

## **États financiers intermédiaires non audités**

*Pour la période de six mois close le 30 septembre 2023*

*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 l'adresse [www.sedarplus.ca](http://www.sedarplus.ca). Des exemplaires des états financiers annuels ou du RDRF annuel peuvent aussi être obtenus gratuitement des façons décrites ci-dessus.*

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

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

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

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



# FONDS ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

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

	30 sept. 2023	31 mars 2023 (Audité)	Actif net attribuable aux porteurs de titres (note 3)				
			par titre		par série		
			30 sept. 2023	31 mars 2023 (Audité)	30 sept. 2023	31 mars 2023 (Audité)	
<b>ACTIF</b>	\$	\$					
<b>Actifs courants</b>			Série A	12,50	12,84	1 404 765	1 478 935
Placements à la juste valeur	5 220 137	5 172 302	Série AR	12,22	12,56	93 164	91 298
Trésorerie et équivalents de trésorerie	11 350	233 278	Série D	14,59	14,99	50 502	47 102
Intérêts courus à recevoir	16 212	13 846	Série F	13,03	13,38	1 330 048	1 347 543
Dividendes à recevoir	5 122	5 053	Série F5	13,31	13,91	67 333	68 429
Sommes à recevoir pour placements vendus	43 064	12 594	Série F8	11,06	11,74	16 806	17 347
Sommes à recevoir pour titres émis	4 275	4 763	Série FB	12,12	12,44	3 790	3 899
Sommes à recevoir du gestionnaire	1 078	44	Série FB5	14,33	15,00	73	6
Marge sur instruments dérivés	7 322	10 540	Série G	16,93	17,39	303	330
Actifs dérivés	5 126	2 134	Série I	11,62	11,98	5 022	5 336
Impôt à recouvrer	101	101	Série O	26,36	27,07	201 712	205 136
<b>Total de l'actif</b>	<b>5 313 787</b>	<b>5 454 655</b>	Série O5	14,83	15,43	11	10 055
			Série PW	15,10	15,51	1 664 842	1 712 842
<b>PASSIF</b>			Série PWFB	12,44	12,77	50 218	52 421
<b>Passifs courants</b>			Série PWFB5	14,54	15,19	312	325
Sommes à payer pour placements achetés	50 516	13 066	Série PWR	10,99	11,29	39 794	36 437
Sommes à payer pour titres rachetés	5 540	4 603	Série PWT5	12,75	13,41	79 248	89 952
Sommes à payer au gestionnaire	244	254	Série PWT8	9,61	10,26	31 029	34 398
Passifs dérivés	13 331	7 147	Série PWX	15,82	16,24	13 792	15 056
<b>Total du passif</b>	<b>69 631</b>	<b>25 070</b>	Série PWX8	11,50	12,14	378	401
<b>Actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>5 244 156</b>	<b>5 429 585</b>	Série R	19,96	20,50	7 247	7 874
			Série S	11,83	12,15	18 757	20 771
			Série T5	9,10	9,58	54 253	60 396
			Série T8	5,07	5,42	16 128	19 688
			Série Investisseur	11,21	11,51	37 856	45 338
			Série-B	11,84	12,16	3 684	3 952
			Série Conseiller	11,04	11,35	111	114
			Série LB	10,98	11,28	7 111	7 054
			Série LF	12,16	12,49	21 583	21 810
			Série LF5	14,67	15,34	719	671
			Série LW	11,13	11,43	22 830	23 785
			Série LW5	12,77	13,43	636	749
			Série LX	12,62	13,29	99	135
						<b>5 244 156</b>	<b>5 429 585</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

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

	2023		2022		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation (note 3)			
	\$		\$		par titre		par série	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>Revenus</b>								
Dividendes	25 935	28 988						
Revenus d'intérêts aux fins de distribution	39 471	29 925						
Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets								
Profit (perte) net(te) réalisé(e)	46 123	(20 842)						
Profit (perte) net(te) latent(e)	(190 301)	(402 431)						
Revenu tiré du prêt de titres	99	298						
Revenu provenant des rabais sur les frais	97	106						
<b>Total des revenus (pertes)</b>	<b>(78 576)</b>	<b>(363 956)</b>						
<b>Charges (note 6)</b>								
Frais de gestion	40 958	39 807						
Rabais sur les frais de gestion	(50)	(27)						
Frais d'administration	4 841	4 702						
Frais de service aux porteurs de titres	–	1						
Intérêts débiteurs	25	7						
Commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille	1 128	1 037						
Frais du comité d'examen indépendant	8	8						
Autre	9	11						
<b>Charges avant les montants absorbés par le gestionnaire</b>	<b>46 919</b>	<b>45 546</b>						
Charges absorbées par le gestionnaire	1	1						
<b>Charges nettes</b>	<b>46 918</b>	<b>45 545</b>						
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, avant impôt</b>	<b>(125 494)</b>	<b>(409 501)</b>						
Charge (économie) d'impôt étranger retenu à la source	1 167	1 052						
Charge d'impôt étranger sur le résultat (recouvrée)	–	–						
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation</b>	<b>(126 661)</b>	<b>(410 553)</b>						
Série A					(0,34)	(1,00)	(38 267)	(119 560)
Série AR					(0,34)	(0,96)	(2 506)	(6 435)
Série D					(0,36)	(0,96)	(1 126)	(2 897)
Série F					(0,27)	(0,95)	(26 894)	(96 436)
Série F5					(0,27)	(1,06)	(1 356)	(4 850)
Série F8					(0,22)	(0,91)	(330)	(1 354)
Série FB					(0,26)	(0,88)	(82)	(261)
Série FB5					(0,36)	(1,42)	–	(1)
Série G					(0,39)	(1,33)	(7)	(27)
Série I					(0,27)	(0,90)	(123)	(408)
Série O					(0,41)	(1,78)	(3 128)	(13 304)
Série O5					(0,52)	(1,05)	(62)	(704)
Série PW					(0,39)	(1,18)	(43 083)	(129 893)
Série PWFB					(0,25)	(0,89)	(1 016)	(3 571)
Série PWFB5					(0,29)	(1,42)	(5)	(17)
Série PWR					(0,29)	(0,83)	(999)	(2 124)
Série PWT5					(0,31)	(1,08)	(2 036)	(7 435)
Série PWT8					(0,25)	(0,85)	(813)	(2 565)
Série PWX					(0,23)	(1,09)	(211)	(1 051)
Série PWX8					(0,18)	(0,97)	(6)	(36)
Série R					(0,30)	(1,36)	(110)	(567)
Série S					(0,18)	(0,80)	(297)	(1 541)
Série T5					(0,24)	(0,78)	(1 480)	(5 190)
Série T8					(0,13)	(0,45)	(445)	(1 681)
Série Investisseur					(0,26)	(0,93)	(951)	(4 262)
Série-B					(0,18)	(0,80)	(56)	(261)
Série Conseiller					(0,28)	(0,88)	(3)	(11)
Série LB					(0,31)	(0,88)	(196)	(533)
Série LF					(0,25)	(0,89)	(441)	(1 502)
Série LF5					(0,27)	(1,07)	(14)	(45)
Série LW					(0,29)	(0,92)	(596)	(1 943)
Série LW5					(0,33)	(1,09)	(18)	(78)
Série LX					(0,39)	(1,07)	(4)	(10)
							<b>(126 661)</b>	<b>(410 553)</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE LA SITUATION FINANCIÈRE

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

	Total		Série A		Série AR		Série D		Série F	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	<b>5 429 585</b>	<b>5 476 375</b>	<b>1 478 935</b>	<b>1 552 308</b>	<b>91 298</b>	<b>81 151</b>	<b>47 102</b>	<b>20 145</b>	<b>1 347 543</b>	<b>1 353 368</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(126 661)	(410 553)	(38 267)	(119 560)	(2 506)	(6 435)	(1 126)	(2 897)	(26 894)	(96 436)
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(15 540)	(1 062)	(274)	–	(8)	–	(273)	–	(8 689)	–
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(7 119)	(8 802)	–	–	–	–	–	–	–	–
Rabais sur les frais de gestion	(50)	(27)	(6)	(3)	–	–	–	–	(1)	(1)
<b>Total des distributions aux porteurs de titres</b>	<b>(22 709)</b>	<b>(9 891)</b>	<b>(280)</b>	<b>(3)</b>	<b>(8)</b>	<b>–</b>	<b>(273)</b>	<b>–</b>	<b>(8 690)</b>	<b>(1)</b>
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	472 224	440 465	153 401	140 803	10 433	9 467	8 375	29 983	138 904	104 255
Réinvestissement des distributions	16 432	4 230	269	3	7	–	262	–	7 240	–
Paiements au rachat de titres	(524 715)	(520 282)	(189 293)	(185 847)	(6 060)	(5 620)	(3 838)	(2 795)	(128 055)	(137 691)
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>(36 059)</b>	<b>(75 587)</b>	<b>(35 623)</b>	<b>(45 041)</b>	<b>4 380</b>	<b>3 847</b>	<b>4 799</b>	<b>27 188</b>	<b>18 089</b>	<b>(33 436)</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>(185 429)</b>	<b>(496 031)</b>	<b>(74 170)</b>	<b>(164 604)</b>	<b>1 866</b>	<b>(2 588)</b>	<b>3 400</b>	<b>24 291</b>	<b>(17 495)</b>	<b>(129 873)</b>
<b>À la clôture</b>	<b>5 244 156</b>	<b>4 980 344</b>	<b>1 404 765</b>	<b>1 387 704</b>	<b>93 164</b>	<b>78 563</b>	<b>50 502</b>	<b>44 436</b>	<b>1 330 048</b>	<b>1 223 495</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>										
<b>Titres en circulation, à l'ouverture</b>			<b>115 210</b>	<b>121 937</b>	<b>7 269</b>	<b>6 513</b>	<b>3 143</b>	<b>1 367</b>	<b>100 692</b>	<b>102 931</b>
Émis			12 010	11 607	836	799	556	2 082	10 417	8 300
Réinvestissement des distributions			21	–	1	–	18	–	552	–
Rachetés			(14 823)	(15 336)	(485)	(473)	(257)	(199)	(9 606)	(11 006)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>			<b>112 418</b>	<b>118 208</b>	<b>7 621</b>	<b>6 839</b>	<b>3 460</b>	<b>3 250</b>	<b>102 055</b>	<b>100 225</b>

  

	Série F5		Série F8		Série FB		Série FB5		Série G	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	<b>68 429</b>	<b>67 640</b>	<b>17 347</b>	<b>19 158</b>	<b>3 899</b>	<b>3 595</b>	<b>6</b>	<b>11</b>	<b>330</b>	<b>355</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(1 356)	(4 850)	(330)	(1 354)	(82)	(261)	–	(1)	(7)	(27)
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(466)	–	(114)	–	(21)	–	–	–	(1)	–
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(1 218)	(1 795)	(565)	(827)	–	–	(1)	–	–	–
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>Total des distributions aux porteurs de titres</b>	<b>(1 684)</b>	<b>(1 795)</b>	<b>(679)</b>	<b>(827)</b>	<b>(21)</b>	<b>–</b>	<b>(1)</b>	<b>–</b>	<b>(1)</b>	<b>–</b>
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	6 626	4 437	1 639	1 549	824	975	68	23	–	–
Réinvestissement des distributions	232	229	93	145	20	–	–	–	1	–
Paiements au rachat de titres	(4 914)	(5 826)	(1 264)	(1 812)	(850)	(838)	–	(23)	(20)	(25)
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>1 944</b>	<b>(1 160)</b>	<b>468</b>	<b>(118)</b>	<b>(6)</b>	<b>137</b>	<b>68</b>	<b>–</b>	<b>(19)</b>	<b>(25)</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>(1 096)</b>	<b>(7 805)</b>	<b>(541)</b>	<b>(2 299)</b>	<b>(109)</b>	<b>(124)</b>	<b>67</b>	<b>(1)</b>	<b>(27)</b>	<b>(52)</b>
<b>À la clôture</b>	<b>67 333</b>	<b>59 835</b>	<b>16 806</b>	<b>16 859</b>	<b>3 790</b>	<b>3 471</b>	<b>73</b>	<b>10</b>	<b>303</b>	<b>303</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>										
<b>Titres en circulation, à l'ouverture</b>	<b>4 918</b>	<b>4 694</b>	<b>1 478</b>	<b>1 521</b>	<b>313</b>	<b>294</b>	<b>–</b>	<b>1</b>	<b>19</b>	<b>21</b>
Émis	481	326	144	133	67	83	5	2	–	–
Réinvestissement des distributions	17	17	8	13	2	–	–	–	–	–
Rachetés	(358)	(433)	(110)	(155)	(69)	(71)	–	(2)	(1)	(2)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>5 058</b>	<b>4 604</b>	<b>1 520</b>	<b>1 512</b>	<b>313</b>	<b>306</b>	<b>5</b>	<b>1</b>	<b>18</b>	<b>19</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

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

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

	Série I		Série O		Série O5		Série PW		Série PWFB	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	5 336	5 527	205 136	195 272	10 055	10 563	1 712 842	1 689 909	52 421	49 173
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(123)	(408)	(3 128)	(13 304)	(62)	(704)	(43 083)	(129 893)	(1 016)	(3 571)
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(35)	–	(2 252)	–	(21)	–	(1 998)	–	(339)	–
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	–	–	(20)	(287)	–	–	–	–
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	(24)	(13)	–	–
<b>Total des distributions aux porteurs de titres</b>	<b>(35)</b>	<b>–</b>	<b>(2 252)</b>	<b>–</b>	<b>(41)</b>	<b>(287)</b>	<b>(2 022)</b>	<b>(13)</b>	<b>(339)</b>	<b>–</b>
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	58	28	7 007	10 926	–	–	122 389	109 015	2 999	3 517
Réinvestissement des distributions	35	–	2 247	–	39	287	1 964	13	339	–
Paiements au rachat de titres	(249)	(164)	(7 298)	(6 593)	(9 980)	(216)	(127 248)	(113 175)	(4 186)	(2 239)
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>(156)</b>	<b>(136)</b>	<b>1 956</b>	<b>4 333</b>	<b>(9 941)</b>	<b>71</b>	<b>(2 895)</b>	<b>(4 147)</b>	<b>(848)</b>	<b>1 278</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>(314)</b>	<b>(544)</b>	<b>(3 424)</b>	<b>(8 971)</b>	<b>(10 044)</b>	<b>(920)</b>	<b>(48 000)</b>	<b>(134 053)</b>	<b>(2 203)</b>	<b>(2 293)</b>
<b>À la clôture</b>	<b>5 022</b>	<b>4 983</b>	<b>201 712</b>	<b>186 301</b>	<b>11</b>	<b>9 643</b>	<b>1 664 842</b>	<b>1 555 856</b>	<b>50 218</b>	<b>46 880</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>										
<b>Titres en circulation, à l'ouverture</b>	<b>445</b>	<b>466</b>	<b>7 578</b>	<b>7 388</b>	<b>652</b>	<b>667</b>	<b>110 421</b>	<b>110 076</b>	<b>4 104</b>	<b>3 919</b>
Émis	5	2	259	432	–	–	7 929	7 447	235	291
Réinvestissement des distributions	3	–	85	–	3	19	129	1	27	–
Rachetés	(21)	(14)	(271)	(264)	(654)	(14)	(8 248)	(7 761)	(329)	(186)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>432</b>	<b>454</b>	<b>7 651</b>	<b>7 556</b>	<b>1</b>	<b>672</b>	<b>110 231</b>	<b>109 763</b>	<b>4 037</b>	<b>4 024</b>

	Série PWFB5		Série PWR		Série PWT5		Série PWT8		Série PWX	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	325	263	36 437	26 046	89 952	97 768	34 398	33 142	15 056	15 962
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(5)	(17)	(999)	(2 124)	(2 036)	(7 435)	(813)	(2 565)	(211)	(1 051)
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(2)	–	(46)	–	(135)	(437)	(47)	(157)	(159)	–
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(6)	(5)	–	–	(1 939)	(2 195)	(1 262)	(1 327)	–	–
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	(5)	(2)	(1)	(1)	–	–
<b>Total des distributions aux porteurs de titres</b>	<b>(8)</b>	<b>(5)</b>	<b>(46)</b>	<b>–</b>	<b>(2 079)</b>	<b>(2 634)</b>	<b>(1 310)</b>	<b>(1 485)</b>	<b>(159)</b>	<b>–</b>
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	–	23	5 345	5 073	2 412	5 736	1 716	2 923	231	221
Réinvestissement des distributions	2	5	46	–	1 005	1 181	626	675	158	–
Paiements au rachat de titres	(2)	(100)	(989)	(758)	(10 006)	(8 428)	(3 588)	(2 647)	(1 283)	(1 185)
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>–</b>	<b>(72)</b>	<b>4 402</b>	<b>4 315</b>	<b>(6 589)</b>	<b>(1 511)</b>	<b>(1 246)</b>	<b>951</b>	<b>(894)</b>	<b>(964)</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>(13)</b>	<b>(94)</b>	<b>3 357</b>	<b>2 191</b>	<b>(10 704)</b>	<b>(11 580)</b>	<b>(3 369)</b>	<b>(3 099)</b>	<b>(1 264)</b>	<b>(2 015)</b>
<b>À la clôture</b>	<b>312</b>	<b>169</b>	<b>39 794</b>	<b>28 237</b>	<b>79 248</b>	<b>86 188</b>	<b>31 029</b>	<b>30 043</b>	<b>13 792</b>	<b>13 947</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>										
<b>Titres en circulation, à l'ouverture</b>	<b>21</b>	<b>17</b>	<b>3 228</b>	<b>2 331</b>	<b>6 710</b>	<b>6 970</b>	<b>3 353</b>	<b>2 980</b>	<b>927</b>	<b>1 006</b>
Émis	–	2	476	477	182	433	170	278	15	15
Réinvestissement des distributions	–	–	4	–	77	91	63	66	10	–
Rachetés	–	(7)	(87)	(70)	(756)	(642)	(357)	(256)	(80)	(78)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>21</b>	<b>12</b>	<b>3 621</b>	<b>2 738</b>	<b>6 213</b>	<b>6 852</b>	<b>3 229</b>	<b>3 068</b>	<b>872</b>	<b>943</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

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

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

	Série PWX8		Série R		Série S		Série T5		Série T8	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	<b>401</b>	<b>358</b>	<b>7 874</b>	<b>8 720</b>	<b>20 771</b>	<b>23 520</b>	<b>60 396</b>	<b>68 147</b>	<b>19 688</b>	<b>22 488</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(6)	(36)	(110)	(567)	(297)	(1 541)	(1 480)	(5 190)	(445)	(1 681)
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(4)	–	(86)	–	(211)	–	(47)	(304)	(17)	(159)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(11)	(21)	–	–	–	–	(1 359)	(1 508)	(706)	(792)
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	(7)	(4)	(6)	(3)
<b>Total des distributions aux porteurs de titres</b>	<b>(15)</b>	<b>(21)</b>	<b>(86)</b>	<b>–</b>	<b>(211)</b>	<b>–</b>	<b>(1 413)</b>	<b>(1 816)</b>	<b>(729)</b>	<b>(954)</b>
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	–	196	68	108	175	252	2 497	3 414	1 309	1 985
Réinvestissement des distributions	3	4	–	–	211	–	930	1 173	388	477
Paiements au rachat de titres	(5)	(80)	(499)	(802)	(1 892)	(1 458)	(6 677)	(6 903)	(4 083)	(3 259)
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>(2)</b>	<b>120</b>	<b>(431)</b>	<b>(694)</b>	<b>(1 506)</b>	<b>(1 206)</b>	<b>(3 250)</b>	<b>(2 316)</b>	<b>(2 386)</b>	<b>(797)</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>(23)</b>	<b>63</b>	<b>(627)</b>	<b>(1 261)</b>	<b>(2 014)</b>	<b>(2 747)</b>	<b>(6 143)</b>	<b>(9 322)</b>	<b>(3 560)</b>	<b>(3 432)</b>
<b>À la clôture</b>	<b>378</b>	<b>421</b>	<b>7 247</b>	<b>7 459</b>	<b>18 757</b>	<b>20 773</b>	<b>54 253</b>	<b>58 825</b>	<b>16 128</b>	<b>19 056</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>	<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>	
<b>Titres en circulation, à l'ouverture</b>	<b>33</b>	<b>28</b>	<b>384</b>	<b>436</b>	<b>1 710</b>	<b>1 983</b>	<b>6 308</b>	<b>6 786</b>	<b>3 635</b>	<b>3 820</b>
Émis	–	16	3	5	15	23	265	360	246	367
Réinvestissement des distributions	–	–	–	–	18	–	99	126	74	88
Rachetés	–	(7)	(24)	(42)	(157)	(128)	(709)	(732)	(773)	(593)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>33</b>	<b>37</b>	<b>363</b>	<b>399</b>	<b>1 586</b>	<b>1 878</b>	<b>5 963</b>	<b>6 540</b>	<b>3 182</b>	<b>3 682</b>

	Série Investisseur		Série-B		Série Conseiller		Série LB		Série LF	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	<b>45 338</b>	<b>72 775</b>	<b>3 952</b>	<b>4 093</b>	<b>114</b>	<b>146</b>	<b>7 054</b>	<b>6 911</b>	<b>21 810</b>	<b>20 892</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(951)	(4 262)	(56)	(261)	(3)	(11)	(196)	(533)	(441)	(1 502)
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(94)	–	(41)	–	–	–	–	–	(135)	–
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>Total des distributions aux porteurs de titres</b>	<b>(94)</b>	<b>–</b>	<b>(41)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(135)</b>	<b>–</b>
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	–	–	–	–	–	–	1 279	981	1 784	1 611
Réinvestissement des distributions	87	–	41	–	–	–	–	–	135	–
Paiements au rachat de titres	(6 524)	(24 242)	(212)	(246)	–	(4)	(1 026)	(1 194)	(1 570)	(1 625)
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>(6 437)</b>	<b>(24 242)</b>	<b>(171)</b>	<b>(246)</b>	<b>–</b>	<b>(4)</b>	<b>253</b>	<b>(213)</b>	<b>349</b>	<b>(14)</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>(7 482)</b>	<b>(28 504)</b>	<b>(268)</b>	<b>(507)</b>	<b>(3)</b>	<b>(15)</b>	<b>57</b>	<b>(746)</b>	<b>(227)</b>	<b>(1 516)</b>
<b>À la clôture</b>	<b>37 856</b>	<b>44 271</b>	<b>3 684</b>	<b>3 586</b>	<b>111</b>	<b>131</b>	<b>7 111</b>	<b>6 165</b>	<b>21 583</b>	<b>19 376</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>	<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>	
<b>Titres en circulation, à l'ouverture</b>	<b>3 939</b>	<b>6 399</b>	<b>325</b>	<b>345</b>	<b>10</b>	<b>13</b>	<b>625</b>	<b>617</b>	<b>1 747</b>	<b>1 703</b>
Émis	–	–	–	–	–	–	115	92	143	137
Réinvestissement des distributions	8	–	3	–	–	–	–	–	11	–
Rachetés	(569)	(2 188)	(17)	(21)	–	–	(92)	(112)	(126)	(139)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>3 378</b>	<b>4 211</b>	<b>311</b>	<b>324</b>	<b>10</b>	<b>13</b>	<b>648</b>	<b>597</b>	<b>1 775</b>	<b>1 701</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

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

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

	Série LF5		Série LW		Série LW5		Série LX	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>								
<b>À l'ouverture</b>	<b>671</b>	<b>715</b>	<b>23 785</b>	<b>25 089</b>	<b>749</b>	<b>1 032</b>	<b>135</b>	<b>133</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(14)	(45)	(596)	(1 943)	(18)	(78)	(4)	(10)
Distributions aux porteurs de titres :								
Revenu de placement	(5)	–	(19)	–	(1)	(4)	–	(1)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(13)	(18)	–	–	(16)	(24)	(3)	(3)
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>Total des distributions aux porteurs de titres</b>	<b>(18)</b>	<b>(18)</b>	<b>(19)</b>	<b>–</b>	<b>(17)</b>	<b>(28)</b>	<b>(3)</b>	<b>(4)</b>
Opérations sur les titres :								
Produit de l'émission de titres	193	–	2 492	2 964	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	14	12	19	–	16	22	3	4
Paievements au rachat de titres	(127)	(136)	(2 851)	(4 316)	(94)	(35)	(32)	–
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>80</b>	<b>(124)</b>	<b>(340)</b>	<b>(1 352)</b>	<b>(78)</b>	<b>(13)</b>	<b>(29)</b>	<b>4</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>48</b>	<b>(187)</b>	<b>(955)</b>	<b>(3 295)</b>	<b>(113)</b>	<b>(119)</b>	<b>(36)</b>	<b>(10)</b>
<b>À la clôture</b>	<b>719</b>	<b>528</b>	<b>22 830</b>	<b>21 794</b>	<b>636</b>	<b>913</b>	<b>99</b>	<b>123</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>	<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>	
Titres en circulation, à l'ouverture	44	45	2 082	2 217	56	73	10	10
Émis	12	–	219	274	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	1	1	2	–	1	2	–	–
Rachetés	(8)	(9)	(251)	(404)	(7)	(3)	(2)	–
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>49</b>	<b>37</b>	<b>2 052</b>	<b>2 087</b>	<b>50</b>	<b>72</b>	<b>8</b>	<b>10</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

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

	2023 \$	2022 \$
<b>Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation	(126 661)	(410 553)
Ajustements pour :		
Perte (profit) net(te) réalisé(e) sur les placements	(48 124)	15 834
Variation de la perte (du profit) net(te) latent(e) sur les placements	190 301	402 431
Achat de placements	(1 695 046)	(1 672 637)
Produit de la vente et de l'échéance de placements	1 515 014	1 714 977
(Augmentation) diminution des sommes à recevoir et autres actifs	(251)	(8 286)
Augmentation (diminution) des sommes à payer et autres passifs	(10)	(25)
<b>Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités d'exploitation</b>	<b>(164 777)</b>	<b>41 741</b>
<b>Flux de trésorerie liés aux activités de financement</b>		
Produit de l'émission de titres	382 156	350 171
Paiements au rachat de titres	(433 222)	(425 477)
Distributions versées, déduction faite des réinvestissements	(6 277)	(5 661)
<b>Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités de financement</b>	<b>(57 343)</b>	<b>(80 967)</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>	<b>(222 120)</b>	<b>(39 226)</b>
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à l'ouverture	233 278	617 863
Incidence des fluctuations des taux de change sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie	192	1 198
<b>Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture</b>	<b>11 350</b>	<b>579 835</b>
Trésorerie	11 350	46 696
Équivalents de trésorerie	–	533 139
<b>Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture</b>	<b>11 350</b>	<b>579 835</b>
<b>Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :</b>		
Dividendes reçus	25 866	27 688
Impôts étrangers payés	1 167	1 052
Intérêts reçus	37 105	28 746
Intérêts versés	25	7

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES PLACEMENTS

au 30 septembre 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS</b>					
407 International Inc. 1,80 % 22-05-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	600 000	600	566
407 International Inc. 4,22 % 14-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 310 000	1 310	1 249
407 International Inc. 3,14 % 06-03-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	8 657 000	8 255	7 730
407 International Inc. 3,43 % 01-06-2033, série MTN	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 948 000	2 026	1 679
407 International Inc. 4,19 % 25-04-2042, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	254 000	283	219
407 International Inc. 3,60 % 21-05-2047, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 562 000	1 482	1 199
407 International Inc. 3,67 % 08-03-2049, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 347 000	2 067	1 814
407 International Inc. 4,86 % 31-07-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 560 000	1 558	1 457
AerCap Ireland Capital DAC 3,00 % 29-10-2028	Irlande	Sociétés – Non convertibles	1 228 000 USD	1 419	1 430
Aéroports de Montréal 6,55 % 11-10-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	159 000	188	172
Aéroports de Montréal 3,92 % 12-06-2045, rachetables 2044	Canada	Sociétés – Non convertibles	124 000	115	102
Aéroports de Montréal 3,36 % 24-04-2047, rachetables 2046	Canada	Sociétés – Non convertibles	890 000	721	663
Aéroports de Montréal 3,03 % 21-04-2050, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	179 000	139	122
AES Panama Generation Holdings SRL 4,38 % 31-05-2030, rachetables 2030	Panama	Sociétés – Non convertibles	1 585 675 USD	2 117	1 836
AIMCo Realty Investors LP 2,20 % 04-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 010 000	1 010	912
AIMCo Realty Investors LP 2,71 % 01-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 506 000	3 379	3 013
Alectra Inc. 3,24 % 21-11-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	460 000	481	448
Alexandria Real Estate Equities Inc. 2,00 % 18-05-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	556 000 USD	697	551
Algonquin Power & Utilities Corp. 4,09 % 17-02-2027, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 940 000	3 882	3 716
Algonquin Power & Utilities Corp. 4,60 % 29-01-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	364 000	348	343
Algonquin Power & Utilities Corp. 2,85 % 15-07-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 339 000	3 824	3 518
Algonquin Power & Utilities Corp., taux variable 18-01-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 260 000	1 260	1 002
Alimentation Couche-Tard inc. 2,95 % 25-01-2030, rachetables 2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 000 000 USD	1 314	1 134
Alimentation Couche-Tard inc. 5,59 % 25-09-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 360 000	3 360	3 356
AltaGas Ltd. 4,64 % 15-05-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	800 000	800	778
AltaGas Ltd. 2,17 % 16-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	680 000	680	601
AltaGas Ltd., taux variable 11-01-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	800 000	800	634
AltaGas Ltd., taux variable 17-08-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000	200	192
AltaLink, L.P. 1,51 % 11-09-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	740 000	740	582
AltaLink, L.P. 4,69 % 28-11-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 530 000	1 533	1 463
Alice International SARL 5,00 % 15-01-2028, rachetables 2023 144A	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	300 000 USD	341	349
Amazon.com Inc. 4,70 % 01-12-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 930 000 USD	2 622	2 510
Amazon.com Inc. 3,95 % 13-04-2052	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 802 000 USD	2 146	1 889
American Tower Corp. 1,88 % 15-10-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	840 000 USD	1 119	863
Anglian Water Services Financing PLC 4,53 % 26-08-2032	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	910 000	910	815
ARC Resources Ltd. 3,47 % 10-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	838 000	724	709
ARD Finance SA 6,50 % 30-06-2027 144A	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	80 000 USD	106	82
Ardagh Packaging Finance PLC 5,25 % 15-08-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	230 000 USD	262	260
Aroundtown SA 4,63 % 18-09-2025, rachetables 2025	Allemagne	Sociétés – Non convertibles	850 000	846	805
Ascend Wellness Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 27-08-2025	États-Unis	Prêts à terme	600 000 USD	753	694
Athabasca Indigenous Midstream LP 6,07 % 05-02-2042	Canada	Sociétés – Non convertibles	219 237	219	213
Athene Global Funding, taux variable 09-04-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	874 000	874	871
Athene Global Funding 3,13 % 10-03-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	980 000	980	933
Athene Global Funding 2,10 % 24-09-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 410 000	1 408	1 294
Athene Global Funding 2,47 % 09-06-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	492 000	442	412
Bank of America Corp., taux variable 15-09-2027 (taux variable différé)	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	6 713 000	6 147	5 991
Bank of America Corp., taux variable 16-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 030 000	2 013	1 880
Bank of America Corp., taux variable 04-04-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 096 000	1 098	953
Banque de Montréal 2,70 % 11-09-2024, série DPNT	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 751 000	3 812	3 656
Banque de Montréal 3,65 % 01-04-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 420 000	5 278	5 057
Banque de Montréal 4,31 % 01-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 261 000	4 228	4 054
Banque de Montréal 4,71 % 07-12-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	13 922 000	13 792	13 364
Banque de Montréal 3,19 % 01-03-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 890 000	5 680	5 391
Banque de Montréal, taux variable 27-10-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 758 000	2 819	2 779
Banque de Montréal, taux variable 07-09-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 080 000	4 080	4 023
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 427 000	1 416	1 314
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 818 000	3 820	3 700
La Banque de Nouvelle-Écosse 1,95 % 10-01-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 055 000	3 907	3 867

# FONDS ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
La Banque de Nouvelle-Écosse 2,16 % 03-02-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 238 000	1 180	1 181
La Banque de Nouvelle-Écosse 5,50 % 29-12-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	841 000	840	835
La Banque de Nouvelle-Écosse 5,50 % 08-05-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	13 044 000	13 244	12 954
La Banque de Nouvelle-Écosse 2,95 % 08-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 925 000	3 707	3 582
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 03-05-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 197 000	1 197	1 104
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 02-08-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 100 000	1 100	1 069
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 27-07-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 303 000	4 278	4 120
BCE Inc. 2,20 % 29-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	6 972 000	6 276	6 007
BCE Inc. 3,00 % 17-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 056 000	935	878
BCE Inc. 5,85 % 10-11-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	604 000	605	602
BCI QuadReal Realty 2,55 % 24-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 572 000	2 533	2 374
bclMC Realty Corp. 1,06 % 12-03-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	650 000	650	638
bclMC Realty Corp. 1,07 % 04-02-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	932 000	932	839
Beclé SAB de CV 2,50 % 14-10-2031	Mexique	Sociétés – Non convertibles	1 250 000 USD	1 566	1 298
Bell Canada Inc. 4,45 % 27-02-2047, rachetables 2046	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 363 000	1 478	1 093
Bell Canada 5,15 % 14-11-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 400 000	1 399	1 370
BP Capital Markets PLC 3,47 % 15-05-2025	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	1 670 000	1 689	1 613
Broadcast Media Partners Holdings Inc. 4,50 % 01-05-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	250 000 USD	303	279
Broadcom Inc. 4,11 % 15-09-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	448 000 USD	561	563
Brookfield Infrastructure Finance ULC 5,62 % 14-11-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 660 000	1 660	1 640
Brookfield Infrastructure Finance ULC 4,20 % 11-09-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 437 000	3 527	3 181
Brookfield Infrastructure Finance ULC 2,86 % 01-09-2032, rachetables 2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	222 000	222	173
Brookfield Renewable Energy Partners ULC 3,63 % 15-01-2027, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	12 967 000	12 443	12 126
Brookfield Renewable Partners ULC 4,25 % 15-01-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 233 000	1 254	1 149
Brookfield Residential Properties Inc. 5,13 % 15-06-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	366 000	366	302
Bruce Power L.P. 4,70 % 21-12-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	440 000	440	425
Bruce Power L.P. 4,00 % 21-06-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 705 000	1 645	1 549
Bruce Power L.P. 4,99 % 21-12-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	400 000	400	379
CAE Inc. 5,54 % 12-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 140 000	1 140	1 116
Administration aéroportuaire de Calgary 3,45 % 07-10-2041	Canada	Sociétés – Non convertibles	157 000	132	122
Administration aéroportuaire de Calgary 3,55 % 07-10-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	526 000	459	392
Administration aéroportuaire de Calgary 3,55 % 07-10-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	480 000	388	354
Investissements RPC 2,25 % 01-12-2031	Canada	Gouvernement fédéral	5 782 000	5 564	4 811
Canadian Core Real Estate LP 3,30 % 02-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 080 000	1 080	973
Banque Canadienne Impériale de Commerce 2,00 % 17-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	7 000 000	6 604	6 606
Banque Canadienne Impériale de Commerce 1,10 % 19-01-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000	118	108
Banque Canadienne Impériale de Commerce 5,94 % 14-07-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 900 000	1 900	1 895
Banque Canadienne Impériale de Commerce 4,95 % 29-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 461 000	5 511	5 301
Banque Canadienne Impériale de Commerce 5,05 % 07-10-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 529 000	3 498	3 431
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 21-04-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	8 558 000	8 015	7 688
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 07-04-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	919 000	909	856
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 20-01-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 100 000	1 100	1 057
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 20-04-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 330 000	1 328	1 277
Banque Canadienne Impériale de Commerce 4,38 % 28-10-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 336 000	1 242	1 233
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 28-07-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	925 000	923	890
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada 3,00 % 08-02-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 888 000	2 769	2 597
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada 4,40 % 10-05-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 260 000	1 258	1 173
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 2,54 % 28-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 668 000	3 515	3 257
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 3,15 % 13-03-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 872 000	2 690	2 567
Canadian Utilities Ltd. 4,85 % 03-06-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 700 000	2 689	2 437
Banque canadienne de l'Ouest 2,60 % 06-09-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 184 000	1 121	1 149
Banque canadienne de l'Ouest 2,61 % 30-01-2025, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	660 000	676	631
Banque canadienne de l'Ouest 3,86 % 21-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 650 000	1 650	1 595
Banque canadienne de l'Ouest 1,93 % 16-04-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 610 000	4 310	4 177
Banque canadienne de l'Ouest 5,15 % 02-09-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 460 000	2 463	2 379
Banque canadienne de l'Ouest, taux variable 22-12-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	480 000	480	456

# FONDS ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N <sup>bre</sup> d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Banque canadienne de l'Ouest, taux variable 31-07-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	400 000	400	304
Capital Power Corp. 4,28 % 18-09-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 419 000	2 483	2 382
Capital Power Corp. 4,99 % 23-01-2026, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 124 000	1 154	1 098
Capital Power Corp. 5,82 % 15-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 240 000	1 240	1 228
Capital Power Corp. 3,15 % 01-10-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 127 000	1 960	1 682
Cascades inc. 5,13 % 15-01-2026, rachetables 2023 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	310 000 USD	411	405
CCL Industries Inc. 3,86 % 13-04-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	690 000	696	633
CDP Financière inc. 1,50 % 19-10-2026	Canada	Gouvernements provinciaux	5 410 000	5 157	4 896
Cenovus Energy Inc. 3,60 % 10-03-2027, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 197 000	2 103	2 072
Cenovus Energy Inc. 3,50 % 07-02-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 510 000	3 463	3 231
Centrais Elétricas Brasileiras SA 3,63 % 04-02-2025	Brésil	Sociétés – Non convertibles	460 000 USD	607	596
Charter Communications Operating LLC 5,05 % 30-03-2029, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 880 000 USD	2 570	2 387
Charter Communications Operating LLC 2,80 % 01-04-2031, rachetables 2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	800 000 USD	1 119	850
Charter Communications Operating LLC, 2,30 %, 01-02-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 030 000 USD	3 345	3 017
Charter Communications Operating LLC 4,50 % 01-05-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 170 000 USD	1 611	1 254
Charter Communications Operating LLC 3,50 % 01-06-2041	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	540 000 USD	682	466
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 2,46 % 30-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	570 000	570	515
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 2,85 % 21-05-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 018 000	3 746	3 621
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 3,53 % 11-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	6 130 000	5 778	5 421
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 6,00 % 24-06-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	420 000	440	415
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 5,40 % 01-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 558 000	2 563	2 414
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 5,70 % 28-02-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 076 000	2 065	1 990
CIFI Holdings (Group) Co. Ltd. 6,00 % 16-07-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	442 000 USD	143	43
Ville de Toronto 2,60 % 24-09-2039	Canada	Administrations municipales	800 000	794	577
The Clorox Co. 1,80 % 15-05-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 010 000 USD	1 410	1 086
Coast Capital Savings Federal Credit Union, taux variable 02-05-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 460 000	2 460	2 381
Coca-Cola FEMSA SAB de CV 1,85 % 01-09-2032, rachetables 2032	Mexique	Sociétés – Non convertibles	1 700 000 USD	2 227	1 701
Cogeco Communications inc. 2,99 % 22-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 286 000	1 280	1 037
Cogeco Communications inc. 5,30 % 16-02-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	440 000	440	413
Colbún SA 3,15 % 19-01-2032	Chili	Sociétés – Non convertibles	1 030 000 USD	1 272	1 125
Cologix Data Centers Issuer LLC 4,94 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	160 000	160	144
Cologix Data Centers Issuer LLC 5,68 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	130 000	130	116
Columbia Care Inc. 6,00 % 29-06-2025, conv.	Canada	Sociétés – Convertibles	125 000 USD	154	132
Columbia Care Inc. 9,50 % 03-02-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	126	117
Comber Wind Financial Corp. 5,13 % 15-11-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 127 441	1 199	1 077
CommScope Inc. 4,75 % 01-09-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	140 000 USD	175	139
CommScope Technologies Finance LLC 8,25 % 01-03-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	39 000 USD	51	35
Connect Finco SARL 6,75 % 01-10-2026	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	230 000 USD	305	292
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	647 109	648	586
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-09-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	652 272	653	590
Corp Nacional del Cobre de Chile 4,50 % 16-09-2025	Chili	Sociétés – Non convertibles	260 000 USD	346	344
Corus Entertainment Inc. 5,00 % 11-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	350 000	350	236
Country Garden Holdings Co. Ltd. 2,70 % 12-07-2026	Chine	Sociétés – Non convertibles	775 000 USD	658	70
Country Garden Holdings Co. Ltd. 5,63 % 14-01-2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	905 000 USD	622	79
CPPIB Capital Inc. 1,95 % 30-09-2029	Canada	Gouvernement fédéral	1 920 000	1 913	1 651
CPPIB Capital Inc. 3,95 % 02-06-2032	Canada	Gouvernement fédéral	5 665 000	5 646	5 328
Fonds de placement immobilier Crombie 3,92 % 21-06-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	163 000	177	150
Fonds de placement immobilier Crombie 2,69 % 31-03-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	750 000	755	645
Fonds de placement immobilier Crombie 3,21 % 09-10-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	911 000	917	743
Fonds de placement immobilier Crombie 3,13 % 12-08-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	387 000	386	305
CU Inc. 4,09 % 02-09-2044, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 373 000	2 367	1 985
CU Inc. 3,55 % 22-11-2047, rachetables 2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	280 000	241	211

# FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
CU Inc. 3,95 % 23-11-2048, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	279 000	257	225
CU Inc. 2,96 % 07-09-2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 310 000	1 009	876
CU Inc. 4,77 % 14-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 125 000	1 124	1 031
CU Inc. 5,09 % 20-09-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 500 000	1 500	1 445
Curaleaf Holdings Inc. 8,00 % 15-12-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 090 000 USD	1 397	1 225
DIRECTV Holdings LLC 5,88 % 15-08-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	251	241
Dollarama inc. 5,08 % 27-10-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	889 000	887	879
Dollarama inc. 5,53 % 26-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 600 000	1 600	1 598
Domtar Corp. 6,75 % 01-10-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	574 000 USD	725	646
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 1,66 % 22-12-2025 (A)	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 170 000	1 169	1 063
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,54 % 07-12-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	760 000	760	680
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,06 % 17-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 190 000	1 139	1 026
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 5,38 % 22-03-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	560 000	560	539
Ecopetrol SA 6,88 % 29-04-2030, rachetables 2030	Colombie	Sociétés – Non convertibles	300 000 USD	452	373
Ecopetrol SA 4,63 % 02-11-2031	Colombie	Sociétés – Non convertibles	14 000 USD	14	15
Emera Inc. 4,84 % 02-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 440 000	1 374	1 357
L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie 5,50 % 13-01-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	670 000	670	644
L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie 3,63 % 17-04-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	500 000	500	385
Empresas CMPC SA 3,00 % 06-04-2031	Chili	Sociétés – Non convertibles	405 000 USD	505	438
Enbridge Gas Inc. 2,37 % 09-08-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	919 000	874	789
Enbridge Gas Inc. 2,35 % 15-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 350 000	1 128	1 091
Enbridge Gas Inc. 3,01 % 09-08-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	550 000	550	366
Enbridge Gas Inc. 3,20 % 15-09-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 800 000	1 641	1 230
Enbridge Gas Inc. 4,55 % 17-08-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	8 382 000	7 819	7 327
Enbridge Inc. 4,90 % 26-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 602 000	1 602	1 548
Enbridge Inc. 3,10 % 21-09-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 618 000	3 289	2 839
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	17 536 000	16 733	15 810
Enbridge Inc., taux variable 12-04-2078, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 040 000	3 116	2 862
Pipelines Enbridge Inc. 4,33 % 22-02-2049, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	467 000	489	361
Enel Finance International NV 5,00 % 15-06-2032 144A	Italie	Sociétés – Non convertibles	450 000 USD	553	555
Enel SPA 2,25 % 12-07-2031 144A	Italie	Sociétés – Non convertibles	250 000 USD	269	257
Énergir inc. 2,10 % 16-04-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	720 000	720	646
Énergir inc. 4,67 % 27-09-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	840 000	840	799
EPCOR Utilities Inc. 3,55 % 27-11-2047, rachetables 2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 060 000	1 041	805
EPCOR Utilities Inc. 3,11 % 08-07-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 500 000	2 244	1 729
EPCOR Utilities Inc. 4,73 % 02-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 150 000	1 150	1 052
EPCOR Utilities Inc. 5,33 % 03-10-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 680 000	1 682	1 686
Banque Équitable 1,88 % 26-11-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	184 000	164	167
Banque Équitable 3,36 % 02-03-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	856 000	856	795
Fairfax Financial Holdings Ltd. 8,30 % 15-04-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 100 000 USD	1 714	1 550
Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,23 % 14-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	570 000	570	516
Fairfax Financial Holdings Ltd. 3,95 % 03-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 624 000	1 588	1 369
Fairfax India Holdings Corp. 5,00 % 26-02-2028 144A	Inde	Sociétés – Non convertibles	490 000 USD	613	572
Fédération des caisses Desjardins du Québec 5,20 % 01-10-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	6 740 000	6 770	6 657
Fédération des caisses Desjardins du Québec 1,59 % 10-09-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 491 000	1 401	1 331
Fédération des caisses Desjardins du Québec 4,41 % 19-05-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 165 000	3 167	3 023
Fédération des caisses Desjardins du Québec 5,48 % 16-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	850 000	850	840
Fédération des caisses Desjardins du Québec, taux variable 26-05-2030, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 729 000	3 700	3 528
Fédération des caisses Desjardins du Québec, taux variable 23-08-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 420 000	2 420	2 307
Finning International Inc. 4,45 % 16-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 040 000	1 040	992
Fonds de placement immobilier First Capital 3,45 % 01-03-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	960 000	849	834
First West Credit Union 9,19 % 09-08-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 150 000	1 150	1 139
Compagnie Crédit Ford du Canada 7,00 % 10-02-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 417 000	2 417	2 416
Compagnie Crédit Ford du Canada 7,38 % 12-05-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 291 000	1 291	1 302
Compagnie Crédit Ford du Canada 2,96 % 16-09-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	6 090 000	5 456	5 448
Ford Motor Credit Co. LLC 6,78 % 15-09-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 930 000	1 930	1 929
Fortified Trust 1,96 % 23-10-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 330 000	2 330	2 084
Fortis Inc. 4,43 % 31-05-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 922 000	1 923	1 819
Frontera Generation Holdings LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 28-07-2026	États-Unis	Prêts à terme	23 502 USD	30	8

# FONDS ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Frontera Generation Holdings LLC, prêt à terme de second rang, taux variable 26-04-2028	États-Unis	Prêts à terme	22 811 USD	16	1
Financière General Motors du Canada Ltée 5,20 % 09-02-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	700 000	700	669
GFL Environmental Inc. 3,75 % 01-08-2025 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	800 000 USD	1 053	1 027
GFL Environmental Inc. 3,50 % 01-09-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	854 000 USD	1 036	999
Gibson Energy Inc. 5,75 % 12-07-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 565 000	1 571	1 513
Gibson Energy Inc., taux variable 22-12-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	375 000	377	306
Gibson Energy Inc., taux variable 12-07-2083	Canada	Sociétés – Non convertibles	510 000	516	511
Glencore Funding LLC 5,40 % 08-05-2028 144A	Australie	Sociétés – Non convertibles	300 000 USD	409	397
GoDaddy Operating Co. LLC 3,50 % 01-03-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	25 000 USD	31	29
The Goldman Sachs Group Inc. 3,31 %, taux variable 31-10-2025, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 030 000	2 191	1 972
The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 30-11-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 280 000	2 280	2 058
The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 28-02-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 037 000	1 001	878
Gouvernement des Bahamas 6,00 % 21-11-2028, rachetables 2028	Bahamas	Gouvernements étrangers	202 000 USD	259	226
Gouvernement des Bahamas 6,95 % 20-11-2029	Bahamas	Gouvernements étrangers	129 000 USD	188	143
Gouvernement des Bahamas 8,95 % 15-10-2032	Bahamas	Gouvernements étrangers	800 000 USD	1 035	936
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2027	Bésil	Gouvernements étrangers	1 800 000 BRL	4 591	4 747
Gouvernement du Canada 2,25 % 01-12-2029	Canada	Gouvernement fédéral	7 140 000	7 110	6 442
Gouvernement du Canada 2,50 % 01-12-2032	Canada	Gouvernement fédéral	84 744 000	82 708	74 766
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-06-2033	Canada	Gouvernement fédéral	94 128 000	89 116	84 574
Gouvernement du Canada 0,50 % 01-12-2050, rendement réel	Canada	Gouvernement fédéral	10 847 000	12 322	8 918
Gouvernement du Canada 1,75 % 01-12-2053	Canada	Gouvernement fédéral	23 623 000	16 500	14 929
Obligations du gouvernement du Canada indexées sur l'inflation 0,25 % 01-12-2054	Canada	Gouvernement fédéral	3 550 000	2 743	2 421
Fiducie de placement immobilier Granite 3,06 % 04-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 180 000	2 000	1 966
Fiducie de placement immobilier Granite 2,19 % 30-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 764 000	1 685	1 477
Fiducie de placement immobilier Granite 2,38 % 18-12-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	283 000	233	221
Gray Escrow Inc. 7,00 % 15-05-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	130 000 USD	158	152
Gray Television Inc. 5,38 % 15-11-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	890 000 USD	1 103	790
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 1,54 % 03-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	8 879 000	7 815	7 625
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 7,05 % 12-06-2030, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 062 000	1 212	1 159
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 7,10 % 04-06-2031, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 062 000	1 231	1 172
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 6,47 % 02-02-2034, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	209 000	242	227
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 2,75 % 17-10-2039	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 119 000	3 310	3 007
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 3,15 % 05-10-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 793 000	1 434	1 257
Fonds de placement immobilier H&R 3,37 % 30-01-2024, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 248 000	3 241	3 221
Fonds de placement immobilier H&R 4,07 % 16-06-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 725 000	1 769	1 654
HCA Healthcare Inc. 3,50 % 01-09-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	371 000 USD	493	428
Heathrow Funding Ltd. 3,25 % 21-05-2025	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	4 430 000	4 326	4 242
Heathrow Funding Ltd. 2,69 % 13-10-2027	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	821 000	821	731
Heathrow Funding Ltd. 3,40 % 08-03-2028	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	6 950 000	6 814	6 302
Heathrow Funding Ltd. 3,79 % 04-09-2030, rachetables 2030	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	1 427 000	1 397	1 250
Heathrow Funding Ltd. 3,73 % 13-04-2033	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	1 805 000	1 759	1 491
Compagnie Home Trust 5,32 % 13-06-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 190 000	1 190	1 175
Honda Canada Finance Inc. 4,87 % 23-09-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 505 000	2 510	2 432
Honda Canada Finance Inc. 5,73 % 28-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 080 000	1 080	1 082
Banque HSBC Canada 3,40 % 24-03-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 100 000	2 097	2 032
Hydro One Inc. 4,91 % 27-01-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	11 622 000	11 467	11 473
Hydro One Inc. 7,35 % 03-06-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 123 000	2 434	2 340
Hydro One Inc. 2,23 % 17-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 264 000	2 114	1 830
Hydro One Inc. 6,93 % 01-06-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 376 000	1 603	1 507
Hydro One Inc. 4,16 % 27-01-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	924 000	923	850
Hydro One Inc. 4,89 % 13-03-2037	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 913 000	1 862	1 822
Hydro One Inc. 4,59 % 09-10-2043, rachetables 2043	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 218 000	2 086	2 009
Hydro One Ltd. 1,41 % 15-10-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 430 000	2 133	2 097
Hydro-Québec, coupon détaché, 0 % 15-02-2025	Canada	Gouvernements provinciaux	380 000	366	354
IA Société financière inc., taux variable 20-06-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	900 000	900	881

# FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
L'Ordre Indépendant des Forestiers, taux variable 15-10-2035, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	830 000	830	653
Intact Corporation financière 5,46 % 22-09-2032 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	790 000 USD	1 047	1 019
Intact Corporation financière, taux variable 31-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	300 000	300	256
Inter Pipeline Ltd. 3,48 % 16-12-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 855 000	3 949	3 571
Inter Pipeline Ltd. 4,23 % 01-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 985 000	4 000	3 740
Inter Pipeline Ltd. 5,76 % 17-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	750 000	750	739
Inter Pipeline Ltd. 5,71 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	781 000	781	752
Inter Pipeline Ltd. 3,98 % 25-11-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	547 000	475	459
Inter Pipeline Ltd., taux variable 26-03-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	540 000	540	499
Interconexión Eléctrica SA ESP 3,83 % 26-11-2033	Colombie	Sociétés – Non convertibles	510 000 USD	570	569
Banque internationale pour la reconstruction et le développement 0 % 31-03-2027	Supranationales	s.o.	1 450 000 USD	1 757	1 758
Ivanhoe Cambridge II Inc. 2,30 % 12-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	277 000	286	266
Jadex Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 12-02-2028	États-Unis	Prêts à terme	527 255 USD	679	676
Jazz Pharmaceuticals PLC 4,38 % 15-01-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	250	238
John Deere Financial Inc. 1,63 % 09-04-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	360 000	360	329
JPMorgan Chase & Co. 1,90 % 05-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	5 129 000	4 830	4 510
Kaisa Group Holdings Ltd. 9,38 % 30-06-2024	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	165	16
Kaisa Group Holdings Ltd. 11,70 % 11-11-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	400 000 USD	481	33
Kaisa Group Holdings 8,65 % 27-10-2023	Chine	Sociétés – Non convertibles	700 000 USD	303	56
Kaisa Group Holdings 10,50 % 27-10-2023	Chine	Sociétés – Non convertibles	500 000 USD	372	40
Keyera Corp. 3,96 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 924 000	2 054	1 706
Keyera Corp., taux variable 13-06-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	670 000	671	622
Keyera Corp., taux variable 10-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 010 000	1 010	861
Kleopatra Finco SARL 4,25 % 01-03-2026	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	170 000 EUR	205	205
Knight Health Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 17-12-2028	États-Unis	Prêts à terme	680 415 USD	813	239
Kronos Acquisition Holdings Inc. 5,00 % 31-12-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	60 000 USD	74	74
Produits Kruger S.E.C. 6,00 % 24-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000	201	193
Produits Kruger S.E.C. 5,38 % 09-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	180 000	180	154
LABL Escrow Issuer LLC 6,75 % 15-07-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	95 000 USD	127	125
LABL Escrow Issuer LLC 10,50 % 15-07-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	73 000 USD	98	93
LABL Inc. 8,25 % 01-11-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	81 000 USD	92	90
Banque Laurentienne du Canada 1,15 % 03-06-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	991 000	991	961
Banque Laurentienne du Canada 4,60 % 02-09-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 480 000	1 480	1 436
Banque Laurentienne du Canada 0,88 % 01-03-2026	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	690 413	684	634
Banque Laurentienne du Canada 1,60 % 06-05-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	320 000	320	291
Banque Laurentienne du Canada, taux variable 15-06-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 930 000	2 930	2 708
Liberty Utilities (Canada) LP 3,32 % 14-02-2050, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	590 000	590	397
LifeScan Global Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 31-12-2026	États-Unis	Prêts à terme	194 367 USD	246	211
Les Compagnies Loblaw Itée 5,34 % 13-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	770 000	770	728
Logan Group Co. Ltd. 4,70 % 06-07-2026	Chine	Sociétés – Non convertibles	1 479 000 USD	1 179	145
Lower Mattagami Energy LP 3,42 % 20-06-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 380 000	1 450	1 359
Lower Mattagami Energy LP 2,43 % 14-05-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 030 000	1 030	850
Lower Mattagami Energy LP 4,85 % 31-10-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 630 000	1 649	1 570
LSF10 XL Bidco SCA, prêt à terme B de premier rang, taux variable 30-03-2028	Luxembourg	Prêts à terme	520 617 EUR	767	646
Magna International Inc. 4,95 % 31-01-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 280 000	1 279	1 227
Banque Manuvie du Canada 1,54 % 14-09-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 370 000	4 077	3 896
Banque Manuvie du Canada 2,86 % 16-02-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 860 000	1 860	1 705
Société Financière Manuvie, taux variable 20-08-2029, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 220 000	1 246	1 189
Société Financière Manuvie, taux variable 12-05-2030, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	8 800 000	8 302	8 283
Société Financière Manuvie, taux variable 10-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 710 000	2 710	2 631
Société Financière Manuvie, taux variable 19-06-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 320 000	1 320	1 268
MARB BondCo PLC 3,95 % 29-01-2031	Bésil	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	204	202
Mattamy Group Corp. 4,63 % 01-03-2030, rachetables 2025 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	164 000 USD	179	190
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 7,88 % 15-08-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	18 000 USD	24	24
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 9,25 % 15-04-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	34 000 USD	42	40
McDonald's Corp. 3,80 % 01-04-2028, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	610 000 USD	859	779
MEG Energy Corp. 7,13 % 01-02-2027, rachetables 2023 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	330 000 USD	434	458
MEG Energy Corp. 5,88 % 01-02-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	230 000 USD	293	292

# FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Metro inc. 4,66 % 07-02-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	582 000	577	543
Micron Technology Inc. 5,38 % 15-04-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 362 000 USD	4 521	4 409
Minerva Luxembourg SA 8,88 % 13-09-2033	Brésil	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	273	270
Mozart Debt Merger Sub Inc. 3,88 % 01-04-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	741 000 USD	938	851
Mozart Debt Merger Sub Inc. 5,25 % 01-10-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 092 000 USD	1 379	1 283
Banque Nationale du Canada 2,55 % 12-07-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 983 000	5 028	4 865
Banque Nationale du Canada 2,58 % 03-02-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 682 000	5 517	5 449
Banque Nationale du Canada 5,30 % 03-11-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 097 000	1 100	1 085
Banque Nationale du Canada 1,53 % 15-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	884 000	853	794
Banque Nationale du Canada, taux variable 18-08-2026, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 220 000	3 047	2 977
Banque Nationale du Canada 5,22 % 14-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 710 000	2 705	2 645
Banque Nationale du Canada, taux variable 16-08-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 400 000	2 400	2 319
Banque Nationale du Canada, taux variable 15-08-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 220 000	1 222	906
NAV CANADA 2,06 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	690 000	690	573
Nestlé Holdings Inc. 2,19 % 26-01-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 220 000	1 220	1 055
New Red Finance Inc. 4,00 % 15-10-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	90 000 USD	118	102
Nexstar Escrow Inc. 5,63 % 15-07-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	169 000 USD	225	204
NextEra Energy Capital Holdings Inc. 1,90 % 15-06-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	710 000 USD	854	817
NextEra Energy Capital Holdings Inc. 2,25 % 01-06-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 600 000 USD	2 247	1 745
North West Redwater Partnership Co. Ltd. 3,20 % 24-04-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 745 000	1 668	1 649
North West Redwater Partnership Co. Ltd. 2,80 % 01-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 068 000	4 932	4 620
North West Redwater Partnership Co. Ltd. 2,80 % 01-06-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 240 000	5 000	4 350
North West Redwater Partnership Co. Ltd. 3,70 % 23-02-2043, rachetables 2042	Canada	Sociétés – Non convertibles	870 000	800	674
North West Redwater Partnership 4,25 % 01-06-2029, rachetables, série F	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 630 000	4 518	4 372
North West Redwater Partnership 3,20 % 22-07-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 464 000	2 466	2 416
North West Redwater Partnership 3,65 % 01-06-2035, rachetables 2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 773 000	1 526	1 480
Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc. 4,11 % 31-03-2042	Canada	Sociétés – Non convertibles	777 710	787	638
NXP BV 2,65 % 15-02-2032	Chine	Sociétés – Non convertibles	420 000 USD	524	442
Omega Healthcare Investors Inc. 4,50 % 15-01-2025, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	410 000 USD	507	541
OMERS Finance Trust 1,55 % 21-04-2027	Canada	Gouvernements provinciaux	11 450 000	10 984	10 207
OMERS Finance Trust 2,60 % 14-05-2029	Canada	Gouvernements provinciaux	982 000	981	876
Ontario Hydro 0 % 26-05-2025	Canada	Gouvernements provinciaux	330 000	316	304
Ontario Power Generation Inc. 2,89 % 08-04-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	9 994 000	9 645	9 605
Ontario Power Generation Inc. 1,17 % 22-04-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 075 000	958	967
Ontario Power Generation Inc. 2,98 % 13-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 648 000	2 627	2 341
Ontario Power Generation Inc. 3,22 % 08-04-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 762 000	2 741	2 440
Ontario Power Generation Inc. 4,92 % 19-07-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	550 000	550	530
Ontario Teachers' Finance Trust 1,10 % 19-10-2027	Canada	Gouvernements provinciaux	830 000	828	717
Régime de retraite des enseignantes et des enseignants de l'Ontario 4,45 % 02-06-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	1 190 000	1 186	1 149
OPB Finance Trust 2,98 % 25-01-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	917 000	967	859
Corporation Parkland du Canada 3,88 % 16-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	6 510 000	6 248	6 031
Corporation Parkland du Canada 4,38 % 26-03-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	240 000	240	209
Corporation Pétroles Parkland 5,88 % 15-07-2027 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	37 000 USD	49	48
Corporation Pétroles Parkland 6,00 % 23-06-2028, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 820 000	1 812	1 737
PayPal Holdings Inc. 2,40 % 01-10-2024, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	920 000 USD	1 219	1 209
PayPal Holdings Inc. 2,65 % 01-10-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	970 000 USD	1 283	1 216
PayPal Holdings Inc. 2,30 % 01-06-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	610 000 USD	853	679
Pembina Pipeline Corp. 5,72 % 22-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 250 000	1 250	1 239
Pembina Pipeline Corp. 4,02 % 27-03-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	7 260 000	7 221	6 733
Pembina Pipeline Corp. 4,81 % 25-03-2044	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 694 000	2 786	2 211
Pembina Pipeline Corp. 4,74 % 21-01-2047, rachetables 2046, série MTN	Canada	Sociétés – Non convertibles	259 000	285	208
Pembina Pipeline Corp., taux variable 25-01-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 370 000	1 370	1 105

# FONDS ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Petróleos de Venezuela SA 6,00 % 16-05-2024	Venezuela	Sociétés – Non convertibles	420 000 USD	130	33
Petróleos Mexicanos 6,70 % 16-02-2032	Mexique	Sociétés – Non convertibles	26 000 USD	33	26
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 4,65 % 19-05-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	5 490 000 USD	7 388	7 143
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 4,75 % 19-05-2033	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 690 000 USD	2 275	2 175
Prime Structured Mortgage Trust 1,86 % 15-11-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 233 000	1 233	1 180
Province de l'Alberta 4,15 % 01-06-2033	Canada	Gouvernements provinciaux	1 180 000	1 152	1 124
Province de l'Alberta 3,05 % 01-12-2048	Canada	Gouvernements provinciaux	4 580 000	4 744	3 357
Province de l'Alberta 3,10 % 01-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	29 605 000	30 182	21 891
Province de l'Alberta 2,95 % 01-06-2052	Canada	Gouvernements provinciaux	22 950 000	20 664	16 352
Province de la Colombie-Britannique 3,55 % 18-06-2033	Canada	Gouvernements provinciaux	11 076 000	10 051	10 042
Province de la Colombie-Britannique 2,95 % 18-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	10 480 000	11 472	7 548
Province du Manitoba 3,20 % 05-03-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	6 970 000	7 464	5 181
Province du Manitoba 2,05 % 05-09-2052	Canada	Gouvernements provinciaux	10 620 000	7 981	5 951
Province du Manitoba 3,80 % 05-09-2053	Canada	Gouvernements provinciaux	1 280 000	1 196	1 059
Province de l'Ontario, coupon détaché général, 0 % 02-12-2033	Canada	Gouvernements provinciaux	1 510 000	1 504	1 498
Province de l'Ontario 4,05 % 02-02-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	10 400 000	10 391	9 908
Province de l'Ontario 3,65 % 02-06-2033	Canada	Gouvernements provinciaux	101 831 000	95 111	93 081
Province de l'Ontario 4,15 % 02-12-2054	Canada	Gouvernements provinciaux	78 512 000	75 701	70 864
Province de Québec 3,65 % 20-05-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	2 340 000	2 340	2 163
Province de Québec 3,25 % 01-09-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	50 194 000	47 160	44 700
Province de Québec 3,90 % 22-11-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	2 500 000	2 462	2 345
Province de Québec 3,60 % 01-09-2033	Canada	Gouvernements provinciaux	32 640 000	32 631	29 674
Province de Québec 4,40 % 01-12-2055	Canada	Gouvernements provinciaux	57 052 000	58 977	53 823
Province de la Saskatchewan 3,30 % 02-06-2048	Canada	Gouvernements provinciaux	608 000	645	469
Province de la Saskatchewan 3,10 % 02-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	8 100 000	8 335	5 992
Province de la Saskatchewan 2,80 % 02-12-2052	Canada	Gouvernements provinciaux	9 595 000	9 624	6 598
PSP Capital Inc. 0,90 % 15-06-2026	Canada	Gouvernement fédéral	2 071 000	2 069	1 864
PSP Capital Inc. 2,05 % 15-01-2030	Canada	Gouvernement fédéral	309 000	310	265
PSP Capital Inc. 2,60 % 01-03-2032	Canada	Gouvernement fédéral	4 432 000	4 204	3 768
Reliance LP 2,68 % 01-12-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	720 000	720	628
Reliance LP 2,67 % 01-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 070 000	1 070	914
Renesas Electronics Corp. 1,54 % 26-11-2024	Japon	Sociétés – Non convertibles	920 000 USD	1 160	1 178
Renesas Electronics Corp. 2,17 % 25-11-2026	Japon	Sociétés – Non convertibles	1 070 000 USD	1 349	1 285
Fonds de placement immobilier RioCan 5,61 % 06-10-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 750 000	2 716	2 662
Fonds de placement immobilier RioCan 2,83 % 08-11-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 788 000	1 620	1 506
Fonds de placement immobilier RioCan 4,63 % 01-05-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	360 000	360	329
Fonds de placement immobilier RioCan 5,96 % 01-10-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	390 000	390	378
Rogers Communications Inc. 3,10 % 15-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 691 000	5 445	5 454
Rogers Communications Inc. 5,70 % 21-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 010 000	3 006	2 978
Rogers Communications Inc. 3,75 % 15-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	8 442 000	8 023	7 585
Rogers Communications Inc. 2,90 % 09-12-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	843 000	852	688
Rogers Communications Inc. 6,75 % 09-11-2039	Canada	Sociétés – Non convertibles	480 000	668	493
Rogers Communications Inc., taux variable 17-12-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	17 753 000	16 412	16 079
Rogers Communications Inc., taux variable 15-03-2082 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	590 000 USD	749	710
Banque Royale du Canada 2,61 % 01-11-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	6 656 000	6 413	6 441
Banque Royale du Canada 3,37 % 29-09-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	14 184 000	13 688	13 535
Banque Royale du Canada 5,24 % 02-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 163 000	2 169	2 133
Banque Royale du Canada 2,33 % 28-01-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 147 000	3 739	3 732
Banque Royale du Canada 4,61 % 26-07-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 031 000	3 987	3 873
Banque Royale du Canada 4,64 % 17-01-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 370 000	2 370	2 270
Banque Royale du Canada 4,63 % 01-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 680 000	1 680	1 604
Banque Royale du Canada, taux variable 23-12-2029, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	990 000	992	952
Banque Royale du Canada, taux variable 30-06-2030, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 280 000	3 326	3 058
Banque Royale du Canada, taux variable 03-11-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 178 000	2 121	1 927
Banque Royale du Canada, taux variable 01-02-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 280 000	1 280	1 217
Banque Royale du Canada, taux variable 24-11-2080, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	983 000	930	915
S&P Global Inc. 1,25 % 15-08-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	530 000 USD	704	549
Sagen MI Canada Inc. 3,26 % 05-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	401 000	401	314
Sagen MI Canada Inc., taux variable 24-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	680 000	680	567
Scotia Capitaux Inc. 0,89 % 01-09-2026	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	911 845	888	826
Sea to Sky Highway Investment LP 2,63 % 31-08-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 073 449	1 072	939
Sienna Senior Living Inc. 3,11 % 04-11-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	440 000	440	423
Sienna Senior Living Inc. 3,45 % 27-02-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	550 000	550	509

# FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Sienna Senior Living Inc. 2,82 % 31-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	370 000	370	325
Signal Parent Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-04-2028	États-Unis	Prêts à terme	198 117 USD	248	228
Silgan Holdings Inc. 4,13 % 01-02-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	170 000 USD	224	207
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 2,70 % 13-01-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	87	17
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 5,95 % 04-02-2027	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	62	11
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 4,75 % 05-08-2029	Chine	Sociétés – Non convertibles	806 000 USD	461	43
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 4,75 % 14-01-2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	250 000 USD	81	18
Sprint Spectrum Co. LLC 4,74 % 20-03-2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	405 000 USD	524	543
Spy Hill Power LP 4,14 % 31-03-2036	Canada	Sociétés – Non convertibles	535 448	550	481
Stitch Acquisition Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 27-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	615 094 USD	717	653
Financière Sun Life inc., taux variable 13-08-2029, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 060 000	2 071	1 997
Financière Sun Life inc., taux variable 10-05-2032, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	7 080 000	6 529	6 292
Financière Sun Life inc., taux variable 21-11-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 110 000	9 166	8 660
Financière Sun Life inc., taux variable 10-08-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 899 000	1 895	1 782
Financière Sun Life inc., taux variable 04-07-2035	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 114 000	1 113	1 076
Financière Sun Life inc., taux variable 01-10-2035	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 450 000	1 449	1 118
Sunac China Holdings Ltd. 6,50 % 10-01-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	675 000 USD	189	121
Suncor Énergie Inc. 3,95 % 04-03-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 060 000	1 043	769
Supérieur Plus S.E.C. 4,50 % 15-03-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	160 000 USD	204	189
Suzano Austria GmbH 2,50 % 15-09-2028	Brésil	Sociétés – Non convertibles	1 225 000 USD	1 492	1 392
Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd. 3,63 % 28-04-2026, rachetables 2026 144A	Australie	Sociétés – Non convertibles	1 469 000 USD	1 883	1 888
Tamarack Valley Energy Ltd. 7,25 % 10-05-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000	235	238
TELUS Corp. 3,30 % 02-05-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 720 000	1 663	1 523
TELUS Corp. 3,15 % 19-02-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 525 000	2 395	2 171
TELUS Corp. 2,05 % 07-10-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	481 000	474	377
TELUS Corp. 2,85 % 13-11-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 020 000	851	819
TELUS Corp. 4,95 % 28-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	830 000	829	766
TELUS Corp. 4,70 % 06-03-2048, rachetables 2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 140 000	1 737	1 730
Tencent Holdings Ltd. 2,39 % 03-06-2030, rachetables 2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	700 000 USD	963	761
Tencent Music Entertainment Group 1,38 % 03-09-2025, rachetables 2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	490 000 USD	644	609
Tencent Music Entertainment Group 2,00 % 03-09-2030, rachetables 2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	360 000 USD	472	372
Tenet Healthcare Corp. 4,38 % 15-01-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	180 000 USD	226	211
Teranet Holdings LP 3,72 % 23-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 460 000	2 460	2 172
TerraForm Power Operating LLC 4,75 % 15-01-2030, rachetables 2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	40 000 USD	53	46
T-Mobile USA Inc. 3,50 % 15-04-2025, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	700 000 USD	992	917
T-Mobile USA Inc. 3,75 % 15-04-2027, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	7 265 000 USD	9 693	9 216
T-Mobile USA Inc. 2,55 % 15-02-2031, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	640 000 USD	869	693
T-Mobile USA Inc. 2,25 % 15-11-2031, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	420 000 USD	554	435
T-Mobile USA Inc. 5,20 % 15-01-2033	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 650 000 USD	2 132	2 117
T-Mobile USA Inc. 4,95 % 15-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	977 000 USD	1 312	1 288
Groupe TMX Ltée 2,30 % 11-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 490 000	1 541	1 446
Groupe TMX Ltée 3,78 % 05-06-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	470 000	476	438
Groupe TMX Ltée 2,02 % 12-02-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	600 000	600	472
Toronto Hydro Corp. 4,61 % 14-06-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 872 000	1 870	1 783
La Banque Toronto-Dominion 2,67 % 09-09-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	8 780 000	8 361	8 276
La Banque Toronto-Dominion 4,34 % 27-01-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	9 056 000	8 922	8 779
La Banque Toronto-Dominion 5,42 % 10-07-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 710 000	1 710	1 697
La Banque Toronto-Dominion 2,26 % 07-01-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 008 000	1 008	906
La Banque Toronto-Dominion 4,21 % 01-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 298 000	5 203	5 027
La Banque Toronto-Dominion 5,38 % 21-10-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 750 000	2 756	2 710
La Banque Toronto-Dominion 4,48 % 18-01-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 368 000	3 348	3 205
La Banque Toronto-Dominion 5,49 % 08-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 720 000	2 720	2 689
La Banque Toronto-Dominion 4,68 % 08-01-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 470 000	1 470	1 403
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 25-07-2029, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	52 000	50	51
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 22-04-2030, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	6 961 000	6 740	6 638

# FONDS ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 26-01-2032, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	877 000	856	796
Tourmaline Oil Corp. 2,53 % 12-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	590 000	590	505
Crédit Toyota Canada Inc. 4,45 % 26-01-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	989 000	980	965
Toyota Motor Corp. 1,34 % 25-03-2026	Japon	Sociétés – Non convertibles	610 000 USD	764	752
TransCanada PipeLines Ltd. 3,80 % 05-04-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 905 000	6 088	5 535
TransCanada PipeLines Ltd. 5,28 % 15-07-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 760 000	2 759	2 658
TransCanada PipeLines Ltd. 4,20 % 04-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 826 000	2 695	2 150
TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	14 247 000	13 123	12 467
Transcontinental inc. 2,67 % 03-02-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	401 000	378	381
Transurban Finance Co. Pty. Ltd. 4,56 % 14-11-2028, rachetables 2028	Australie	Sociétés – Non convertibles	2 706 000	2 852	2 527
Trillium Windpower LP 5,80 % 15-02-2033	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	468 271	520	458
Trulieve Cannabis Corp. 9,75 % 18-06-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	131	133
Trulieve Cannabis Corp. 8,00 % 06-10-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	160 000 USD	201	177
Uber Technologies Inc. 8,00 % 01-11-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	870 000 USD	1 129	1 196
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,50 % 15-04-2024	États-Unis	Gouvernements étrangers	16 091 000 USD	25 792	26 025
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2051	États-Unis	Gouvernements étrangers	12 033 000 USD	12 572	10 704
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052	États-Unis	Gouvernements étrangers	20 777 000 USD	24 737	17 047
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,50 % 15-02-2053	États-Unis	Gouvernements étrangers	13 778 000 USD	18 017	15 877
Administration de l'aéroport de Vancouver 1,76 % 20-09-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	348 000	294	280
Administration de l'aéroport de Vancouver 2,80 % 21-09-2050, rachetables 2050	Canada	Sociétés – Non convertibles	654 000	488	428
Ventas Canada Finance Ltd. 5,40 % 21-04-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 860 000	1 860	1 800
Ventas Realty LP 4,00 % 01-03-2028, rachetables 2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	700 000 USD	911	873
Verizon Communications Inc., taux variable 20-03-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	413 000 USD	517	563
Verizon Communications Inc. 2,38 % 22-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 146 000	2 067	1 864
Vidéotron ltée 3,63 % 15-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	6 100 000	5 478	5 328
Vidéotron ltée 4,50 % 15-01-2030, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 120 000	2 120	1 850
Vidéotron ltée 3,13 % 15-01-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 300 000	4 302	3 351
VMED O2 UK Financing I PLC 4,25 % 31-01-2031	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	264	217
The Walt Disney Co. 3,06 % 30-03-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 593 000	1 687	1 468
Waste Management of Canada Corp. 2,60 % 23-09-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 533 000	1 530	1 414
Wells Fargo & Co. 2,57 % 01-05-2026, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 736 000	2 711	2 589
Wells Fargo & Co. 2,98 % 19-05-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 165 000	2 297	2 012
Wells Fargo & Co. 2,49 % 18-02-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	920 000	924	824
Welltower Inc. 2,95 % 15-01-2027, rachetables 2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	272 000	247	244
Welltower Inc. 4,25 % 15-04-2028, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	448 000 USD	596	567
Welltower Inc. 4,13 % 15-03-2029, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	910 000 USD	1 203	1 127
Groupe WSP Global Inc. 2,41 % 19-04-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 149 000	2 166	1 869
Zoetis Inc. 2,00 % 15-05-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 000 000 USD	2 197	2 177
<b>Total des obligations</b>				<b>1 708 318</b>	<b>1 570 126</b>
<b>ACTIONS</b>					
Accenture PLC, cat. A	États-Unis	Technologie de l'information	346 157	110 703	144 313
Groupe Altus Ltée	Canada	Biens immobiliers	1 608 268	75 672	75 621
Amphenol Corp., cat. A	États-Unis	Technologie de l'information	801 123	66 604	91 341
Aon PLC	États-Unis	Services financiers	320 726	88 815	141 160
ATS Corp.	Canada	Produits industriels	180 006	10 639	10 422
BCE Inc., priv., série AA	Canada	Services de communication	18 310	284	276
BCE Inc., priv., série AI	Canada	Services de communication	3 259	51	45
BCE Inc. 4,54 %, à div. cumulatif rachetable, priv. de premier rang, série R, rachetables	Canada	Services de communication	1 126	20	16
Becton, Dickinson and Co.	États-Unis	Soins de santé	334 104	112 488	117 255
Boyd Group Services Inc.	Canada	Produits industriels	481 368	90 592	116 265
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 46	Canada	Biens immobiliers	20 757	528	365

# FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>ACTIONS (suite)</b>					
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 48	Canada	Biens immobiliers	5 888	149	109
Brookfield Renewable Partners L.P., priv., série 13	Canada	Services publics	7 969	197	147
CAE Inc.	Canada	Produits industriels	5 585 938	178 551	177 131
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	Canada	Produits industriels	452 194	70 271	66 513
Dollarama inc.	Canada	Consommation discrétionnaire	1 669 488	121 936	156 231
Emera Inc., priv., série J	Canada	Services publics	1 036	26	18
Emera Inc., priv., série L	Canada	Services publics	11 425	286	188
FirstService Corp.	Canada	Biens immobiliers	345 098	57 929	68 178
Frontera Generation Holdings LLC	États-Unis	Énergie	1 670	4	4
Fusion Connect Inc.	États-Unis	Services de communication	1	–	–
Intact Corporation financière	Canada	Services financiers	848 603	149 998	168 040
iQor US Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	1 525	26	3
Keysight Technologies Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	547 706	86 096	98 374
Linde PLC	Royaume-Uni	Matériaux	178 558	70 339	90 255
Les Compagnies Loblaw Ltée					
5,30 %, à div. cumulatif rachetable, priv. de second rang, série B	Canada	Consommation de base	4 169	109	85
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	France	Consommation discrétionnaire	93 000	98 121	95 246
Nutrien Ltd.	Canada	Matériaux	981 027	116 748	82 289
ON Semiconductor Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	1 128 910	90 168	142 445
Pet Valu Holdings Ltd.	Canada	Consommation discrétionnaire	2 210 411	72 615	53 912
Premium Brands Holdings Corp.	Canada	Consommation de base	1 499 931	151 086	142 643
Roper Technologies Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	52 528	34 472	34 532
Banque Royale du Canada	Canada	Services financiers	1 052 462	105 870	124 927
S&P Global Inc.	États-Unis	Services financiers	64 386	30 044	31 938
Schneider Electric SE	États-Unis	Produits industriels	767 319	167 981	171 730
Source Energy Services Ltd.	Canada	Énergie	238	27	1
Stantec Inc.	Canada	Produits industriels	1 895 491	111 248	167 050
Synopsys Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	200 749	88 505	125 077
TELUS Corp.	Canada	Services de communication	4 220 825	131 976	93 618
Thermo Fisher Scientific Inc.	États-Unis	Soins de santé	188 519	125 391	129 536
Thomson Reuters Corp.	Canada	Produits industriels	991 673	135 534	164 776
Toromont Industries Ltd.	Canada	Produits industriels	156 161	16 795	17 275
Trane Technologies PLC	États-Unis	Produits industriels	147 000	35 152	40 491
TransAlta Corp., perpétuelles, priv., série C	Canada	Services publics	3 260	61	54
TransAlta Corp., priv., série A	Canada	Services publics	27 798	369	326
Waste Connections Inc.	États-Unis	Produits industriels	165 691	29 774	30 217
<b>Total des actions</b>				<b>2 834 250</b>	<b>3 170 438</b>
<b>OPTIONS</b>					
Options achetées (se reporter au tableau des options achetées)				272	65
<b>Total des options</b>				<b>272</b>	<b>65</b>
<b>FONDS/BILLETS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>					
<sup>1</sup> FINB Obligations canadiennes totales Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	431 000	39 393	37 350
<sup>1</sup> FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	295 995	25 902	22 648
<sup>1</sup> FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	530 000	10 670	8 840
<b>Total des fonds/billets négociés en bourse</b>				<b>75 965</b>	<b>68 838</b>
<b>FONDS COMMUNS DE PLACEMENT</b>					
<sup>2</sup> Fonds à rendement absolu de titres de créance Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	2 274 322	22 875	18 493
<sup>2</sup> Fonds d'obligations tactique mondial Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	233 178	2 237	1 786
<sup>2</sup> Fonds d'obligations de sociétés nord-américaines Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	2 469 940	26 233	22 032
<b>Total des fonds communs de placement</b>				<b>51 345</b>	<b>42 311</b>
<b>FONDS PRIVÉS</b>					
<sup>3</sup> Northleaf Private Credit II LP	Canada	Services financiers	618	6 503	6 794
<sup>4</sup> Sagard Credit Partners II LP	Canada	Services financiers	618	2 967	3 027
<b>Total des fonds privés</b>				<b>9 470</b>	<b>9 821</b>

# FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>BILLETS À COURT TERME</b>					
Banque Royale du Canada 4,95 % 03-10-2023	Canada	Obligations de sociétés	25 831 000	25 831	25 835
Banque Royale du Canada 4,95 % 03-10-2023	Canada	Obligations de sociétés	16 310 000	16 310	16 312
Province de l'Alberta 5,14 % 25-10-2023	Canada	Gouvernements provinciaux	10 000 000	9 920	9 965
Province du Manitoba 5,11 % 25-10-2023	Canada	Gouvernements provinciaux	30 000 000	29 647	29 896
Province de Terre-Neuve 5,02 % 03-10-2023	Canada	Gouvernements provinciaux	10 000 000	9 984	9 996
Province de Terre-Neuve 5,12 % 09-11-2023	Canada	Gouvernements provinciaux	13 000 000	12 838	12 928
Province de Terre-Neuve 5,20 % 18-12-2023	Canada	Gouvernements provinciaux	15 000 000	14 812	14 833
Province de la Nouvelle-Écosse 5,12 % 16-10-2023	Canada	Gouvernements provinciaux	15 000 000	14 904	14 967
Province de l'Île-du-Prince-Édouard 5,11 % 31-10-2023	Canada	Gouvernements provinciaux	14 750 000	14 567	14 687
Province de l'Île-du-Prince-Édouard 5,11 % 31-10-2023	Canada	Gouvernements provinciaux	15 000 000	14 813	14 936
Province de l'Île-du-Prince-Édouard 5,15 % 31-10-2023	Canada	Gouvernements provinciaux	5 000 000	4 957	4 978
Province de l'Île-du-Prince-Édouard 5,16 % 05-12-2023	Canada	Gouvernements provinciaux	20 000 000	19 754	19 816
Province de Québec 5,09 % 06-10-2023	Canada	Gouvernements provinciaux	20 000 000	19 766	19 983
Province de Québec 5,11 % 27-10-2023	Canada	Gouvernements provinciaux	20 000 000	19 765	19 925
Gouvernement du Canada 5,10 % 29-02-2024	Canada	Gouvernement fédéral	7 158 000	6 920	7 011
Gouvernement du Canada 5,07 % 29-02-2024	Canada	Gouvernement fédéral	5 898 000	5 703	5 777
Gouvernement du Canada 5,08 % 29-02-2024	Canada	Gouvernement fédéral	9 140 000	8 837	8 953
Gouvernement du Canada 5,07 % 29-02-2024	Canada	Gouvernement fédéral	39 233 000	37 936	38 431
Gouvernement du Canada 5,08 % 29-02-2024	Canada	Gouvernement fédéral	20 770 000	20 088	20 345
Gouvernement du Canada 5,10 % 29-02-2024	Canada	Gouvernement fédéral	50 000 000	48 840	48 964
<b>Total des billets à court terme</b>				<b>356 192</b>	<b>358 538</b>
Coûts de transaction				(2 569)	–
<b>Total des placements</b>				<b>5 033 243</b>	<b>5 220 137</b>
Instruments dérivés (se reporter au tableau des instruments dérivés)					(8 205)
Trésorerie et équivalents de trésorerie					11 350
Autres éléments d'actif moins le passif					20 874
<b>Actif net attribuable aux porteurs de titres</b>					<b>5 244 156</b>

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

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

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

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

# FONDS ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## APERÇU DU PORTEFEUILLE

30 SEPTEMBRE 2023

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Actions	60,5
Obligations	32,7
<i>Obligations</i>	29,9
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)</i>	2,7
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)</i>	0,1
Placements à court terme	4,3
Fonds/billets négociés en bourse	1,3
Fonds communs de placement	0,8
Fonds privés	0,2
Autres éléments d'actif (de passif)	0,2
Options sur swaps achetées	–
Swaps	–

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	67,4
États-Unis	22,1
France	5,1
Irlande	4,4
Royaume-Uni	0,3
Autre	0,2
Autres éléments d'actif (de passif)	0,1
Brésil	0,1
Australie	0,1
Japon	0,1
Mexique	0,1

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Produits industriels	18,3
Obligations de sociétés	16,5
Technologie de l'information	12,1
Services financiers	8,9
Obligations provinciales	7,9
Obligations fédérales	6,7
Consommation discrétionnaire	5,8
Soins de santé	4,7
Billets à escompte provinciaux à court terme	3,6
Matériaux	3,3
Biens immobiliers	2,7
Consommation de base	2,7
Services de communication	1,8
Obligations d'État étrangères	1,5
Fonds/billets négociés en bourse	1,3
Autre	1,1
Billets à escompte de sociétés à court terme	0,8
Fonds privés	0,2
Autres éléments d'actif (de passif)	0,1

31 MARS 2023

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Actions	62,9
Obligations	30,0
<i>Obligations</i>	30,0
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)</i>	–
Trésorerie et placements à court terme	4,3
Fonds/billets négociés en bourse	1,3
Fonds communs de placement	0,8
Autres éléments d'actif (de passif)	0,5
Fonds privés	0,2

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	62,7
États-Unis	24,2
Irlande	4,6
Trésorerie et placements à court terme	4,3
France	2,9
Autres éléments d'actif (de passif)	0,5
Royaume-Uni	0,2
Chine	0,1
Australie	0,1
Mexique	0,1
Japon	0,1
Suisse	0,1
Brésil	0,1

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Produits industriels	17,0
Obligations de sociétés	14,7
Technologie de l'information	11,0
Services financiers	9,8
Obligations provinciales	8,3
Consommation discrétionnaire	6,7
Obligations fédérales	6,6
Soins de santé	6,3
Trésorerie et placements à court terme	4,3
Matériaux	3,3
Consommation de base	3,1
Services de communication	3,0
Biens immobiliers	2,7
Fonds/billets négociés en bourse	1,3
Fonds communs de placement	0,8
Autre	0,6
Autres éléments d'actif (de passif)	0,5

# FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES OPTIONS ACHETÉES

au 30 septembre 2023

Élément sous-jacent	Nombre de contrats	Type d'option	Date d'échéance	Prix d'exercice \$	Prime payée (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
Indice Markit North American Investment Grade CDX	82 146 000	Vente	20 décembre 2023	100,00 USD	272	65
<b>Total des options</b>					<b>272</b>	<b>65</b>

# FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS

au 30 septembre 2023

### 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 \$)
AA	(8 000 000)	20 décembre 2028	Markit CDX.NA.IG.40	Fonds équilibré canadien de croissance Mackenzie Bluewater	10 860	–	(129)
<b>Total des contrats de swap</b>					<b>10 860</b>	<b>–</b>	<b>(129)</b>

### Tableau des contrats à terme standardisés

Type de contrat	Nombre de contrats	Date d'échéance	Prix moyen des contrats (\$)	Montant notionnel* (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans, décembre 2023	(87)	13 décembre 2023	146,28 JPY	(114 570)	1 045	–
Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 5 ans, décembre 2023	1 332	18 décembre 2023	109,84 CAD	143 829	–	(2 476)
Contrats à terme standardisés à très long terme sur obligations du Trésor américain, décembre 2023	(379)	19 décembre 2023	124,52 USD	(61 064)	3 386	–
<b>Total des contrats à terme standardisés</b>				<b>(31 805)</b>	<b>4 431</b>	<b>(2 476)</b>

\* Le montant notionnel représente l'exposition aux instruments sous-jacents au 30 septembre 2023.

# FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2023

### 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 \$)
AA	93 824	CAD	(71 345)	USD	6 octobre 2023	(93 824)	(96 852)	–	(3 028)
A	121 969	CAD	(92 747)	USD	6 octobre 2023	(121 969)	(125 906)	–	(3 937)
AA	4 520	USD	(6 067)	CAD	6 octobre 2023	6 067	6 136	69	–
A	4 445	USD	(6 008)	CAD	6 octobre 2023	6 008	6 034	26	–
AA	13 000	USD	(17 622)	CAD	6 octobre 2023	17 622	17 648	26	–
A	7 817	CAD	(5 920)	USD	6 octobre 2023	(7 817)	(8 036)	–	(219)
A	2 310	USD	(3 066)	CAD	13 octobre 2023	3 066	3 135	69	–
AA	28 000	CAD	(21 225)	USD	13 octobre 2023	(28 000)	(28 813)	–	(813)
A	5 000	USD	(6 713)	CAD	13 octobre 2023	6 713	6 788	75	–
AA	4 451	CAD	(3 270)	USD	20 octobre 2023	(4 451)	(4 439)	12	–
AA	880	CAD	(596)	EUR	20 octobre 2023	(880)	(856)	24	–
AA	8	EUR	(11)	CAD	20 octobre 2023	11	11	–	–
A	10 304	CAD	(7 857)	USD	20 octobre 2023	(10 304)	(10 665)	–	(361)
A	3 952	CAD	(3 013)	USD	20 octobre 2023	(3 952)	(4 091)	–	(139)
A	20 608	CAD	(15 150)	USD	20 octobre 2023	(20 608)	(20 567)	41	–
A	5 545	USD	(7 474)	CAD	20 octobre 2023	7 474	7 527	53	–
AA	7 922	CAD	(5 908)	USD	27 octobre 2023	(7 922)	(8 021)	–	(99)
A	9 892	CAD	(7 340)	USD	27 octobre 2023	(9 892)	(9 965)	–	(73)
AA	142 653	CAD	(105 998)	USD	3 novembre 2023	(142 653)	(143 890)	–	(1 237)
AA	3 325	CAD	(2 471)	USD	3 novembre 2023	(3 325)	(3 354)	–	(29)
A	1 975	CAD	(1 452)	USD	3 novembre 2023	(1 975)	(1 971)	4	–
AA	5 545	USD	(7 477)	CAD	3 novembre 2023	7 477	7 527	50	–
A	11 090	USD	(14 945)	CAD	3 novembre 2023	14 945	15 055	110	–
A	8 089	CAD	(6 010)	USD	3 novembre 2023	(8 089)	(8 158)	–	(69)
A	4 902	CAD	(3 628)	USD	3 novembre 2023	(4 902)	(4 925)	–	(23)
A	2 000	CAD	(1 475)	USD	3 novembre 2023	(2 000)	(2 002)	–	(2)
AA	29 462	CAD	(21 751)	USD	9 novembre 2023	(29 462)	(29 523)	–	(61)
AA	5 545	USD	(7 475)	CAD	9 novembre 2023	7 475	7 526	51	–
AA	5 545	USD	(7 473)	CAD	9 novembre 2023	7 473	7 527	54	–
AA	8 049	CAD	(5 920)	USD	12 janvier 2024	(8 049)	(8 026)	23	–
A	7 905	CAD	(5 825)	USD	12 janvier 2024	(7 905)	(7 897)	8	–
AA	9 140	CAD	(6 790)	USD	19 janvier 2024	(9 140)	(9 205)	–	(65)
AA	60 574	CAD	(44 994)	USD	19 janvier 2024	(60 574)	(60 995)	–	(421)
AA	10 845	CAD	(8 040)	USD	25 janvier 2024	(10 845)	(10 899)	–	(54)
A	19 524	CAD	(14 477)	USD	9 février 2024	(19 524)	(19 620)	–	(96)
<b>Total des contrats de change à terme de gré à gré</b>								<b>695</b>	<b>(10 726)</b>
<b>Total des actifs dérivés</b>									<b>5 126</b>
<b>Total des passifs dérivés</b>									<b>(13 331)</b>

# FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## 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 2023 et 2022 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 2023, selon le cas. Pour l'exercice au cours duquel un fonds ou une série est établi(e) ou rétabli(e), l'information fournie se rapporte à la période commençant à la date d'établissement ou de rétablissement. Lorsqu'une série d'un fonds a été dissoute au cours de l'une ou l'autre des périodes, l'information concernant la série est fournie jusqu'à la fermeture des bureaux à la date de dissolution. Se reporter à la note 10 pour la date de constitution du Fonds et la date d'établissement de chacune des séries.

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

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

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

Les présents états financiers intermédiaires non audités (les « états financiers ») ont été établis conformément aux Normes internationales d'information financière (« 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 2023. La note 3 présente un résumé des principales méthodes comptables 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 13 novembre 2023.

### 3. Principales méthodes comptables

#### a) Instruments financiers

Les instruments financiers comprennent des actifs financiers et des passifs financiers tels que des titres de créance, des titres de capitaux propres, des fonds de placement à capital variable 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 confèrent aux porteurs 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, entre autres droits contractuels. Les titres rachetables du Fonds satisfont aux critères de classement à titre de passifs financiers conformément à l'IAS 32, *Instruments financiers : Présentation*. L'obligation du Fonds à l'égard de l'actif net attribuable aux porteurs de titres est présentée au prix de rachat.

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

# FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

### 3. Principales méthodes comptables (suite)

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

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

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

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

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

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

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

La valeur des contrats à terme standardisés ou des swaps fluctue quotidiennement; 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 2023.

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

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

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

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

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

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

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

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

# FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

### 3. Principales méthodes comptables (suite)

#### c) Comptabilisation des produits

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

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

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

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

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

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

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

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

#### f) Compensation

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

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

#### g) Devise

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

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

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

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

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

#### i) Valeur liquidative par titre

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

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

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

# FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

### 3. Principales méthodes comptables (suite)

#### k) Fusions

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

#### l) Modifications comptables futures

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

### 4. Estimations et jugements comptables critiques

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

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

#### Utilisation d'estimations

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

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

#### Utilisation de jugements

##### *Classement et évaluation des placements*

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

##### *Monnaie fonctionnelle*

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

##### *Intérêts dans des entités structurées non consolidées*

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

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

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

### 5. Impôts sur le résultat

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

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

# FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

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

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

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

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

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

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

### 7. Capital du Fonds

Le capital du Fonds, qui comprend l'actif net attribuable aux porteurs de titres, est réparti entre les différentes séries, lesquelles comportent chacune un nombre illimité de titres. Les titres en circulation du Fonds aux 30 septembre 2023 et 2022 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 2023, regroupés par type d'actif, région géographique et secteur.

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

#### ii. Risque de liquidité

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

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

#### iii. Risque de change

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

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

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

# FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

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

#### iv. Risque de taux d'intérêt

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

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

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

#### v. Autre risque de prix

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

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

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

#### vi. Risque de crédit

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

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

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

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

#### vii. Fonds sous-jacents

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

# FONDS ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

### 9. Autres renseignements

#### Abréviations

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

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

# FONDS ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

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

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

Date de constitution : 20 novembre 1996

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Les titres de série Investisseur ont été créés exclusivement afin de mettre en œuvre les fusions touchant le Fonds et ne sont plus offerts à la vente.

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

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

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

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

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

# FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

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

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

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

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

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

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

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

# FONDS ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

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

#### b) Reports prospectifs de pertes fiscales

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

#### c) Prêt de titres

	30 septembre 2023	31 mars 2023
	(\$)	(\$)
Valeur des titres prêtés	90 425	195 711
Valeur des biens reçus en garantie	96 269	205 891

	30 septembre 2023		30 septembre 2022	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
Revenus de prêts de titres bruts	123	100,0	379	100,0
Impôt retenu à la source	(1)	(0,8)	(17)	(4,5)
	122	99,2	362	95,5
Paiements à l'agent de prêt de titres	(23)	(18,7)	(64)	(16,9)
Revenu tiré du prêt de titres	99	80,5	298	78,6

#### d) Commissions

	(\$)
30 septembre 2023	241
30 septembre 2022	352

#### e) Risques découlant des instruments financiers

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

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

##### ii. Risque de change

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

Devise	30 septembre 2023				Incidence sur l'actif net			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Renforcement de 5 %		Affaiblissement de 5 %	
					(\$)	%	(\$)	%
USD	1 369 186	3 252	(539 531)	832 907				
EUR	267 827	8 017	(845)	274 999				
BRL	4 747	–	–	4 747				
JPY	–	(626)	1 045	419				
Total	1 641 760	10 643	(539 331)	1 113 072				
% de l'actif net	31,3	0,2	(10,3)	21,2				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					(55 654)	(1,1)	55 654	1,1

# FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

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

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

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

Devise	31 mars 2023				Incidence sur l'actif net			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Renforcement de 5 %		Affaiblissement de 5 %	
					(\$)	%	(\$)	%
USD	1 539 664	19 683	(559 854)	999 493				
EUR	157 139	4 198	(275)	161 062				
JPY	–	2 779	(2 323)	456				
Total	1 696 803	26 660	(562 452)	1 161 011				
% de l'actif net	31,3	0,5	(10,4)	21,4				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					(58 051)	(1,1)	58 051	1,1

\* Comprend les instruments financiers monétaires et non monétaires.

##### iii. Risque de taux d'intérêt

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

30 septembre 2023	Obligations (\$)	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
			Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
			(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	50 494	(31 805)				
1 an à 5 ans	473 428	–				
5 ans à 10 ans	634 522	–				
Plus de 10 ans	411 682	–				
Total	1 570 126	(31 805)				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt			(107 912)	(2,1)	107 912	2,1

31 mars 2023	Obligations (\$)	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
			Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
			(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	112 930	(322 635)				
1 an à 5 ans	435 915	–				
5 ans à 10 ans	702 171	–				
Plus de 10 ans	379 851	–				
Total	1 630 867	(322 635)				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt			(104 148)	(1,9)	104 148	1,9

##### iv. Autre risque de prix

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

Incidence sur l'actif net	Augmentation de 10 %		Diminution de 10 %	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
30 septembre 2023	329 143	6,3	(329 143)	(6,3)
31 mars 2023	354 144	6,5	(354 144)	(6,5)

# FONDS ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

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

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

##### v. Risque de crédit

Pour ce Fonds, la plus forte concentration du risque de crédit se trouve dans les titres de créance, tels que les obligations. La juste valeur des titres de créance tient compte de la solvabilité de l'émetteur de ces titres. L'exposition maximale à tout émetteur de titres de créance au 30 septembre 2023 était de 4,0 % de l'actif net du Fonds (6,6 % au 31 mars 2023).

Au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023, les titres de créance par note de crédit étaient les suivants :

Note des obligations*	30 septembre 2023	31 mars 2023
	% de l'actif net	% de l'actif net
AAA	4,2	6,7
AA	4,8	3,4
A	9,8	10,3
BBB	7,0	6,3
Inférieure à BBB	1,5	1,1
Sans note	2,6	2,2
Total	29,9	30,0

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

#### 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 2023				31 mars 2023			
	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	–	1 570 126	–	1 570 126	–	1 630 867	–	1 630 867
Actions	2 903 455	266 976	7	3 170 438	3 258 465	156 269	19	3 414 753
Options	–	65	–	65	–	–	–	–
Fonds/billets négociés en bourse	68 838	–	–	68 838	72 963	–	–	72 963
Fonds communs de placement	42 311	–	–	42 311	43 990	–	–	43 990
Fonds privés	–	–	9 821	9 821	–	–	9 729	9 729
Actifs dérivés	4 431	695	–	5 126	968	1 166	–	2 134
Passifs dérivés	(2 476)	(10 855)	–	(13 331)	(2 323)	(4 824)	–	(7 147)
Placements à court terme	–	358 538	–	358 538	–	213 559	–	213 559
Total	3 016 559	2 185 545	9 828	5 211 932	3 374 063	1 997 037	9 748	5 380 848

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

Au cours de la période close le 30 septembre 2023, les actions autres que nord-américaines étaient fréquemment transférées entre le niveau 1 (prix non rajustés cotés) et le niveau 2 (prix rajustés). Au 30 septembre 2023, ces titres étaient classés dans le niveau 2 (niveau 2 au 31 mars 2023).

# FONDS ÉQUILBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

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

#### f) Classement de la juste valeur (suite)

Le tableau ci-après présente un rapprochement des instruments financiers évalués à la juste valeur à l'aide de données non observables (niveau 3) pour les périodes closes le 30 septembre 2023 et le 31 mars 2023 :

	30 septembre 2023			31 mars 2023		
	Actions (\$)	Fonds privés (\$)	Total (\$)	Actions (\$)	Fonds privés (\$)	Total (\$)
Solde, à l'ouverture	19	9 729	9 748	27	4 216	4 243
Achats	–	101	101	–	5 340	5 340
Ventes	–	–	–	–	–	–
Transferts entrants	–	–	–	–	–	–
Transferts sortants	–	–	–	–	–	–
Profits (pertes) au cours de la période :						
Réalisé(e)s	–	–	–	–	–	–
Latent(e)s	(12)	(9)	(21)	(8)	173	165
Solde, à la clôture	7	9 821	9 828	19	9 729	9 748
Variation des profits (pertes) latent(e)s au cours de la période attribuables aux titres détenus à la clôture de la période	(12)	(9)	(21)	(8)	173	165

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

#### g) Placements détenus par le gestionnaire et des sociétés affiliées

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

	30 septembre 2023	31 mars 2023
	(\$)	(\$)
Gestionnaire	450	457
Autres fonds gérés par le gestionnaire	7 247	7 874
Fonds gérés par des sociétés affiliées au gestionnaire	18 757	20 771

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

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

	30 septembre 2023			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	4 711	(2 756)	–	1 955
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(7 955)	2 756	6 980	1 781
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	(3 244)	–	6 980	3 736

	31 mars 2023			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	1 179	(1 179)	–	–
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(5 283)	1 179	10 540	6 436
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	(4 104)	–	10 540	6 436

# FONDS ÉQUILIBRÉ CANADIEN DE CROISSANCE MACKENZIE BLUEWATER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

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

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

Les détails des placements du Fonds dans des fonds sous-jacents au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023 sont les suivants :

30 septembre 2023	% de l'actif net du Fonds sous-jacent	Juste valeur des placements du Fonds (\$)
FINB Obligations canadiennes totales Mackenzie	4,4	37 350
Fonds à rendement absolu de titres de créance Mackenzie, série R	18,5	18 493
FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	4,9	22 648
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	5,0	8 840
Fonds d'obligations tactique mondial Mackenzie, série R	0,7	1 786
Fonds d'obligations de sociétés nord-américaines Mackenzie, série R	2,1	22 032
Northleaf Private Credit II LP	0,8	6 794
Sagard Credit Partners II LP	0,5	3 027

31 mars 2023	% de l'actif net du Fonds sous-jacent	Juste valeur des placements du Fonds (\$)
FINB Obligations canadiennes totales Mackenzie	4,6	39 704
Fonds à rendement absolu de titres de créance Mackenzie, série R	16,2	19 463
FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	5,5	24 010
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	5,0	9 249
Fonds d'obligations tactique mondial Mackenzie, série R	0,6	1 891
Fonds d'obligations de sociétés nord-américaines Mackenzie, série R	2,0	22 636
Northleaf Private Credit II LP	0,8	6 878
Sagard Credit Partners II LP	0,8	2 851

#### j) Engagement

	30 septembre 2023		31 mars 2023	
	Montant appelé (\$ US)	Engagement d'investissement total (\$ US)	Montant appelé (\$ US)	Engagement d'investissement total (\$ US)
Northleaf Private Credit II LP <sup>1)</sup>	4 994	6 181	4 920	6 181
Sagard Credit Partners II LP <sup>2)</sup>	2 103	6 181	2 103	6 181

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

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

#### k) Changement de nom

Le 29 septembre 2022, le Fonds a été renommé Fonds équilibré canadien de croissance Mackenzie Bluewater.