PLN	(46) USD	25 octobre 2024	62	62	–	–
A	80 PLN	(21) USD	25 octobre 2024	28	28	–	–
A	72 210 SEK	(6 898) USD	25 octobre 2024	9 329	9 627	298	–
A	3 970 USD	(41 552) SEK	25 octobre 2024	(5 369)	(5 540)	–	(171)
A	2 064 SEK	(195) USD	25 octobre 2024	264	275	11	–
A	1 546 SEK	(144) USD	25 octobre 2024	195	206	11	–
A	1 975 SEK	(184) USD	25 octobre 2024	249	264	15	–
A	416 USD	(4 357) SEK	25 octobre 2024	(563)	(581)	–	(18)
A	260 USD	(2 659) SEK	25 octobre 2024	(352)	(354)	–	(2)
A	474 USD	(4 810) SEK	25 octobre 2024	(641)	(641)	–	–
A	287 USD	(2 948) SEK	25 octobre 2024	(388)	(393)	–	(5)
A	258 USD	(2 679) SEK	25 octobre 2024	(349)	(357)	–	(8)
A	1 522 SEK	(149) USD	25 octobre 2024	202	202	–	–
A	137 SEK	(13) USD	25 octobre 2024	18	18	–	–
A	33 886 THB	(944) USD	25 octobre 2024	1 277	1 417	140	–
A	1 681 USD	(60 383) THB	25 octobre 2024	(2 273)	(2 524)	–	(251)
A	17 900 THB	(500) USD	25 octobre 2024	676	749	73	–
A	20 262 THB	(563) USD	25 octobre 2024	762	847	85	–
A	14 943 THB	(418) USD	25 octobre 2024	565	624	59	–
A	6 363 THB	(183) USD	25 octobre 2024	247	266	19	–
A	96 USD	(3 259) THB	25 octobre 2024	(130)	(137)	–	(7)
A	407 USD	(13 799) THB	25 octobre 2024	(551)	(577)	–	(26)
A	242 USD	(8 111) THB	25 octobre 2024	(327)	(339)	–	(12)
A	48 USD	(1 621) THB	25 octobre 2024	(65)	(68)	–	(3)
A	18 958 THB	(570) USD	25 octobre 2024	771	793	22	–
A	15 109 THB	(463) USD	25 octobre 2024	626	632	6	–
A	155 470 ZAR	(8 579) USD	25 octobre 2024	11 602	12 142	540	–
A	3 844 USD	(69 657) ZAR	25 octobre 2024	(5 198)	(5 440)	–	(242)

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

Au 30 septembre 2024

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	7 177 ZAR	(394) USD	25 octobre 2024	533	561	28	–
A	1 722 ZAR	(93) USD	25 octobre 2024	126	135	9	–
A	2 806 ZAR	(152) USD	25 octobre 2024	206	220	14	–
A	6 459 ZAR	(354) USD	25 octobre 2024	479	505	26	–
A	1 135 ZAR	(63) USD	25 octobre 2024	85	88	3	–
A	169 USD	(3 021) ZAR	25 octobre 2024	(229)	(236)	–	(7)
A	166 USD	(2 960) ZAR	25 octobre 2024	(225)	(231)	–	(6)
A	195 USD	(3 516) ZAR	25 octobre 2024	(264)	(274)	–	(10)
A	1 591 ZAR	(90) USD	25 octobre 2024	122	125	3	–
A	205 USD	(3 561) ZAR	25 octobre 2024	(277)	(278)	–	(1)
A	6 457 CAD	(4 752) USD	25 octobre 2024	(6 460)	(6 426)	34	–
A	645 CAD	(475) USD	25 octobre 2024	(646)	(643)	3	–
A	1 485 CAD	(1 086) USD	25 octobre 2024	(1 485)	(1 469)	16	–
A	373 CAD	(271) USD	25 octobre 2024	(373)	(367)	6	–
A	85 USD	(118) CAD	25 octobre 2024	87	84	–	(3)
A	163 CAD	(119) USD	25 octobre 2024	(163)	(161)	2	–
A	18 CAD	(13) USD	25 octobre 2024	(18)	(18)	–	–
A	189 USD	(254) CAD	25 octobre 2024	188	190	2	–
A	47 USD	(62) CAD	25 octobre 2024	46	46	–	–
A	76 CAD	(56) USD	25 octobre 2024	(76)	(76)	–	–
A	256 CAD	(189) USD	25 octobre 2024	(256)	(255)	1	–
A	149 USD	(202) CAD	25 octobre 2024	149	150	1	–
A	56 180 AUD	(38 241) USD	25 octobre 2024	51 715	52 540	825	–
A	17 673 AUD	(12 030) USD	25 octobre 2024	16 269	16 528	259	–
A	8 952 AUD	(6 033) USD	25 octobre 2024	8 159	8 372	213	–
A	6 481 AUD	(4 296) USD	25 octobre 2024	5 810	6 061	251	–
A	10 992 AUD	(7 202) USD	25 octobre 2024	9 739	10 279	540	–
A	1 137 AUD	(753) USD	25 octobre 2024	1 018	1 063	45	–
A	686 USD	(1 016) AUD	25 octobre 2024	(928)	(950)	–	(22)
A	65 AUD	(44) USD	25 octobre 2024	60	61	1	–
A	1 790 AUD	(1 205) USD	25 octobre 2024	1 629	1 674	45	–
A	475 USD	(713) AUD	25 octobre 2024	(642)	(667)	–	(25)
A	4 673 USD	(6 904) AUD	25 octobre 2024	(6 319)	(6 457)	–	(138)
A	2 107 USD	(3 067) AUD	25 octobre 2024	(2 850)	(2 868)	–	(18)
A	211 896 BRL	(38 386) USD	25 octobre 2024	51 912	52 428	516	–
A	90 072 BRL	(16 332) USD	25 octobre 2024	22 087	22 286	199	–
A	46 USD	(251) BRL	25 octobre 2024	(62)	(62)	–	–
A	7 297 BRL	(1 298) USD	25 octobre 2024	1 755	1 806	51	–
A	830 USD	(4 725) BRL	25 octobre 2024	(1 122)	(1 169)	–	(47)
A	7 673 USD	(42 455) BRL	25 octobre 2024	(10 376)	(10 504)	–	(128)
A	4 139 USD	(22 791) BRL	25 octobre 2024	(5 597)	(5 639)	–	(42)
A	9 139 BRL	(1 651) USD	25 octobre 2024	2 233	2 261	28	–
A	577 USD	(3 255) BRL	25 octobre 2024	(780)	(805)	–	(25)
A	2 102 USD	(11 899) BRL	25 octobre 2024	(2 843)	(2 944)	–	(101)
A	5 206 USD	(28 782) BRL	25 octobre 2024	(7 041)	(7 121)	–	(80)
A	1 988 USD	(10 900) BRL	25 octobre 2024	(2 688)	(2 697)	–	(9)
A	66 130 USD	(89 857) CAD	25 octobre 2024	66 478	66 007	–	(471)
A	67 287 USD	(91 429) CAD	25 octobre 2024	67 641	67 162	–	(479)
A	12 439 USD	(16 995) CAD	25 octobre 2024	12 573	12 391	–	(182)
A	3 004 USD	(4 127) CAD	25 octobre 2024	3 053	2 986	–	(67)
A	6 525 CAD	(4 724) USD	25 octobre 2024	(6 528)	(6 388)	140	–

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

Au 30 septembre 2024

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	12 489 CAD	(9 120) USD	25 octobre 2024	(12 495)	(12 332)	163	–
A	981 CAD	(722) USD	25 octobre 2024	(982)	(976)	6	–
A	8 072 CAD	(6 010) USD	25 octobre 2024	(8 076)	(8 127)	–	(51)
A	8 794 CAD	(6 515) USD	25 octobre 2024	(8 798)	(8 809)	–	(11)
A	10 144 CAD	(7 465) USD	25 octobre 2024	(10 149)	(10 096)	53	–
A	3 574 USD	(4 852) CAD	25 octobre 2024	3 590	3 569	–	(21)
A	2 998 USD	(4 038) CAD	25 octobre 2024	2 987	3 002	15	–
A	4 405 664 CLP	(4 829) USD	25 octobre 2024	6 531	6 628	97	–
A	8 486 563 CLP	(9 310) USD	25 octobre 2024	12 591	12 767	176	–
A	3 632 USD	(3 348 220) CLP	25 octobre 2024	(4 912)	(5 037)	–	(125)
A	1 653 651 CLP	(1 746) USD	25 octobre 2024	2 361	2 488	127	–
A	552 USD	(529 308) CLP	25 octobre 2024	(747)	(797)	–	(50)
A	1 226 USD	(1 145 624) CLP	25 octobre 2024	(1 658)	(1 724)	–	(66)
A	568 400 CLP	(617) USD	25 octobre 2024	835	855	20	–
A	356 760 CLP	(393) USD	25 octobre 2024	532	537	5	–
A	396 069 CLP	(421) USD	25 octobre 2024	569	596	27	–
A	2 148 879 CLP	(2 261) USD	25 octobre 2024	3 058	3 233	175	–
A	489 245 CLP	(526) USD	25 octobre 2024	711	736	25	–
A	1 739 955 CLP	(1 911) USD	25 octobre 2024	2 584	2 617	33	–
A	38 087 USD	(274 918) CNY	25 octobre 2024	(51 507)	(53 215)	–	(1 708)
A	21 446 USD	(154 805) CNY	25 octobre 2024	(29 003)	(29 965)	–	(962)
A	4 630 USD	(33 551) CNY	25 octobre 2024	(6 262)	(6 494)	–	(232)
A	842 USD	(6 103) CNY	25 octobre 2024	(1 139)	(1 181)	–	(42)
A	9 438 CNY	(1 308) USD	25 octobre 2024	1 769	1 827	58	–
A	39 272 CNY	(5 525) USD	25 octobre 2024	7 472	7 601	129	–
A	13 278 CNY	(1 877) USD	25 octobre 2024	2 538	2 570	32	–
A	7 899 CNY	(1 115) USD	25 octobre 2024	1 508	1 529	21	–
A	1 358 CNY	(192) USD	25 octobre 2024	260	263	3	–
A	3 909 CNY	(551) USD	25 octobre 2024	745	757	12	–
A	647 USD	(4 589) CNY	25 octobre 2024	(875)	(888)	–	(13)
A	739 CNY	(106) USD	25 octobre 2024	143	143	–	–
A	118 563 041 COP	(29 548) USD	25 octobre 2024	39 960	37 942	–	(2 018)
A	138 900 293 COP	(34 623) USD	25 octobre 2024	46 823	44 451	–	(2 372)
A	763 899 COP	(189) USD	25 octobre 2024	256	245	–	(11)
A	1 325 429 COP	(325) USD	25 octobre 2024	440	424	–	(16)
A	3 525 USD	(14 583 263) COP	25 octobre 2024	(4 767)	(4 667)	100	–
A	4 254 USD	(17 391 773) COP	25 octobre 2024	(5 753)	(5 565)	188	–
A	759 USD	(3 074 903) COP	25 octobre 2024	(1 027)	(984)	43	–
A	1 583 USD	(6 458 940) COP	25 octobre 2024	(2 141)	(2 068)	73	–
A	2 391 USD	(10 073 040) COP	25 octobre 2024	(3 234)	(3 223)	11	–
A	2 820 USD	(12 183 016) COP	25 octobre 2024	(3 813)	(3 899)	–	(86)
A	912 USD	(3 886 088) COP	25 octobre 2024	(1 233)	(1 244)	–	(11)
A	371 USD	(1 541 962) COP	25 octobre 2024	(502)	(493)	9	–
A	245 180 CZK	(10 588) USD	25 octobre 2024	14 319	14 647	328	–
A	12 492 USD	(289 255) CZK	25 octobre 2024	(16 894)	(17 281)	–	(387)
A	72 322 CZK	(3 114) USD	25 octobre 2024	4 211	4 321	110	–
A	53 340 CZK	(2 283) USD	25 octobre 2024	3 088	3 187	99	–
A	128 543 CZK	(5 476) USD	25 octobre 2024	7 406	7 680	274	–
A	25 325 CZK	(1 103) USD	25 octobre 2024	1 492	1 513	21	–
A	49 066 CZK	(2 171) USD	25 octobre 2024	2 936	2 932	–	(4)
A	3 669 USD	(82 114) CZK	25 octobre 2024	(4 962)	(4 905)	57	–

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

Au 30 septembre 2024

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	20 872 CZK	(925) USD	25 octobre 2024	1 251	1 247	–	(4)
A	71 723 CZK	(3 154) USD	25 octobre 2024	4 265	4 285	20	–
A	26 466 CZK	(1 174) USD	25 octobre 2024	1 588	1 581	–	(7)
A	6 445 CZK	(286) USD	25 octobre 2024	387	385	–	(2)
A	28 719 EUR	(31 478) USD	25 octobre 2024	42 570	43 283	713	–
A	16 164 EUR	(17 717) USD	25 octobre 2024	23 960	24 362	402	–
A	11 654 EUR	(12 737) USD	25 octobre 2024	17 225	17 565	340	–
A	2 137 EUR	(2 327) USD	25 octobre 2024	3 147	3 220	73	–
A	1 554 USD	(1 433) EUR	25 octobre 2024	(2 102)	(2 160)	–	(58)
A	4 745 USD	(4 317) EUR	25 octobre 2024	(6 417)	(6 507)	–	(90)
A	6 030 USD	(5 411) EUR	25 octobre 2024	(8 155)	(8 155)	–	–
A	2 371 USD	(2 118) EUR	25 octobre 2024	(3 206)	(3 191)	15	–
A	4 596 USD	(4 140) EUR	25 octobre 2024	(6 216)	(6 240)	–	(24)
A	4 754 USD	(4 307) EUR	25 octobre 2024	(6 429)	(6 490)	–	(61)
A	1 008 USD	(904) EUR	25 octobre 2024	(1 363)	(1 363)	–	–
A	1 492 USD	(1 337) EUR	25 octobre 2024	(2 018)	(2 015)	3	–
A	8 585 GBP	(11 159) USD	25 octobre 2024	15 091	15 523	432	–
A	7 635 GBP	(9 923) USD	25 octobre 2024	13 420	13 804	384	–
A	2 162 GBP	(2 800) USD	25 octobre 2024	3 787	3 908	121	–
A	4 752 USD	(3 680) GBP	25 octobre 2024	(6 427)	(6 653)	–	(226)
A	77 USD	(60) GBP	25 octobre 2024	(104)	(108)	–	(4)
A	6 372 GBP	(8 177) USD	25 octobre 2024	11 058	11 522	464	–
A	3 019 GBP	(3 936) USD	25 octobre 2024	5 323	5 459	136	–
A	3 487 GBP	(4 617) USD	25 octobre 2024	6 244	6 305	61	–
A	3 435 GBP	(4 522) USD	25 octobre 2024	6 115	6 212	97	–
A	1 809 GBP	(2 363) USD	25 octobre 2024	3 196	3 272	76	–
A	692 GBP	(912) USD	25 octobre 2024	1 234	1 251	17	–
A	2 379 USD	(1 777) GBP	25 octobre 2024	(3 217)	(3 213)	4	–
A	129 259 717 IDR	(8 012) USD	25 octobre 2024	10 835	11 488	653	–
A	410 USD	(6 642 159) IDR	25 octobre 2024	(554)	(590)	–	(36)
A	11 259 499 IDR	(693) USD	25 octobre 2024	937	1 001	64	–
A	52 862 640 IDR	(3 231) USD	25 octobre 2024	4 369	4 698	329	–
A	1 940 USD	(30 770 965) IDR	25 octobre 2024	(2 623)	(2 735)	–	(112)
A	18 575 496 IDR	(1 202) USD	25 octobre 2024	1 626	1 651	25	–
A	6 035 675 IDR	(388) USD	25 octobre 2024	525	536	11	–
A	41 463 830 IDR	(2 689) USD	25 octobre 2024	3 636	3 685	49	–
A	28 968 196 IDR	(1 872) USD	25 octobre 2024	2 531	2 574	43	–
A	90 730 555 IDR	(5 903) USD	25 octobre 2024	7 983	8 064	81	–
A	7 211 241 IDR	(475) USD	25 octobre 2024	643	641	–	(2)
A	20 665 USD	(74 345) ILS	25 octobre 2024	(27 947)	(26 996)	951	–
A	30 607 USD	(110 109) ILS	25 octobre 2024	(41 391)	(39 982)	1 409	–
A	8 066 USD	(29 119) ILS	25 octobre 2024	(10 908)	(10 573)	335	–
A	3 001 USD	(10 843) ILS	25 octobre 2024	(4 059)	(3 937)	122	–
A	2 321 USD	(8 663) ILS	25 octobre 2024	(3 139)	(3 145)	–	(6)
A	11 144 ILS	(3 007) USD	25 octobre 2024	4 066	4 046	–	(20)
A	603 USD	(2 224) ILS	25 octobre 2024	(816)	(808)	8	–
A	10 670 ILS	(2 905) USD	25 octobre 2024	3 929	3 875	–	(54)
A	3 503 ILS	(946) USD	25 octobre 2024	1 280	1 272	–	(8)
A	6 682 ILS	(1 781) USD	25 octobre 2024	2 409	2 426	17	–
A	1 589 USD	(6 003) ILS	25 octobre 2024	(2 149)	(2 180)	–	(31)
A	5 307 ILS	(1 415) USD	25 octobre 2024	1 913	1 927	14	–

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

Au 30 septembre 2024

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	381 268 INR	(4 553) USD	25 octobre 2024	6 157	6 146	–	(11)
A	284 892 INR	(3 401) USD	25 octobre 2024	4 599	4 592	–	(7)
A	21 428 INR	(256) USD	25 octobre 2024	346	346	–	–
A	69 USD	(5 749) INR	25 octobre 2024	(93)	(93)	–	–
A	308 USD	(25 807) INR	25 octobre 2024	(416)	(416)	–	–
A	560 USD	(47 115) INR	25 octobre 2024	(757)	(759)	–	(2)
A	260 USD	(21 780) INR	25 octobre 2024	(351)	(351)	–	–
A	120 035 INR	(1 428) USD	25 octobre 2024	1 931	1 934	3	–
A	80 657 INR	(959) USD	25 octobre 2024	1 297	1 300	3	–
A	57 110 INR	(679) USD	25 octobre 2024	918	920	2	–
A	64 478 INR	(769) USD	25 octobre 2024	1 040	1 040	–	–
A	81 723 INR	(976) USD	25 octobre 2024	1 320	1 317	–	(3)
A	4 315 USD	(670 541) JPY	25 octobre 2024	(5 835)	(6 333)	–	(498)
A	5 881 420 JPY	(37 848) USD	25 octobre 2024	51 184	55 556	4 372	–
A	4 840 USD	(756 492) JPY	25 octobre 2024	(6 546)	(7 146)	–	(600)
A	6 915 USD	(1 064 198) JPY	25 octobre 2024	(9 352)	(10 052)	–	(700)
A	22 084 USD	(3 371 931) JPY	25 octobre 2024	(29 866)	(31 852)	–	(1 986)
A	18 340 USD	(2 668 546) JPY	25 octobre 2024	(24 802)	(25 207)	–	(405)
A	6 012 USD	(867 346) JPY	25 octobre 2024	(8 131)	(8 193)	–	(62)
A	839 USD	(119 956) JPY	25 octobre 2024	(1 134)	(1 133)	1	–
A	3 788 304 JPY	(26 478) USD	25 octobre 2024	35 808	35 784	–	(24)
A	87 867 JPY	(614) USD	25 octobre 2024	831	830	–	(1)
A	4 633 USD	(657 076) JPY	25 octobre 2024	(6 265)	(6 207)	58	–
A	1 998 USD	(281 742) JPY	25 octobre 2024	(2 702)	(2 661)	41	–
A	630 202 JPY	(4 404) USD	25 octobre 2024	5 956	5 953	–	(3)
A	11 196 USD	(15 313 650) KOR	25 octobre 2024	(15 141)	(15 729)	–	(588)
A	16 820 USD	(22 997 877) KOR	25 octobre 2024	(22 747)	(23 622)	–	(875)
A	4 640 USD	(6 396 742) KOR	25 octobre 2024	(6 275)	(6 570)	–	(295)
A	2 474 USD	(3 411 140) KOR	25 octobre 2024	(3 346)	(3 504)	–	(158)
A	4 707 USD	(6 489 494) KOR	25 octobre 2024	(6 366)	(6 665)	–	(299)
A	3 290 USD	(4 483 411) KOR	25 octobre 2024	(4 449)	(4 605)	–	(156)
A	1 371 USD	(1 818 827) KOR	25 octobre 2024	(1 854)	(1 868)	–	(14)
A	752 USD	(997 357) KOR	25 octobre 2024	(1 017)	(1 024)	–	(7)
A	1 032 243 KOR	(775) USD	25 octobre 2024	1 048	1 061	13	–
A	3 210 363 KOR	(2 396) USD	25 octobre 2024	3 240	3 297	57	–
A	8 527 341 KOR	(6 457) USD	25 octobre 2024	8 732	8 758	26	–
A	9 065 427 KOR	(6 832) USD	25 octobre 2024	9 239	9 311	72	–
A	199 427 MXN	(11 093) USD	25 octobre 2024	15 002	13 645	–	(1 357)
A	11 040 MXN	(614) USD	25 octobre 2024	830	755	–	(75)
A	79 416 MXN	(4 419) USD	25 octobre 2024	5 976	5 433	–	(543)
A	38 560 MXN	(2 100) USD	25 octobre 2024	2 840	2 638	–	(202)
A	56 635 MXN	(2 981) USD	25 octobre 2024	4 032	3 875	–	(157)
A	1 508 USD	(29 033) MXN	25 octobre 2024	(2 040)	(1 986)	54	–
A	4 553 USD	(86 929) MXN	25 octobre 2024	(6 157)	(5 948)	209	–
A	80 USD	(1 582) MXN	25 octobre 2024	(108)	(108)	–	–
A	25 986 USD	(516 399) MXN	25 octobre 2024	(35 143)	(35 330)	–	(187)
A	30 USD	(615) MXN	25 octobre 2024	(41)	(42)	–	(1)
A	8 158 MXN	(404) USD	25 octobre 2024	546	558	12	–
A	8 791 USD	(170 512) MXN	25 octobre 2024	(11 889)	(11 665)	224	–
A	3 518 USD	(68 259) MXN	25 octobre 2024	(4 757)	(4 670)	87	–
A	23 773 NOK	(2 221) USD	25 octobre 2024	3 004	3 048	44	–

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

Au 30 septembre 2024

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	118 312 NOK	(11 054) USD	25 octobre 2024	14 949	15 165	216	–
A	16 401 NOK	(1 517) USD	25 octobre 2024	2 051	2 102	51	–
A	25 266 NOK	(2 293) USD	25 octobre 2024	3 101	3 238	137	–
A	158 USD	(1 722) NOK	25 octobre 2024	(213)	(221)	–	(8)
A	93 140 NOK	(8 659) USD	25 octobre 2024	11 710	11 939	229	–
A	74 065 NOK	(7 054) USD	25 octobre 2024	9 540	9 493	–	(47)
A	48 559 NOK	(4 637) USD	25 octobre 2024	6 271	6 224	–	(47)
A	217 USD	(2 305) NOK	25 octobre 2024	(293)	(296)	–	(3)
A	1 001 NOK	(92) USD	25 octobre 2024	125	128	3	–
A	16 912 NOK	(1 598) USD	25 octobre 2024	2 161	2 168	7	–
A	26 563 NOK	(2 548) USD	25 octobre 2024	3 446	3 405	–	(41)
A	22 395 USD	(36 583) NZD	25 octobre 2024	(30 286)	(31 428)	–	(1 142)
A	7 459 USD	(12 185) NZD	25 octobre 2024	(10 087)	(10 467)	–	(380)
A	4 830 USD	(7 994) NZD	25 octobre 2024	(6 532)	(6 867)	–	(335)
A	158 USD	(264) NZD	25 octobre 2024	(213)	(227)	–	(14)
A	416 USD	(705) NZD	25 octobre 2024	(563)	(606)	–	(43)
A	1 559 USD	(2 574) NZD	25 octobre 2024	(2 108)	(2 211)	–	(103)
A	639 NZD	(393) USD	25 octobre 2024	531	548	17	–
A	5 638 USD	(9 045) NZD	25 octobre 2024	(7 625)	(7 771)	–	(146)
A	1 676 USD	(2 702) NZD	25 octobre 2024	(2 267)	(2 321)	–	(54)
A	6 192 NZD	(3 808) USD	25 octobre 2024	5 150	5 319	169	–
A	12 529 NZD	(7 758) USD	25 octobre 2024	10 492	10 763	271	–
A	2 740 NZD	(1 733) USD	25 octobre 2024	2 343	2 354	11	–
A	54 182 USD	(3 166 616) PHP	25 octobre 2024	(73 273)	(76 295)	–	(3 022)
A	61 419 USD	(3 589 345) PHP	25 octobre 2024	(83 061)	(86 480)	–	(3 419)
A	7 231 USD	(422 702) PHP	25 octobre 2024	(9 779)	(10 184)	–	(405)
A	4 077 USD	(238 705) PHP	25 octobre 2024	(5 513)	(5 751)	–	(238)
A	214 681 PHP	(3 659) USD	25 octobre 2024	4 948	5 172	224	–
A	344 437 PHP	(6 036) USD	25 octobre 2024	8 163	8 299	136	–
A	403 721 PHP	(7 154) USD	25 octobre 2024	9 675	9 727	52	–
A	195 269 PHP	(3 467) USD	25 octobre 2024	4 688	4 704	16	–
A	208 061 PHP	(3 709) USD	25 octobre 2024	5 016	5 012	–	(4)
A	78 USD	(4 380) PHP	25 octobre 2024	(105)	(105)	–	–
A	106 798 PHP	(1 915) USD	25 octobre 2024	2 590	2 573	–	(17)
A	4 940 USD	(276 730) PHP	25 octobre 2024	(6 680)	(6 667)	13	–
A	102 526 PLN	(26 248) USD	25 octobre 2024	35 497	36 000	503	–
A	103 274 PLN	(26 446) USD	25 octobre 2024	35 765	36 263	498	–
A	1 227 USD	(4 835) PLN	25 octobre 2024	(1 659)	(1 698)	–	(39)
A	215 USD	(851) PLN	25 octobre 2024	(291)	(299)	–	(8)
A	483 USD	(1 917) PLN	25 octobre 2024	(653)	(674)	–	(21)
A	12 038 PLN	(3 072) USD	25 octobre 2024	4 155	4 227	72	–
A	14 007 PLN	(3 637) USD	25 octobre 2024	4 919	4 918	–	(1)
A	17 557 PLN	(4 569) USD	25 octobre 2024	6 179	6 165	–	(14)
A	11 759 PLN	(3 041) USD	25 octobre 2024	4 113	4 129	16	–
A	8 968 PLN	(2 306) USD	25 octobre 2024	3 118	3 149	31	–
A	4 380 PLN	(1 140) USD	25 octobre 2024	1 542	1 538	–	(4)
A	2 305 PLN	(603) USD	25 octobre 2024	815	809	–	(6)
A	77 616 SEK	(7 415) USD	25 octobre 2024	10 028	10 349	321	–
A	336 082 SEK	(32 111) USD	25 octobre 2024	43 425	44 810	1 385	–
A	29 527 SEK	(2 795) USD	25 octobre 2024	3 780	3 937	157	–
A	25 255 SEK	(2 356) USD	25 octobre 2024	3 186	3 368	182	–

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

Au 30 septembre 2024

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	21 921 SEK	(2 040) USD	25 octobre 2024	2 759	2 922	163	–
A	5 387 USD	(56 388) SEK	25 octobre 2024	(7 285)	(7 518)	–	(233)
A	2 536 USD	(25 881) SEK	25 octobre 2024	(3 430)	(3 450)	–	(20)
A	6 103 USD	(61 952) SEK	25 octobre 2024	(8 254)	(8 260)	–	(6)
A	3 577 USD	(36 728) SEK	25 octobre 2024	(4 838)	(4 897)	–	(59)
A	3 566 USD	(37 002) SEK	25 octobre 2024	(4 823)	(4 933)	–	(110)
A	26 217 SEK	(2 579) USD	25 octobre 2024	3 488	3 496	8	–
A	4 092 SEK	(404) USD	25 octobre 2024	547	545	–	(2)
A	1 173 212 THB	(32 689) USD	25 octobre 2024	44 207	49 044	4 837	–
A	42 317 USD	(1 520 346) THB	25 octobre 2024	(57 227)	(63 554)	–	(6 327)
A	239 358 THB	(6 679) USD	25 octobre 2024	9 033	10 005	972	–
A	277 287 THB	(7 715) USD	25 octobre 2024	10 434	11 591	1 157	–
A	194 133 THB	(5 431) USD	25 octobre 2024	7 345	8 115	770	–
A	90 472 THB	(2 597) USD	25 octobre 2024	3 512	3 781	269	–
A	1 062 USD	(36 087) THB	25 octobre 2024	(1 436)	(1 508)	–	(72)
A	5 836 USD	(197 764) THB	25 octobre 2024	(7 893)	(8 266)	–	(373)
A	3 458 USD	(115 903) THB	25 octobre 2024	(4 676)	(4 845)	–	(169)
A	606 USD	(20 363) THB	25 octobre 2024	(819)	(851)	–	(32)
A	288 160 THB	(8 661) USD	25 octobre 2024	11 713	12 045	332	–
A	229 334 THB	(7 026) USD	25 octobre 2024	9 502	9 586	84	–
A	384 516 TRL	(10 468) USD	25 octobre 2024	14 156	14 801	645	–
A	21 672 TRL	(588) USD	25 octobre 2024	795	835	40	–
A	13 039 TRL	(360) USD	25 octobre 2024	487	501	14	–
A	3 814 TRL	(105) USD	25 octobre 2024	142	147	5	–
A	3 286 TRL	(90) USD	25 octobre 2024	122	126	4	–
A	3 801 TRL	(104) USD	25 octobre 2024	141	146	5	–
A	5 935 USD	(215 607) TRL	25 octobre 2024	(8 026)	(8 299)	–	(273)
A	43 USD	(1 533) TRL	25 octobre 2024	(58)	(59)	–	(1)
A	41 USD	(1 494) TRL	25 octobre 2024	(56)	(57)	–	(1)
A	566 TRL	(16) USD	25 octobre 2024	22	22	–	–
A	286 TRL	(8) USD	25 octobre 2024	11	11	–	–
A	57 306 ZAR	(3 163) USD	25 octobre 2024	4 277	4 476	199	–
A	1 100 504 ZAR	(60 722) USD	25 octobre 2024	82 118	85 948	3 830	–
A	101 656 ZAR	(5 578) USD	25 octobre 2024	7 544	7 939	395	–
A	34 481 ZAR	(1 860) USD	25 octobre 2024	2 516	2 693	177	–
A	26 129 ZAR	(1 415) USD	25 octobre 2024	1 914	2 040	126	–
A	100 314 ZAR	(5 496) USD	25 octobre 2024	7 433	7 834	401	–
A	61 046 ZAR	(3 399) USD	25 octobre 2024	4 596	4 768	172	–
A	771 USD	(13 742) ZAR	25 octobre 2024	(1 043)	(1 073)	–	(30)
A	1 041 USD	(18 516) ZAR	25 octobre 2024	(1 408)	(1 446)	–	(38)
A	2 541 USD	(45 700) ZAR	25 octobre 2024	(3 436)	(3 570)	–	(134)
A	34 716 ZAR	(1 963) USD	25 octobre 2024	2 654	2 711	57	–
A	2 659 USD	(46 183) ZAR	25 octobre 2024	(3 596)	(3 607)	–	(11)
Total des contrats de change à terme de gré à gré						49 230	(48 884)
Total des actifs dérivés							58 315
Total des passifs dérivés							(59 134)

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.

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 MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

NOTES ANNEXES

3. Méthodes comptables significatives (suite)

b) Évaluation de la juste valeur (suite)

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

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

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

c) Comptabilisation des revenus et des charges

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

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

d) Commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille

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

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

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

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

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

f) Compensation

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

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

g) Devise

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

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

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

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

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

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

NOTES ANNEXES

3. Méthodes comptables significatives (suite)

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.

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

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

k) Fusions

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

l) Frais de vente à découvert et d'emprunt

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

m) Modifications comptables futures

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

4. Estimations et jugements comptables critiques

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

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

Utilisation d'estimations

Juste valeur des titres non cotés sur un marché actif

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

Utilisation de jugements

Classement et évaluation des placements

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

Monnaie fonctionnelle

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

Intérêts dans des entités structurées non consolidées

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

- I. les droits de vote dans les Fonds sous-jacents ne sont pas des facteurs dominants pour décider qui les contrôle;
- II. les activités des Fonds sous-jacents sont assujétiées à des restrictions aux termes de leurs documents de placement;

NOTES ANNEXES

4. Estimations et jugements comptables critiques (suite)

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

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

6. Frais de gestion et frais d'exploitation

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

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

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

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

7. Capital du Fonds

Le capital du Fonds, qui comprend l'actif net attribuable aux porteurs de titres, est réparti entre les différentes séries, lesquelles comportent chacune un nombre illimité de titres. Les titres en circulation du Fonds aux 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.

NOTES ANNEXES

8. Risques découlant des instruments financiers (suite)

ii. Risque de liquidité (suite)

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.

iv. Risque de taux d'intérêt

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

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

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

v. Autre risque de prix

L'autre risque de prix est le risque que la valeur des instruments financiers fluctue en fonction des variations des cours du marché (autres que celles découlant du risque de taux d'intérêt ou du risque de change), que ces variations découlent de facteurs propres à un placement individuel ou à son émetteur, ou d'autres facteurs ayant une incidence sur tous les instruments négociés sur un marché ou un segment du marché. Tous les placements présentent un risque de perte en capital. Ce risque est géré grâce à une sélection minutieuse de placements et d'autres instruments financiers conformes aux stratégies de placement. À l'exception de certains contrats dérivés et titres vendus à découvert, le risque maximal découlant des instruments financiers équivaut à leur juste valeur. Le risque maximal de perte sur certains contrats dérivés, comme des contrats à terme de gré à gré, des swaps ou des contrats à terme standardisés équivaut à leurs montants notionnels. Dans le cas d'options d'achat (de vente) et de positions vendeur sur contrats à terme standardisés, la perte pour le Fonds continue d'augmenter, théoriquement sans limite, au fur et à mesure que la juste valeur de l'élément sous-jacent augmente (diminue). Toutefois, ces instruments sont généralement utilisés dans le cadre du processus global de gestion des placements afin de gérer le risque provenant des placements sous-jacents et n'augmentent généralement pas le risque de perte global du Fonds. Pour atténuer ce risque, le Fonds s'assure de détenir à la fois l'élément sous-jacent, la couverture en espèces ou la marge, dont la valeur équivaut à celle du contrat dérivé ou lui est supérieure. Dans le cas de titres vendus à découvert, la perte pour le Fonds continue d'augmenter, sans limite, au fur et à mesure que la juste valeur de l'élément sous-jacent augmente. Ce risque est atténué au moyen de restrictions quant à la capacité du Fonds de vendre des titres à découvert. Ces restrictions sont décrites à la note 3 I).

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

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

vi. Risque de crédit

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

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

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

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

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

NOTES ANNEXES

8. Risques découlant des instruments financiers (suite)

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.

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 MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

NOTES ANNEXES

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

a) Constitution du Fonds et renseignements sur les séries

Date de constitution : 31 janvier 2019

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 de série A sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$.

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

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

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

Les titres de série O sont offerts seulement aux investisseurs qui investissent un minimum de 500 000 \$ et qui ont un compte auprès de Conseils Patrimoine privé Mackenzie; ils sont également proposés à certains investisseurs institutionnels, à certains investisseurs d'un régime collectif admissible et à certains employés admissibles de Mackenzie et de ses filiales.

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

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

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

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

Chaque série est offerte selon le mode de souscription avec frais d'acquisition. Les frais du mode de souscription avec frais d'acquisition sont négociés entre l'investisseur et son courtier. Pour de plus amples renseignements sur ce mode de souscription, veuillez vous reporter au prospectus simplifié du Fonds et à l'aperçu du Fonds.

Série	Date d'établissement/ de rétablissement	Frais de gestion	Frais d'administration
Série A	26 février 2019	2,10 %	0,28 %
Série F	26 février 2019	1,00 %	0,15 %
Série FB	26 février 2019	1,10 %	0,28 %
Série IG	6 mars 2020	s.o.	s.o.
Série O	26 février 2019	— ¹⁾	s.o.
Série PW	26 février 2019	2,00 %	0,15 %
Série PWFB	26 février 2019	1,00 %	0,15 %
Série PWX	26 février 2019	— ²⁾	— ²⁾
Série R	26 février 2019	s.o.	s.o.

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.

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

NOTES ANNEXES

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

b) Reports prospectifs de pertes fiscales

Total de la perte en capital \$	Total de la perte autre qu'en capital \$	Date d'échéance des pertes autres qu'en capital														
		2030 \$	2031 \$	2032 \$	2033 \$	2034 \$	2035 \$	2036 \$	2037 \$	2038 \$	2039 \$	2040 \$	2041 \$	2042 \$	2043 \$	
1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	

c) Prêt de titres

	30 septembre 2024		31 mars 2024	
	(\$)		(\$)	
Valeur des titres prêtés		3 725		2 424
Valeur des biens reçus en garantie		3 917		2 547

	30 septembre 2024		30 septembre 2023	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
Revenus de prêts de titres bruts	34	100,0	22	100,0
Impôt retenu à la source	(1)	(2,9)	(5)	(22,7)
	33	97,1	17	77,3
Paiements à l'agent de prêt de titres	(6)	(17,6)	(3)	(13,6)
Revenu tiré du prêt de titres	27	79,5	14	63,7

d) Commissions

	(\$)
30 septembre 2024	7
30 septembre 2023	4

e) Risques découlant des instruments financiers

i. Exposition au risque et gestion du risque

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

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS 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)

ii. Risque de change

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

Devise	30 septembre 2024				Incidence sur l'actif net			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Renforcement de 5 %		Affaiblissement de 5 %	
					(\$)	%	(\$)	%
ZAR	–	2 578	134 566	137 144				
PLN	–	(1 098)	116 373	115 275				
AUD	–	(66)	104 815	104 749				
COP	–	–	75 012	75 012				
GBP	–	(91)	70 528	70 437				
NOK	–	–	69 401	69 401				
EUR	–	(410)	65 375	64 965				
BRL	–	–	58 919	58 919				
SEK	–	(168)	50 043	49 875				
IDR	–	–	38 170	38 170				
CLP	–	–	28 185	28 185				
THB	–	(3 513)	31 353	27 840				
CZK	–	–	24 106	24 106				
INR	–	–	19 666	19 666				
TRL	–	–	8 174	8 174				
CHF	–	1 000	(124)	876				
SGD	–	299	149	448				
JPY	–	(423)	(8 230)	(8 653)				
MXN	–	(3 142)	(32 466)	(35 608)				
KOR	–	–	(50 707)	(50 707)				
NZD	–	–	(52 854)	(52 854)				
ILS	–	–	(91 205)	(91 205)				
CNY	–	–	(94 869)	(94 869)				
PHP	–	–	(184 677)	(184 677)				
USD	19 310	32 993	(255 443)	(203 140)				
Total	19 310	27 959	124 260	171 529				
% de l'actif net	2,8	4,1	18,2	25,1				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					(8 576)	(1,3)	8 576	1,3

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

NOTES ANNEXES

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

e) Risques découlant des instruments financiers (suite)

ii. Risque de change (suite)

Devise	31 mars 2024				Incidence sur l'actif net			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Renforcement de 5 %		Affaiblissement de 5 %	
					(\$)	%	(\$)	%
ZAR	–	812	144 292	145 104				
COP	–	–	140 200	140 200				
JPY	–	69	131 631	131 700				
BRL	–	–	123 449	123 449				
IDR	–	–	109 232	109 232				
MXN	–	(655)	54 721	54 066				
PLN	–	(13)	37 476	37 463				
CLP	–	–	35 407	35 407				
SEK	–	(73)	26 974	26 901				
INR	–	–	23 414	23 414				
EUR	–	133	12 152	12 285				
GBP	–	(55)	7 684	7 629				
SGD	–	1 176	8	1 184				
CHF	–	(355)	133	(222)				
AUD	–	237	(5 649)	(5 412)				
NOK	–	–	(19 470)	(19 470)				
NZD	–	–	(26 095)	(26 095)				
KOR	–	–	(53 281)	(53 281)				
ILS	–	–	(64 146)	(64 146)				
CZK	–	–	(72 936)	(72 936)				
USD	34 257	16 007	(160 509)	(110 245)				
PHP	–	–	(117 183)	(117 183)				
CNY	–	–	(117 446)	(117 446)				
THB	–	64	(121 041)	(120 977)				
Total	34 257	17 347	89 017	140 621				
% de l'actif net	5,2	2,6	13,4	21,2				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					(7 031)	(1,1)	7 031	1,1

* Comprend les instruments financiers monétaires et non monétaires.

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

NOTES ANNEXES

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

e) Risques découlant des instruments financiers (suite)

iii. Risque de taux d'intérêt

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

30 septembre 2024	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
		Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
		(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	107 325				
1 an à 5 ans	–				
5 ans à 10 ans	–				
Plus de 10 ans	–				
Total	107 325				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt		(4 976)	(0,7)	4 976	0,7

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

iv. Autre risque de prix

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

v. Risque de crédit

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

f) Classement de la juste valeur

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

	30 septembre 2024				31 mars 2024			
	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Options	5 701	4 681	–	10 382	–	7 290	–	7 290
Fonds/billets négociés en bourse	8 928	–	–	8 928	26 967	–	–	26 967
Fonds communs de placement	–	–	–	–	6 858	–	–	6 858
Actifs dérivés	9 085	49 230	–	58 315	7 809	30 476	–	38 285
Passifs dérivés	(10 164)	(48 970)	–	(59 134)	(7 358)	(26 612)	–	(33 970)
Placements à court terme	567 098	14 653	–	581 751	525 525	39 123	–	564 648
Total	580 648	19 594	–	600 242	559 801	50 277	–	610 078

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

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

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

NOTES ANNEXES

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

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	23	23
Autres fonds gérés par le gestionnaire	180 556	194 819
Fonds gérés par des sociétés affiliées au gestionnaire	457 508	426 146

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	58 315	(56 107)	–	2 208
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(59 134)	56 107	60 365	57 338
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	(819)	–	60 365	59 546

	31 mars 2024			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	38 285	(32 693)	–	5 592
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(33 970)	32 693	48 254	46 977
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	4 315	–	48 254	52 569

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 (\$)
iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF	0,0	2 445
iShares TIPS Bond ETF	0,0	3 600
SPDR Bloomberg High Yield Bond ETF	0,0	2 883

31 mars 2024	% de l'actif net du Fonds sous-jacent	Juste valeur des placements du Fonds (\$)
iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF	0,0	2 286
iShares TIPS Bond ETF	0,0	3 840
Fonds de lingots d'or Mackenzie, série R	2,7	6 858
SPDR Bloomberg High Yield Bond ETF	0,0	5 041
SPDR S&P Oil & Gas Exploration & Production ETF	0,3	15 800

FONDS MONDIAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

NOTES ANNEXES

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

j) Effet de levier

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

Au cours de la période de six mois close le 30 septembre 2024, l'exposition globale du Fonds aux sources de levier a varié entre 190 % et 260 % de la valeur liquidative du Fonds. Le haut de la fourchette a été atteint en avril 2024, lorsque l'équipe de gestion de portefeuille a ajouté des contrats à terme standardisés en position acheteur sur obligations gouvernementales à deux ans en prévision des réductions de taux d'intérêt. Le bas de la fourchette a été atteint en juillet 2024, quand les contrats à terme standardisés en position acheteur sur obligations gouvernementales à deux ans ont été fermés pour cadrer avec les attentes du marché concernant les réductions de taux d'intérêt. Les sources de levier étaient des positions acheteur et vendeur sur contrats à terme standardisés, des options achetées, des swaps et des contrats de change à terme de gré à gré. Incluant la valeur notionnelle des dérivés utilisés aux fins de couverture, les montants de levier minimaux et maximaux ont varié entre 422 % et 551 %.

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

k) Événement postérieur

Le 31 mai 2024, les investisseurs du Fonds multistratégie à rendement absolu Mackenzie ont voté en faveur de la fusion proposée du fonds avec le Fonds. Cette fusion a été réalisée le 11 octobre 2024, et 57 309 \$ ont été injectés dans le Fonds. Le gestionnaire ne croit pas que cette fusion signifie des changements importants pour les investisseurs du Fonds.

l) Placements donnés en garantie

Au 30 septembre 2024, 13 461 \$ (654 \$ au 31 mars 2024) ont été reçus en garantie de Morgan Stanley et de J.P. Morgan en contrepartie de contrats à terme de gré à gré.