

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

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



# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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>							
Placements à la juste valeur	1 580 781	1 596 286	Série A	7,32	7,65	396 198	439 774
Trésorerie et équivalents de trésorerie	24 506	13 520	Série AR	11,60	11,91	28 651	29 412
Intérêts courus à recevoir	7 460	3 776	Série B	11,38	11,69	2 199	2 512
Dividendes à recevoir	2 436	1 493	Série D	12,38	12,86	7 664	6 040
Sommes à recevoir pour placements vendus	661	5 225	Série DZ	10,00	10,28	257	338
Sommes à recevoir pour titres émis	401	469	Série F	8,68	9,02	284 762	307 080
Sommes à recevoir du gestionnaire	286	49	Série F5	13,04	13,54	4 831	5 433
Marge sur instruments dérivés	–	13 174	Série F8	9,90	10,44	7 407	7 531
Actifs dérivés	4 136	1 194	Série FB	9,26	9,63	1 230	1 426
Impôt à recouvrer	112	72	Série GF	14,53	–	53 140	–
<b>Total de l'actif</b>	<b>1 620 779</b>	<b>1 635 258</b>	Série GF8	14,38	–	1 978	–
			Série GLF	14,53	–	10 940	–
<b>PASSIF</b>			Série GO	14,57	–	596	–
<b>Passifs courants</b>			Série GPW	14,48	–	43 474	–
Sommes à payer pour placements achetés	2 150	1 130	Série GPWFB	14,53	–	2 686	–
Sommes à payer pour titres rachetés	984	1 415	Série GPWT8	14,34	–	1 494	–
Sommes à payer au gestionnaire	79	82	Série GPWX	14,57	–	3 847	–
Marge sur instruments dérivés	80	–	Série GW	14,48	–	1 650	–
Obligation pour options vendues	–	202	Série J	8,10	8,45	2 326	2 432
Passifs dérivés	2 215	6 751	Série J5	12,74	13,30	50	51
<b>Total du passif</b>	<b>5 508</b>	<b>9 580</b>	Série O	11,47	11,85	24 682	26 131
<b>Actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>1 615 271</b>	<b>1 625 678</b>	Série P	11,95	12,48	641 175	698 853
			Série PWB	10,13	10,40	2 416	2 919
			Série PWFB	8,60	8,93	11 847	11 073
			Série PWR	9,93	10,20	14 472	13 462
			Série PWT8	9,01	9,55	13 301	14 514
			Série PWX	14,15	14,62	11 363	12 162
			Série PWX8	10,85	11,38	274	289
			Série R	9,80	–	1	–
			Série T5	12,70	13,27	13 306	15 019
			Série T8	8,65	9,19	9 459	10 534
			Série LB	11,95	12,27	1 530	1 724
			Série LF	13,02	13,52	3 158	2 542
			Série LW	9,93	10,19	8 360	9 571
			Série LW5	11,91	12,44	4 018	4 306
			Série LX	11,09	11,59	529	550
						<b>1 615 271</b>	<b>1 625 678</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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
<b>Revenus</b>						
Dividendes	17 041	14 319				
Revenus d'intérêts aux fins de distribution	18 249	17 125				
Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets						
Profit (perte) net(te) réalisé(e)	15 608	4 102				
Profit (perte) net(te) latent(e)	(62 389)	(181 987)				
Revenu tiré du prêt de titres	87	79				
Revenu provenant des rabais sur les frais	369	368				
<b>Total des revenus (pertes)</b>	<b>(11 035)</b>	<b>(145 994)</b>				
<b>Charges (note 6)</b>						
Frais de gestion	13 321	13 756				
Rabais sur les frais de gestion	(18)	(11)				
Frais d'administration	1 488	1 515				
Intérêts débiteurs	20	6				
Commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille	230	194				
Frais du comité d'examen indépendant	3	3				
Autre	2	1				
<b>Charges avant les montants absorbés par le gestionnaire</b>	<b>15 046</b>	<b>15 464</b>				
Charges absorbées par le gestionnaire	–	–				
<b>Charges nettes</b>	<b>15 046</b>	<b>15 464</b>				
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, avant impôt</b>	<b>(26 081)</b>	<b>(161 458)</b>				
Charge (économie) d'impôt étranger retenu à la source	578	609				
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>(26 659)</b>	<b>(162 067)</b>				
Série A	(0,14)	(0,78)	(7 648)	(47 720)		
Série AR	(0,23)	(1,19)	(555)	(2 734)		
Série B	(0,20)	(1,15)	(42)	(280)		
Série D	(0,26)	(1,18)	(124)	(528)		
Série DZ	(0,13)	(1,00)	(4)	(36)		
Série F	(0,11)	(0,85)	(3 609)	(27 159)		
Série F5	(0,15)	(1,27)	(59)	(543)		
Série F8	(0,13)	(1,00)	(95)	(701)		
Série FB	(0,12)	(0,93)	(17)	(128)		
Série GF	(0,20)	–	(783)	–		
Série GF8	(0,16)	–	(24)	–		
Série GLF	(0,21)	–	(164)	–		
Série GO	(0,19)	–	(8)	–		
Série GPW	(0,26)	–	(788)	–		
Série GPWFB	(0,22)	–	(40)	–		
Série GPWT8	(0,26)	–	(27)	–		
Série GPWX	(0,12)	–	(40)	–		
Série GW	(0,24)	–	(28)	–		
Série J	(0,14)	(0,84)	(42)	(269)		
Série J5	(0,24)	(1,66)	(1)	(9)		
Série O	(0,08)	(1,05)	(186)	(2 035)		
Série PW	(0,21)	(1,26)	(11 669)	(70 121)		
Série PWB	(0,15)	(1,02)	(43)	(294)		
Série PWFB	(0,12)	(0,84)	(165)	(1 130)		
Série PWR	(0,19)	(0,97)	(272)	(1 105)		
Série PWT8	(0,16)	(0,99)	(242)	(1 507)		
Série PWX	(0,10)	(1,27)	(85)	(981)		
Série PWX8	(0,09)	(1,04)	(3)	(29)		
Série R	0,84	–	867	–		
Série T5	(0,24)	(1,37)	(258)	(1 640)		
Série T8	(0,16)	(0,97)	(183)	(1 200)		
Série LB	(0,22)	(1,21)	(30)	(192)		
Série LF	(0,20)	(1,18)	(39)	(193)		
Série LW	(0,18)	(1,01)	(166)	(977)		
Série LW5	(0,22)	(1,27)	(77)	(497)		
Série LX	(0,22)	(1,21)	(10)	(59)		
			<b>(26 659)</b>	<b>(162 067)</b>		

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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 B		Série D	
	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>1 625 678</b>	<b>1 749 285</b>	<b>439 774</b>	<b>515 848</b>	<b>29 412</b>	<b>28 243</b>	<b>2 512</b>	<b>3 052</b>	<b>6 040</b>	<b>2 610</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(26 659)	(162 067)	(7 648)	(47 720)	(555)	(2 734)	(42)	(280)	(124)	(528)
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(15 721)	(16 280)	(3 126)	(3 631)	(210)	(228)	(18)	(25)	(83)	(76)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(24 771)	(28 631)	(7 322)	(9 430)	–	–	–	–	(75)	(86)
Rabais sur les frais de gestion	(18)	(11)	(1)	(1)	–	–	–	–	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	(40 510)	(44 922)	(10 449)	(13 062)	(210)	(228)	(18)	(25)	(158)	(162)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	237 565	108 474	24 193	31 477	1 978	2 417	39	45	2 588	4 008
Titres émis et rachetés à la fusion (note 10)	34	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	35 454	39 174	9 807	12 227	210	228	16	23	131	137
Paiements au rachat de titres	(216 291)	(144 126)	(59 479)	(61 588)	(2 184)	(2 004)	(308)	(307)	(813)	(246)
Total des opérations sur les titres	56 762	3 522	(25 479)	(17 884)	4	641	(253)	(239)	1 906	3 899
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>(10 407)</b>	<b>(203 467)</b>	<b>(43 576)</b>	<b>(78 666)</b>	<b>(761)</b>	<b>(2 321)</b>	<b>(313)</b>	<b>(544)</b>	<b>1 624</b>	<b>3 209</b>
<b>À la clôture</b>	<b>1 615 271</b>	<b>1 545 818</b>	<b>396 198</b>	<b>437 182</b>	<b>28 651</b>	<b>25 922</b>	<b>2 199</b>	<b>2 508</b>	<b>7 664</b>	<b>5 819</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>			<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>
Titres en circulation, à l'ouverture			57 469	62 314	2 469	2 278	215	251	470	190
Émis			3 190	4 043	166	206	3	4	202	296
Émis et rachetés à la fusion (note 10)			–	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions			1 300	1 596	18	20	1	2	10	11
Rachetés			(7 843)	(7 911)	(183)	(172)	(26)	(27)	(63)	(19)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>			<b>54 116</b>	<b>60 042</b>	<b>2 470</b>	<b>2 332</b>	<b>193</b>	<b>230</b>	<b>619</b>	<b>478</b>

  

	Série DZ		Série F		Série F5		Série F8		Série FB	
	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>338</b>	<b>449</b>	<b>307 080</b>	<b>302 759</b>	<b>5 433</b>	<b>6 217</b>	<b>7 531</b>	<b>7 945</b>	<b>1 426</b>	<b>1 431</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(4)	(36)	(3 609)	(27 159)	(59)	(543)	(95)	(701)	(17)	(128)
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(3)	(4)	(3 939)	(4 241)	(68)	(84)	(102)	(111)	(16)	(18)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	(3 288)	(3 702)	(57)	(74)	(202)	(226)	(16)	(19)
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	(3)	(4)	(7 227)	(7 943)	(125)	(158)	(304)	(337)	(32)	(37)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	–	–	28 119	22 267	–	–	411	299	63	290
Titres émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	3	4	5 435	5 797	43	48	65	65	32	36
Paiements au rachat de titres	(77)	(80)	(45 036)	(20 856)	(461)	(247)	(201)	(216)	(242)	(404)
Total des opérations sur les titres	(74)	(76)	(11 482)	7 208	(418)	(199)	275	148	(147)	(78)
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>(81)</b>	<b>(116)</b>	<b>(22 318)</b>	<b>(27 894)</b>	<b>(602)</b>	<b>(900)</b>	<b>(124)</b>	<b>(890)</b>	<b>(196)</b>	<b>(243)</b>
<b>À la clôture</b>	<b>257</b>	<b>333</b>	<b>284 762</b>	<b>274 865</b>	<b>4 831</b>	<b>5 317</b>	<b>7 407</b>	<b>7 055</b>	<b>1 230</b>	<b>1 188</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>			<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>
Titres en circulation, à l'ouverture	33	42	34 062	31 477	401	430	722	690	148	139
Émis	–	–	3 132	2 458	–	–	39	28	7	29
Émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	–	–	609	649	3	4	6	6	3	4
Rachetés	(7)	(7)	(5 014)	(2 319)	(34)	(18)	(19)	(20)	(25)	(42)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>26</b>	<b>35</b>	<b>32 789</b>	<b>32 265</b>	<b>370</b>	<b>416</b>	<b>748</b>	<b>704</b>	<b>133</b>	<b>130</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.



# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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 J5		Série O		Série PW		Série PWB		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>	51	102	26 131	24 469	698 853	747 250	2 919	3 151	11 073	12 632
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(1)	(9)	(186)	(2 035)	(11 669)	(70 121)	(43)	(294)	(165)	(1 130)
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	–	(1)	(453)	(445)	(5 746)	(6 303)	(24)	(31)	(159)	(175)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(1)	(1)	(180)	(181)	(11 009)	(13 166)	–	–	(133)	(155)
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	(15)	(9)	–	–	–	–
<b>Total des distributions aux porteurs de titres</b>	<b>(1)</b>	<b>(2)</b>	<b>(633)</b>	<b>(626)</b>	<b>(16 770)</b>	<b>(19 478)</b>	<b>(24)</b>	<b>(31)</b>	<b>(292)</b>	<b>(330)</b>
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	–	–	384	750	31 411	40 236	62	2	1 966	670
Titres émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	1	1	568	551	15 590	18 115	21	26	286	321
Paiements au rachat de titres	–	(45)	(1 582)	(1 377)	(76 240)	(49 794)	(519)	(50)	(1 021)	(624)
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>1</b>	<b>(44)</b>	<b>(630)</b>	<b>(76)</b>	<b>(29 239)</b>	<b>8 557</b>	<b>(436)</b>	<b>(22)</b>	<b>1 231</b>	<b>367</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>(1)</b>	<b>(55)</b>	<b>(1 449)</b>	<b>(2 737)</b>	<b>(57 678)</b>	<b>(81 042)</b>	<b>(503)</b>	<b>(347)</b>	<b>774</b>	<b>(1 093)</b>
<b>À la clôture</b>	<b>50</b>	<b>47</b>	<b>24 682</b>	<b>21 732</b>	<b>641 175</b>	<b>666 208</b>	<b>2 416</b>	<b>2 804</b>	<b>11 847</b>	<b>11 539</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>	
Titres en circulation, à l'ouverture	4	7	2 204	1 953	56 001	55 486	281	291	1 240	1 326
Émis	–	–	33	65	2 535	3 174	6	–	221	75
Émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	–	–	48	47	1 266	1 453	2	3	32	36
Rachetés	–	(3)	(134)	(116)	(6 165)	(3 940)	(50)	(5)	(116)	(70)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>4</b>	<b>4</b>	<b>2 151</b>	<b>1 949</b>	<b>53 637</b>	<b>56 173</b>	<b>239</b>	<b>289</b>	<b>1 377</b>	<b>1 367</b>

  

	Série PWR		Série PWT8		Série PWX		Série PWX8		Série R	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	13 462	11 078	14 514	15 850	12 162	11 388	289	344	–	–
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(272)	(1 105)	(242)	(1 507)	(85)	(981)	(3)	(29)	867	–
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(123)	(118)	(119)	(134)	(208)	(221)	(5)	(6)	–	–
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	(447)	(547)	(83)	(88)	(6)	(8)	–	–
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	(1)	–	–	–	–	–	–
<b>Total des distributions aux porteurs de titres</b>	<b>(123)</b>	<b>(118)</b>	<b>(566)</b>	<b>(682)</b>	<b>(291)</b>	<b>(309)</b>	<b>(11)</b>	<b>(14)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	1 779	1 644	655	1 110	186	1 014	–	–	141 888	–
Titres émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	–	–	–	–	–	–	–	(134 525)	–
Réinvestissement des distributions	123	117	298	349	280	299	9	12	–	–
Paiements au rachat de titres	(497)	(121)	(1 358)	(614)	(889)	(443)	(10)	(17)	(8 229)	–
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>1 405</b>	<b>1 640</b>	<b>(405)</b>	<b>845</b>	<b>(423)</b>	<b>870</b>	<b>(1)</b>	<b>(5)</b>	<b>(866)</b>	<b>–</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>1 010</b>	<b>417</b>	<b>(1 213)</b>	<b>(1 344)</b>	<b>(799)</b>	<b>(420)</b>	<b>(15)</b>	<b>(48)</b>	<b>1</b>	<b>–</b>
<b>À la clôture</b>	<b>14 472</b>	<b>11 495</b>	<b>13 301</b>	<b>14 506</b>	<b>11 363</b>	<b>10 968</b>	<b>274</b>	<b>296</b>	<b>1</b>	<b>–</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>	
Titres en circulation, à l'ouverture	1 320	1 044	1 519	1 486	832	737	25	28	–	–
Émis	174	165	69	110	13	70	–	–	14 222	–
Émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	–	–	–	–	–	–	–	(13 399)	–
Réinvestissement des distributions	12	12	32	36	19	21	1	1	–	–
Rachetés	(49)	(12)	(144)	(61)	(61)	(30)	(1)	(2)	(823)	–
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>1 457</b>	<b>1 209</b>	<b>1 476</b>	<b>1 571</b>	<b>803</b>	<b>798</b>	<b>25</b>	<b>27</b>	<b>–</b>	<b>–</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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 T5		Série T8		Série LB		Série LF	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>								
<b>À l'ouverture</b>	15 019	17 969	10 534	13 196	1 724	2 028	2 542	1 460
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(258)	(1 640)	(183)	(1 200)	(30)	(192)	(39)	(193)
Distributions aux porteurs de titres :								
Revenu de placement	(106)	(125)	(74)	(91)	(12)	(15)	(36)	(33)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(247)	(320)	(330)	(443)	–	–	(30)	(30)
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>Total des distributions aux porteurs de titres</b>	<b>(353)</b>	<b>(445)</b>	<b>(404)</b>	<b>(534)</b>	<b>(12)</b>	<b>(15)</b>	<b>(66)</b>	<b>(63)</b>
Opérations sur les titres :								
Produit de l'émission de titres	–	–	569	925	83	56	699	1 014
Titres émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	132	167	212	261	12	15	66	62
Paiements au rachat de titres	(1 234)	(1 257)	(1 269)	(1 926)	(247)	(200)	(44)	(10)
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>(1 102)</b>	<b>(1 090)</b>	<b>(488)</b>	<b>(740)</b>	<b>(152)</b>	<b>(129)</b>	<b>721</b>	<b>1 066</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>(1 713)</b>	<b>(3 175)</b>	<b>(1 075)</b>	<b>(2 474)</b>	<b>(194)</b>	<b>(336)</b>	<b>616</b>	<b>810</b>
<b>À la clôture</b>	<b>13 306</b>	<b>14 794</b>	<b>9 459</b>	<b>10 722</b>	<b>1 530</b>	<b>1 692</b>	<b>3 158</b>	<b>2 270</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	1 132	1 252	1 147	1 283	141	159	188	101
Émis	–	–	62	96	6	5	53	73
Émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	10	13	24	28	1	1	5	5
Rachetés	(94)	(93)	(140)	(201)	(20)	(17)	(3)	(1)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>1 048</b>	<b>1 172</b>	<b>1 093</b>	<b>1 206</b>	<b>128</b>	<b>148</b>	<b>243</b>	<b>178</b>

	Série LW		Série LW5		Série LX	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>						
<b>À l'ouverture</b>	9 571	10 851	4 306	5 436	550	598
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(166)	(977)	(77)	(497)	(10)	(59)
Distributions aux porteurs de titres :						
Revenu de placement	(74)	(93)	(34)	(41)	(4)	(4)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	(70)	(94)	(10)	(11)
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–
<b>Total des distributions aux porteurs de titres</b>	<b>(74)</b>	<b>(93)</b>	<b>(104)</b>	<b>(135)</b>	<b>(14)</b>	<b>(15)</b>
Opérations sur les titres :						
Produit de l'émission de titres	283	232	155	17	1	1
Titres émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	74	93	104	134	13	15
Paiements au rachat de titres	(1 328)	(1 019)	(366)	(602)	(11)	(26)
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>(971)</b>	<b>(694)</b>	<b>(107)</b>	<b>(451)</b>	<b>3</b>	<b>(10)</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>(1 211)</b>	<b>(1 764)</b>	<b>(288)</b>	<b>(1 083)</b>	<b>(21)</b>	<b>(84)</b>
<b>À la clôture</b>	<b>8 360</b>	<b>9 087</b>	<b>4 018</b>	<b>4 353</b>	<b>529</b>	<b>514</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>	<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>	
Titres en circulation, à l'ouverture	939	1 023	346	405	47	48
Émis	27	24	13	1	–	–
Émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	7	9	8	11	1	1
Rachetés	(131)	(100)	(30)	(49)	–	(2)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>842</b>	<b>956</b>	<b>337</b>	<b>368</b>	<b>48</b>	<b>47</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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	(26 659)	(162 067)
Ajustements pour :		
Perte (profit) net(te) réalisé(e) sur les placements	(38 676)	14 454
Variation de la perte (du profit) net(te) latent(e) sur les placements	62 389	181 987
Achat de placements	(481 472)	(291 800)
Produit de la vente et de l'échéance de placements	471 004	277 704
(Augmentation) diminution des sommes à recevoir et autres actifs	8 270	(1 683)
Augmentation (diminution) des sommes à payer et autres passifs	77	(2 016)
<b>Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités d'exploitation</b>	<b>(5 067)</b>	<b>16 579</b>
<b>Flux de trésorerie liés aux activités de financement</b>		
Produit de l'émission de titres	217 442	80 258
Paiements au rachat de titres	(196 499)	(115 667)
Distributions versées, déduction faite des réinvestissements	(5 056)	(5 748)
<b>Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités de financement</b>	<b>15 887</b>	<b>(41 157)</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>	<b>10 820</b>	<b>(24 578)</b>
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à l'ouverture	13 520	60 633
Incidence des fluctuations des taux de change sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie	166	623
<b>Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture</b>	<b>24 506</b>	<b>36 678</b>
Trésorerie	22 041	14 292
Équivalents de trésorerie	2 465	22 386
<b>Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture</b>	<b>24 506</b>	<b>36 678</b>
<b>Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :</b>		
Dividendes reçus	16 098	14 313
Impôts étrangers payés	578	609
Intérêts reçus	14 565	15 479
Intérêts versés	20	6

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES PLACEMENTS

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</b>					
407 International Inc. 4,22 % 14-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	264 000	264	252
407 International Inc. 4,19 % 25-04-2042, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	22 000	21	19
407 International Inc. 3,67 % 08-03-2049, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	278 000	238	215
407 International Inc. 4,86 % 31-07-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	224 000	224	209
Acuris Finance US Inc. 5,00 % 01-05-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	635 000 USD	745	714
AerCap Ireland Capital DAC 3,00 % 29-10-2028	Irlande	Sociétés – Non convertibles	500 000 USD	575	582
AES Panama Generation Holdings SRL 4,38 % 31-05-2030, rachetables 2030	Panama	Sociétés – Non convertibles	741 303 USD	854	858
AIMCo Realty Investors LP 2,20 % 04-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	207 000	207	187
AIMCo Realty Investors LP 2,71 % 01-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 206 000	1 084	1 037
Albertsons Cos. Inc. 3,25 % 15-03-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 190 000 USD	1 355	1 495
Albertsons Cos. Inc. 4,63 % 15-01-2027, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	841 000 USD	1 089	1 079
Alcoa Nederland Holding BV 5,50 % 15-12-2027, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	748 000 USD	993	968
Algonquin Power & Utilities Corp. 4,09 % 17-02-2027, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	800 000	774	755
Algonquin Power & Utilities Corp. 4,60 % 29-01-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	57 000	54	54
Algonquin Power & Utilities Corp. 2,85 % 15-07-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	942 000	779	764
Algonquin Power & Utilities Corp., taux variable 18-01-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 360 000	3 169	2 671
Alimentation Couche-Tard inc. 2,95 % 25-01-2030, rachetables 2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 034 000 USD	5 719	5 711
Alimentation Couche-Tard inc. 5,59 % 25-09-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	484 000	484	483
Allied Universal Holdco LLC 4,63 % 01-06-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	876 000 USD	1 002	995
Alphabet Inc. 1,90 % 15-08-2040	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 596 000 USD	3 442	3 058
Alphabet Inc. 2,05 % 15-08-2050, rachetables 2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	5 524 000 USD	4 817	4 130
AltaGas Ltd. 4,64 % 15-05-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	108 000	108	105
AltaGas Ltd., taux variable 11-01-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 410 000	2 249	1 909
AltaGas Ltd., taux variable 17-08-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 010 000	1 010	972
Altice Financing SA 5,75 % 15-08-2029 144A	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	1 047 000 USD	1 123	1 166
Altice France SA 2,13 % 15-02-2025	France	Sociétés – Non convertibles	972 000 EUR	1 316	1 320
Altice France SA 5,13 % 15-07-2029	France	Sociétés – Non convertibles	2 495 000 USD	2 497	2 408
Altice International SARL 5,00 % 15-01-2028, rachetables 2023 144A	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	400 000 USD	455	465
Amazon.com Inc. 3,60 % 13-04-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 578 000 USD	3 189	3 110
Amazon.com Inc. 4,70 % 01-12-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	388 000 USD	527	505
Amazon.com Inc. 4,80 % 05-12-2034	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 513 000 USD	2 083	1 978
American Teleconferencing Services Ltd., prêt à terme de premier rang, taux variable 08-06-2023	États-Unis	Prêts à terme	1 733 568 USD	104	106
Apple Inc. 1,70 % 05-08-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 861 000 USD	4 208	4 129
Apple Inc. 2,65 % 11-05-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	5 559 000 USD	5 422	4 646
Apple Inc. 2,65 % 08-02-2051	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	5 250 000 USD	5 098	4 325
ARC Falcon I Inc., prêt à terme de second rang, taux variable 22-09-2029	États-Unis	Prêts à terme	210 000 USD	265	258
ARC Resources Ltd. 2,35 % 10-03-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 210 000	2 039	2 038
Arcos Dorados BV 6,13 % 27-05-2029	Brésil	Sociétés – Non convertibles	1 000 000 USD	1 258	1 296
ARD Finance SA 6,50 % 30-06-2027 144A	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	468 322 USD	483	480
Ardagh Metal Packaging 4,00 % 01-09-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	792 000 USD	835	844
Ardagh Packaging Finance PLC 5,25 % 15-08-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 269 000 USD	1 368	1 435
Aroundtown SA 4,63 % 18-09-2025, rachetables 2025	Allemagne	Sociétés – Non convertibles	750 000	669	711
Vins Arterra Canada Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 18-11-2027	Canada	Prêts à terme	350 770	337	337
Artis Real Estate Investment Trust 5,60 % 29-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 472 000	4 349	4 276
Ascend Wellness Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 27-08-2025	États-Unis	Prêts à terme	762 550 USD	910	882
Ashtead US Holdings Inc. 4,00 % 01-05-2028	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	606 000 USD	755	752
Ashton Woods USA LLC 6,63 % 15-01-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	265 000 USD	338	341
Ashton Woods USA LLC 4,63 % 01-08-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 228 000 USD	1 352	1 412
AT&T Inc. 4,30 % 15-02-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	893 000 USD	1 111	1 104
Athenahealth Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 27-01-2029	États-Unis	Prêts à terme	1 000 000 USD	1 332	1 336
Athene Global Funding, taux variable 09-04-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	710 000	705	708
Athene Global Funding 3,13 % 10-03-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 190 000	1 140	1 133
Athene Global Funding 2,10 % 24-09-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	419 000	386	385
AutoCanada Inc. 5,75 % 07-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	965 000	965	837

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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>					
Avolon Holdings Funding Ltd. 6,38 % 04-05-2028 144A	Irlande	Sociétés – Non convertibles	1 271 000 USD	1 667	1 696
Bakelite US Holdco Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 02-02-2029	États-Unis	Prêts à terme	167 875 USD	211	226
Bank of America Corp., taux variable 16-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	474 000	469	439
Banque de Montréal 4,71 % 07-12-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 050 000	1 045	1 008
Banque de Montréal, taux variable 27-10-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	96 000	100	97
Banque de Montréal, taux variable 07-09-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	584 000	584	576
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 716 000	3 479	3 422
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 000 000	2 000	1 938
Banque de Montréal, taux variable 26-05-2171, perpétuelles	Canada	Sociétés – Non convertibles	803 000	803	769
La Banque de Nouvelle-Écosse 1,95 % 10-01-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	319 000	319	304
La Banque de Nouvelle-Écosse 5,50 % 29-12-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	352 000	352	349
La Banque de Nouvelle-Écosse 5,50 % 08-05-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 007 000	1 026	1 000
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 03-05-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	233 000	233	215
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 02-08-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	149 000	149	145
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 27-07-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 431 000	3 721	3 201
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 27-07-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 123 000	1 123	1 075
BCE Inc. 2,20 % 29-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	133 000	131	115
BCE Inc. 3,00 % 17-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	815 000	713	677
BCE Inc. 5,85 % 10-11-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	948 000	980	945
bclMC Realty Corp. 1,07 % 04-02-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	277 000	251	249
Beclé SAB de CV 2,50 % 14-10-2031	Mexique	Sociétés – Non convertibles	1 090 000 USD	1 366	1 132
Bell Canada 5,15 % 14-11-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	201 000	201	197
Broadcast Media Partners Holdings Inc. 4,50 % 01-05-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 420 000 USD	1 658	1 582
Broadcom Inc. 4,11 % 15-09-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	261 000 USD	327	328
Brookfield Infrastructure Finance ULC 5,62 % 14-11-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	678 000	678	670
Brookfield Infrastructure Finance ULC 4,20 % 11-09-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	729 000	705	675
Brookfield Infrastructure Finance ULC 2,86 % 01-09-2032, rachetables 2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	67 000	55	52
Brookfield Renewable Partners ULC 4,25 % 15-01-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 472 000	1 422	1 372
Brookfield Residential Properties Inc. 5,13 % 15-06-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 382 000	1 119	1 141
Bruce Power L.P. 4,00 % 21-06-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	230 000	214	209
CAE Inc. 5,54 % 12-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	154 000	154	151
Corporation Cameco 2,95 % 21-10-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 050 000	953	941
Canacol Energy Ltd. 5,75 % 24-11-2028	Colombie	Sociétés – Non convertibles	367 000 USD	415	406
Canadian Core Real Estate LP 3,30 % 02-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	217 000	217	196
Banque Canadienne Impériale de Commerce 5,94 % 14-07-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	273 000	273	272
Banque Canadienne Impériale de Commerce 4,95 % 29-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	724 000	730	703
Banque Canadienne Impériale de Commerce 5,05 % 07-10-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	189 000	188	184
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 21-04-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 903 000	2 623	2 608
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 20-01-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	225 000	225	216
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 20-04-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	205 000	205	197
Banque Canadienne Impériale de Commerce 4,38 % 28-10-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	411 000	381	379
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 28-07-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 787 000	3 782	3 644
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada 3,00 % 08-02-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	595 000	560	535
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada 4,40 % 10-05-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	172 000	172	160
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 2,54 % 28-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	640 000	624	568
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 3,15 % 13-03-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	310 000	281	277
Banque canadienne de l'Ouest 2,60 % 06-09-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	232 000	220	225
Banque canadienne de l'Ouest 5,15 % 02-09-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	216 000	216	209
Banque canadienne de l'Ouest, taux variable 31-07-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 378 000	2 076	1 807
CANPACK SA/CANPACK US LLC 3,88 % 15-11-2029 144A	Pologne	Sociétés – Non convertibles	1 529 000 USD	1 646	1 700
Capital Power Corp. 5,82 % 15-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	179 000	179	177
Capital Power Corp. 3,15 % 01-10-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	362 000	306	286
Capital Power Corp., taux variable 09-09-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 265 000	1 265	1 214
Carnival Corp. 9,88 % 01-08-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	558 000 USD	760	794
Carriage Purchaser Inc. 7,88 % 15-10-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	348 000 USD	433	359
Cascades inc. 5,13 % 15-01-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	957 000	932	934

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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>					
Cascades inc. 5,13 % 15-01-2026, rachetables 2023 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 901 000 USD	2 426	2 481
CCL Industries Inc. 3,86 % 13-04-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	546 000	521	501
Cenovus Energy Inc. 2,65 % 15-01-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 170 000 USD	1 230	1 235
Cenovus Energy Inc. 3,75 % 15-02-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 688 000 USD	4 457	4 213
Centene Corp. 4,63 % 15-12-2029, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	262 000 USD	332	322
Centene Corp. 3,38 % 15-02-2030, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 004 000 USD	2 334	2 275
Charter Communications Operating LLC 4,50 % 01-02-2024, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	591 000 USD	784	798
Charter Communications Operating LLC 5,05 % 30-03-2029, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	8 519 000 USD	10 833	10 818
Charter Communications Operating LLC 2,80 % 01-04-2031, rachetables 2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	352 000 USD	376	374
Charter Communications Operating LLC 2,30 % 01-02-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	314 000 USD	321	313
Charter Communications Operating LLC 4,50 % 01-05-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	120 000 USD	125	129
Charter Communications Operating LLC 3,50 % 01-06-2041	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	157 000 USD	144	135
Chevron Corp. 2,24 % 11-05-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 771 000 USD	2 048	2 007
Chevron U.S.A. Inc. 2,34 % 12-08-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 737 000 USD	3 459	2 876
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 3,53 % 11-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	755 000	694	668
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 5,40 % 01-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	431 000	431	407
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 5,70 % 28-02-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	402 000	399	385
CIFI Holdings (Group) Co. Ltd. 6,00 % 16-07-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	837 000 USD	271	81
Clean Harbors Inc. 6,38 % 01-02-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 131 000 USD	1 516	1 494
Clearway Energy Group LLC 3,75 % 15-02-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	122 000 USD	144	131
Clearway Energy LLC 3,75 % 15-01-2032 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	190 000 USD	241	201
The Clorox Co. 1,80 % 15-05-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	329 000 USD	363	354
Clydesdale Acquisition Holdings Inc. 8,75 % 15-04-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	819 000 USD	963	955
Coast Capital Savings Federal Credit Union, taux variable 02-05-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	330 000	330	319
Coinbase Global Inc. 3,63 % 01-10-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 054 000 USD	797	956
Cologix Data Centers Issuer LLC 4,94 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	1 640 000	1 639	1 476
Cologix Data Centers Issuer LLC 5,68 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	1 310 000	1 310	1 169
Columbia Care Inc. 6,00 % 29-06-2025, conv.	Canada	Sociétés – Convertibles	1 361 000 USD	1 597	1 432
Columbia Care Inc. 9,50 % 03-02-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 160 000 USD	1 462	1 355
CommScope Inc. 4,75 % 01-09-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 415 000 USD	1 542	1 407
CommScope Technologies Finance LLC 8,25 % 01-03-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	88 000 USD	110	79
Continental Resources Inc. 4,90 % 01-06-2044, rachetables 2043	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 998 000 USD	2 048	1 996
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	355 538	340	322
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-09-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	364 373	347	330
Corus Entertainment Inc. 5,00 % 11-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 923 000	1 440	1 297
Country Garden Holdings Co. Ltd. 2,70 % 12-07-2026	Chine	Sociétés – Non convertibles	1 550 000 USD	1 329	141
Country Garden Holdings Co. Ltd. 5,63 % 14-01-2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	2 036 000 USD	1 684	179
Covert Mergeco Inc. 4,88 % 01-12-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	464 000 USD	549	517
CPIB Capital Inc. 1,95 % 30-09-2029	Canada	Gouvernement fédéral	785 000	713	675
Crocs Inc. 4,13 % 15-08-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	202 000 USD	228	213
Fonds de placement immobilier Crombie 3,13 % 12-08-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	73 000	61	58
Crown Americas LLC 5,25 % 01-04-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 230 000 USD	1 575	1 547
CSC Holdings LLC 5,75 % 15-01-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	380 000 USD	271	289
Curaleaf Holdings Inc. 8,00 % 15-12-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 590 000 USD	3 320	2 910
Dana Inc. 4,25 % 01-09-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	281 000 USD	321	305
République fédérale d'Allemagne, obligations indexées sur l'inflation, 0,10 % 15-04-2046	Allemagne	Gouvernements étrangers	1 700 000 EUR	4 171	2 774
Devon Energy Corp. 4,50 % 15-01-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	392 000 USD	500	483
Diamond Sports Group LLC 5,38 % 15-08-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	949 000 USD	68	32
Diamond Sports Group LLC 6,63 % 15-08-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	830 000 USD	21	24
Diamondback Energy Inc. 3,50 % 01-12-2029, rachetables 2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	778 000 USD	962	940
Digi International Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-11-2028	États-Unis	Prêts à terme	474 375 USD	589	644
DISH DBS Corp. 5,25 % 01-12-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 659 000 USD	1 796	1 911
DISH Network Corp. 11,75 % 15-11-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	661 000 USD	867	905
Dispatch Terra Acquisition LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 25-03-2028	États-Unis	Prêts à terme	700 084 USD	867	879

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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>					
Dollarama inc. 5,53 % 26-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	230 000	230	230
Domtar Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-10-2028	Canada	Prêts à terme	196 516 USD	242	267
Domtar Corp. 6,75 % 01-10-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 302 000 USD	2 909	2 592
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 1,66 % 22-12-2025 (A)	Canada	Sociétés – Non convertibles	294 000	266	267
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,54 % 07-12-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	155 000	155	139
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,06 % 17-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	176 000	154	152
DS Parent Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 10-12-2028	États-Unis	Prêts à terme	360 750 USD	442	485
East West Manufacturing LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 05-01-2029	États-Unis	Prêts à terme	550 349 USD	693	648
Eldorado Gold Corp. 6,25 % 01-09-2029 144A	Turquie	Sociétés – Non convertibles	522 000 USD	649	612
Electrical Components International Inc., prêt à terme de second rang, taux variable 22-06-2026	États-Unis	Prêts à terme	224 280 USD	235	247
Electronic Arts Inc. 2,95 % 15-02-2051	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 055 000 USD	2 864	2 530
Embeta Corp. 5,00 % 15-02-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	776 000 USD	952	830
Emera Inc., taux variable 15-06-2076, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	720 000 USD	949	942
L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie 3,63 % 17-04-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	45 000	36	35
Empresas CMPC SA 3,00 % 06-04-2031	Chili	Sociétés – Non convertibles	475 000 USD	535	513
Enbridge Gas Inc. 2,37 % 09-08-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	269 000	242	231
Enbridge Gas Inc. 3,01 % 09-08-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	247 000	181	165
Enbridge Gas Inc. 3,20 % 15-09-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	90 000	86	62
Enbridge Gas Inc. 4,55 % 17-08-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	82 000	81	72
Enbridge Inc. 4,90 % 26-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	124 000	124	120
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 825 000	10 054	9 760
Enbridge Inc., taux variable 12-04-2078, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 684 000	2 637	2 527
Enbridge Inc., taux variable 15-01-2084	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 469 000	5 469	5 490
Enel Finance International NV 5,00 % 15-06-2032 144A	Italie	Sociétés – Non convertibles	240 000 USD	292	296
Enel SPA 2,25 % 12-07-2031 144A	Italie	Sociétés – Non convertibles	178 000 USD	180	183
Ensign Drilling Inc. 9,25 % 15-04-2024 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 694 000 USD	2 193	2 293
EPCOR Utilities Inc. 3,55 % 27-11-2047, rachetables 2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	643 000	535	488
EPCOR Utilities Inc. 3,11 % 08-07-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	710 000	542	491
EPCOR Utilities Inc. 4,73 % 02-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	232 000	232	212
EPCOR Utilities Inc. 5,33 % 03-10-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	186 000	186	187
Evergreen AcqCo 1 LP, prêt à terme de premier rang, taux variable 26-03-2028	États-Unis	Prêts à terme	177 140 USD	224	242
Expedia Group Inc. 2,95 % 15-03-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	234 000 USD	248	256
Exxon Mobil Corp. 3,10 % 16-08-2049	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 737 000 USD	3 818	3 351
FAGE International SA 5,63 % 15-08-2026 144A	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	805 000 USD	1 021	1 059
Fair Isaac Corp. 4,00 % 15-06-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	541 000 USD	648	661
Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,23 % 14-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 086 000	1 002	983
Fairfax Financial Holdings Ltd. 3,95 % 03-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	692 000	615	583
Fairfax India Holdings Corp. 5,00 % 26-02-2028 144A	Inde	Sociétés – Non convertibles	1 936 000 USD	2 185	2 260
Fédération des caisses Desjardins du Québec 5,20 % 01-10-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	373 000	373	368
Fédération des caisses Desjardins du Québec 1,59 % 10-09-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	81 000	71	72
Fédération des caisses Desjardins du Québec 4,41 % 19-05-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	284 000	284	271
Fédération des caisses Desjardins du Québec 5,48 % 16-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	118 000	118	117
Fédération des caisses Desjardins du Québec, taux variable 23-08-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	488 000	488	465
Fonds de placement immobilier First Capital 3,45 % 01-03-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	150 000	133	130
First West Credit Union 9,19 % 09-08-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	165 000	165	163
Flynn America LP, prêt à terme B de premier rang, taux variable 23-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	986 549 USD	1 231	1 272
Ford Motor Co. 3,25 % 12-02-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 253 000 USD	1 294	1 312
Ford Motor Credit Co. LLC 2,70 % 10-08-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	895 000 USD	1 079	1 084
Fortified Trust 1,96 % 23-10-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	476 000	476	426
Fortis Inc. 4,43 % 31-05-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	386 000	386	365
Frontera Generation Holdings LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 28-07-2026	États-Unis	Prêts à terme	98 391 USD	33	33
Frontera Generation Holdings LLC, prêt à terme de second rang, taux variable 26-04-2028	États-Unis	Prêts à terme	95 503 USD	3	3
Frontier Communications Corp. 6,75 % 01-05-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	109 000 USD	128	114
FXI Holdings Inc. 7,88 % 01-11-2024 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	196 000 USD	240	254

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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>					
Corporation de Sécurité Garda World 6,00 % 01-06-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 310 000 USD	1 515	1 457
Gartner Inc. 3,63 % 15-06-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 318 000 USD	2 720	2 708
General Motors Co. 6,80 % 01-10-2027, rachetables 2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	411 000 USD	580	570
Financière General Motors du Canada Ltée 5,20 % 09-02-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	145 000	145	139
GFL Environmental Inc. 3,75 % 01-08-2025 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	583 000 USD	751	748
GFL Environmental Inc. 5,13 % 15-12-2026 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	613 000 USD	807	793
GFL Environmental Inc. 4,00 % 01-08-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	420 000 USD	499	496
GFL Environmental Inc. 3,50 % 01-09-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	519 000 USD	634	607
Gibson Energy Inc., taux variable 22-12-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 293 000	1 943	1 872
Gibson Energy Inc., taux variable 12-07-2083	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 202 000	2 204	2 205
GOL Linhas aéreas inteligentes SA 8,00 % 30-06-2026 144A	Brésil	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	255	144
The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 30-11-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	464 000	464	419
Gouvernement de l'Australie 1,75 % 21-06-2051	Australie	Gouvernements étrangers	4 600 000 AUD	2 485	2 135
Gouvernement des Bahamas 6,00 % 21-11-2028, rachetables 2028	Bahamas	Gouvernements étrangers	1 002 000 USD	1 029	1 123
Gouvernement des Bahamas 6,95 % 20-11-2029	Bahamas	Gouvernements étrangers	15 000 USD	15	17
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2029	Brésil	Gouvernements étrangers	1 500 000 BRL	3 456	3 851
Gouvernement du Canada 3,75 % 01-02-2025	Canada	Gouvernement fédéral	100 000	99	98
Gouvernement du Canada 3,75 % 01-05-2025	Canada	Gouvernement fédéral	3 000	3	3
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-06-2033	Canada	Gouvernement fédéral	7 822 000	7 419	7 028
Gouvernement du Canada 0,50 % 01-12-2050, rendement réel	Canada	Gouvernement fédéral	3 449 000	4 621	2 836
Gouvernement du Canada 1,75 % 01-12-2053	Canada	Gouvernement fédéral	228 000	178	144
Gouvernement de l'Allemagne 0 % 15-08-2052	Allemagne	Gouvernements étrangers	4 170 000 EUR	4 522	2 574
Gouvernement du Japon 0 % 02-10-2023	Japon	Gouvernements étrangers	204 000 000 JPY	1 915	1 853
Fiducie de placement immobilier Granite 2,19 % 30-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	381 000	330	319
Fiducie de placement immobilier Granite 2,38 % 18-12-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	31 000	26	24
Gray Escrow Inc. 7,00 % 15-05-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	396 000 USD	482	462
Gray Television Inc. 5,38 % 15-11-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 062 000 USD	1 316	942
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 1,54 % 03-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	447 000	394	384
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 6,47 % 02-02-2034, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	46 000	53	50
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 3,15 % 05-10-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	35 000	28	25
Greenfire Resources Inc. 12,00 % 01-10-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	580 000 USD	771	776
Fonds de placement immobilier H&R					
4,07 % 16-06-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	861 000	834	826
Hasbro Inc. 3,55 % 19-11-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	928 000 USD	1 161	1 177
HCA Healthcare Inc. 3,50 % 01-09-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	5 884 000 USD	6 903	6 789
Heartland Dental LLC 10,50 % 30-04-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	530 000 USD	709	725
Heathrow Funding Ltd. 3,79 % 04-09-2030, rachetables 2030	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	755 000	700	661
Heathrow Funding Ltd. 3,73 % 13-04-2033	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	161 000	167	133
Hilton Domestic Operating Co. Inc.					
4,88 % 15-01-2030, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	234 000 USD	284	290
Compagnie Home Trust 5,32 % 13-06-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	236 000	236	233
Honda Canada Finance Inc. 4,87 % 23-09-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	552 000	553	536
Honda Canada Finance Inc. 5,73 % 28-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	155 000	155	155
Hydro One Inc. 2,23 % 17-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000	210	202
Hydro One Ltd. 1,41 % 15-10-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	299 000	265	258
iA Société financière inc., taux variable 20-06-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	136 000	136	133
Innovative Industrial Properties Inc. 5,50 % 25-05-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	845 000 USD	969	1 031
Intact Corporation financière 5,46 % 22-09-2032 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	160 000 USD	212	206
Inter Pipeline Ltd. 3,48 % 16-12-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	60 000	56	56
Inter Pipeline Ltd. 4,23 % 01-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	229 000	224	215
Inter Pipeline Ltd. 5,76 % 17-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	151 000	151	149
Inter Pipeline Ltd. 5,71 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	156 000	156	150
Inter Pipeline Ltd., taux variable 26-03-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 067 000	3 913	3 755
Inter Pipeline Ltd., taux variable 19-11-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 204 000	1 133	1 086
Intergro Ltd., prêt à terme refinancé de premier rang, taux variable 31-10-2024	États-Unis	Prêts à terme	41 273 USD	52	53
Banque internationale pour la reconstruction et le développement 0 % 31-03-2027	Supranationales	s.o.	290 000 USD	351	352
International Game Technology PLC 2,38 % 15-04-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	898 000 EUR	1 215	1 147
Iris Merger Sub 2019 Inc. 9,38 % 15-02-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	516 000 USD	699	674
Iron Mountain Inc. 5,00 % 15-07-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	598 000 USD	748	741
Iron Mountain Inc. 5,25 % 15-07-2030, rachetables 2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	729 000 USD	890	866
Jabil Inc. 3,00 % 15-01-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 858 000 USD	2 128	2 046

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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>					
Jadex Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 12-02-2028	États-Unis	Prêts à terme	1 361 673 USD	1 650	1 747
Jaguar Land Rover Automotive PLC 4,50 % 01-10-2027 144A	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	395 000 USD	425	466
Jazz Pharmaceuticals PLC 4,38 % 15-01-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	240	238
Jones DesLauriers Insurance Management Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 28-07-2030	Canada	Prêts à terme	1 360 000 USD	1 787	1 858
Jones DesLauriers Insurance Management Inc. 8,50 % 15-03-2030 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	890 000 USD	1 210	1 216
Kaisa Group Holdings Ltd. 9,38 % 30-06-2024	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	128	16
Kaisa Group Holdings Ltd. 11,70 % 11-11-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	400 000 USD	60	33
Kaisa Group Holdings 8,65 % 27-10-2023	Chine	Sociétés – Non convertibles	900 000 USD	399	72
Kaisa Group Holdings 10,50 % 27-10-2023	Chine	Sociétés – Non convertibles	850 000 USD	582	68
Keyera Corp. 3,96 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	344 000	322	305
Keyera Corp., taux variable 13-06-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 044 000	3 878	3 754
Keyera Corp., taux variable 10-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 353 000	2 068	2 005
Kleopatra Finco SARL 4,25 % 01-03-2026	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	533 000 EUR	637	642
Knight Health Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 17-12-2028	États-Unis	Prêts à terme	953 025 USD	1 138	335
Kronos Acquisition Holdings Inc. 5,00 % 31-12-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	565 000 USD	699	698
Produits Kruger S.E.C. 6,00 % 24-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 936 000	2 831	2 830
Produits Kruger S.E.C. 5,38 % 09-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 107 000	958	949
LABL Escrow Issuer LLC 6,75 % 15-07-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	940 000 USD	1 223	1 237
LABL Escrow Issuer LLC 10,50 % 15-07-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	765 000 USD	961	976
LABL Inc. 8,25 % 01-11-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	991 000 USD	1 182	1 101
Lamb Weston Holdings Inc. 4,38 % 31-01-2032 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 193 000 USD	1 372	1 359
Banque Laurentienne du Canada, taux variable 15-06-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 077 000	827	820
Level 3 Financing Inc. 3,75 % 15-07-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	292 000 USD	197	221
Liberty Utilities (Canada) LP 3,32 % 14-02-2050, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	217 000	161	146
LifeScan Global Corp., prêt à terme de second rang, taux variable 31-12-2027	États-Unis	Prêts à terme	560 700 USD	487	476
LifeScan Global Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 31-12-2026	États-Unis	Prêts à terme	288 196 USD	285	313
Les Compagnies Loblaw ltée 4,49 % 11-12-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 069 000	1 043	1 024
Les Compagnies Loblaw ltée 2,28 % 07-05-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 129 000	965	933
Les Compagnies Loblaw ltée 5,34 % 13-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	152 000	152	144
Logan Group Co. Ltd. 4,70 % 06-07-2026	Chine	Sociétés – Non convertibles	2 747 000 USD	2 162	270
Lower Mattagami Energy LP 2,43 % 14-05-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	223 000	197	184
LRS Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 13-08-2028	États-Unis	Prêts à terme	1 049 852 USD	1 349	1 404
Luxembourg Investment Co. 428 SARL, prêt à terme B de premier rang, taux variable 22-10-2028	Luxembourg	Prêts à terme	734 593 USD	896	733
Magenta Buyer LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 03-05-2028	États-Unis	Prêts à terme	123 175 USD	136	125
Magenta Buyer LLC, prêt à terme de second rang, taux variable 03-05-2029	États-Unis	Prêts à terme	358 850 USD	374	235
Manchester Acquisition Sub LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 16-11-2026	États-Unis	Prêts à terme	835 125 USD	991	1 047
Société Financière Manuvie, taux variable 12-05-2030, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	254 000	240	239
Société Financière Manuvie, taux variable 10-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	419 000	419	407
Société Financière Manuvie 3,38 % 19-06-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 210 000	2 642	2 344
Société Financière Manuvie, taux variable 19-03-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	964 000	770	702
Société Financière Manuvie, taux variable 19-06-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 034 000	1 998	1 954
MARB BondCo PLC 3,95 % 29-01-2031	Brésil	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	208	202
Marriott International Inc. 4,90 % 15-04-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 000 000 USD	2 625	2 589
Mattamy Group Corp. 4,63 % 01-03-2030, rachetables 2025 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	950 000 USD	1 061	1 099
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 7,88 % 15-08-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	268	262
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 9,25 % 15-04-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	607 000 USD	751	722
Mav Acquisition Corp. 5,75 % 01-08-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 279 000 USD	1 487	1 507
McDonald's Corp. 2,13 % 01-03-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 320 000 USD	1 492	1 470
MEDNAX Inc. 5,38 % 15-02-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	376 000 USD	419	451
MEG Energy Corp. 7,13 % 01-02-2027, rachetables 2023 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	22 000 USD	30	31
MEG Energy Corp. 5,88 % 01-02-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 209 000 USD	1 570	1 535
Merck & Co. Inc. 5,13 % 30-04-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	393 000 USD	455	428
Mexico Remittances Funding Fiduciary Estate Management SARL 4,88 % 15-01-2028	Mexique	Sociétés – Non convertibles	1 008 900 USD	1 225	1 232

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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>					
Micron Technology Inc. 5,38 % 15-04-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 955 000 USD	2 612	2 564
Microsoft Corp. 3,45 % 08-08-2036	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 021 000 USD	2 469	2 316
Microsoft Corp. 2,53 % 01-06-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	9 121 000 USD	8 740	7 630
Minerva Luxembourg SA 8,88 % 13-09-2033	Brésil	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	273	270
Minerva Merger Sub Inc. 6,50 % 15-02-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	985 000 USD	1 253	1 118
Molina Healthcare Inc. 3,88 % 15-05-2032 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	300 000 USD	371	328
Moody's Corp. 2,00 % 19-08-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 075 000 USD	1 121	1 133
Mozart Debt Merger Sub Inc. 5,25 % 01-10-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 066 000 USD	1 340	1 252
MSCI Inc. 3,25 % 15-08-2033 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 118 000 USD	2 319	2 221
Banque Nationale du Canada 5,22 % 14-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	398 000	397	388
Banque Nationale du Canada, taux variable 16-08-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	482 000	482	466
Banque Nationale du Canada, taux variable 15-08-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 099 000	831	816
Nestlé Holdings Inc. 2,19 % 26-01-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	248 000	248	214
North West Redwater Partnership Co. Ltd. 2,80 % 01-06-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	498 000	438	413
Northland Power Inc., taux variable 30-06-2083	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 750 000	2 723	2 779
Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc. 4,11 % 31-03-2042	Canada	Sociétés – Non convertibles	566 332	503	465
NuVista Energy Ltd. 7,88 % 23-07-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 231 000	1 258	1 248
NVIDIA Corp. 3,50 % 01-04-2050, rachetables 2049	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 868 000 USD	2 060	1 854
OMERS Finance Trust 1,55 % 21-04-2027	Canada	Gouvernements provinciaux	1 906 000	1 754	1 699
Ontario Power Generation Inc. 2,89 % 08-04-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	208 000	200	200
Régime de retraite des enseignantes et des enseignants de l'Ontario 4,45 % 02-06-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	243 000	242	235
Open Text Corp. 3,88 % 01-12-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	838 000 USD	991	937
Open Text Holdings Inc. 4,13 % 01-12-2031 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	731 000 USD	813	795
Oracle Corp. 2,88 % 25-03-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	859 000 USD	925	957
Owens & Minor Inc. 6,63 % 01-04-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	790 000 USD	993	955
Corporation Parkland du Canada 3,88 % 16-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 130 000	2 912	2 900
Corporation Parkland du Canada 4,38 % 26-03-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 041 000	4 431	4 396
Corporation Pétroles Parkland 5,88 % 15-07-2027 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	107 000 USD	140	138
Corporation Pétroles Parkland 6,00 % 23-06-2028, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 849 000	2 786	2 720
Pattern Energy Operations LP 4,50 % 15-08-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	351 000 USD	440	417
Pembina Pipeline Corp., taux variable 25-01-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 211 000	3 476	3 395
Perrigo Co. PLC 3,15 % 15-06-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	376 000 USD	429	438
Petróleos de Venezuela SA 6,00 % 16-05-2024	Venezuela	Sociétés – Non convertibles	1 667 148 USD	93	133
Petróleos Mexicanos 6,70 % 16-02-2032	Mexique	Sociétés – Non convertibles	1 220 000 USD	1 367	1 228
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 4,65 % 19-05-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	745 000 USD	1 003	969
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 4,75 % 19-05-2033	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	229 000 USD	308	295
PharmaCann LLC 12,00 % 30-06-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	895 000 USD	1 161	1 159
Pilgrim's Pride Corp. 4,25 % 15-04-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	709 000 USD	831	804
Pilgrim's Pride Corp. 3,50 % 01-03-2032 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	754 000 USD	824	793
Pioneer Natural Resources Co. 2,15 % 15-01-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 868 000 USD	2 021	2 002
Prime Structured Mortgage Trust 1,86 % 15-11-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	247 000	247	236
Province de l'Alberta 3,10 % 01-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	2 500 000	2 386	1 849
Province de la Colombie-Britannique 2,95 % 18-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	1 682 000	1 371	1 211
Province du Manitoba 3,80 % 05-09-2053	Canada	Gouvernements provinciaux	460 000	430	381
Province de l'Ontario 4,05 % 02-02-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	1 616 000	1 615	1 540
Province de l'Ontario 4,15 % 02-12-2054	Canada	Gouvernements provinciaux	851 000	812	768
Province de Québec 3,65 % 20-05-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	936 000	912	865
Province de la Saskatchewan 3,10 % 02-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	1 780 000	1 445	1 317
Province de la Saskatchewan 2,80 % 02-12-2052	Canada	Gouvernements provinciaux	1 272 000	990	875
Quasar Intermediate Holdings Ltd., prêt à terme B de premier rang, taux variable 20-01-2029	États-Unis	Prêts à terme	742 500 USD	919	844
Resolute Investment Managers Inc., prêt à terme de second rang, taux variable 30-04-2025	États-Unis	Prêts à terme	354 538 USD	319	205
Resolute Investment Managers Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 30-04-2024	États-Unis	Prêts à terme	709 384 USD	698	608
Fonds de placement immobilier RioCan 2,83 % 08-11-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	415 000	375	350
Fonds de placement immobilier RioCan 5,96 % 01-10-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	232 000	232	225
Rogers Communications Inc. 5,70 % 21-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	434 000	433	429
Rogers Communications Inc. 3,75 % 15-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 250 000	1 188	1 123
Rogers Communications Inc. 2,90 % 09-12-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	849 000	714	693

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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>					
Rogers Communications Inc. 5,25 % 15-04-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	107 000	106	92
Rogers Communications Inc., taux variable 17-12-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 999 000	1 999	1 811
Rogers Communications Inc., taux variable 15-03-2082 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 310 000 USD	6 663	6 389
Banque Royale du Canada 5,34 % 23-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	274 000	274	271
Banque Royale du Canada 5,24 % 02-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	389 000	390	384
Banque Royale du Canada 2,33 % 28-01-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	328 000	295	295
Banque Royale du Canada 4,61 % 26-07-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	331 000	331	318
Banque Royale du Canada 4,64 % 17-01-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	486 000	486	466
Banque Royale du Canada 4,63 % 01-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	230 000	230	220
Banque Royale du Canada, taux variable 03-11-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	375 000	370	332
Banque Royale du Canada, taux variable 01-02-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	263 000	263	250
Banque Royale du Canada, taux variable 24-11-2080, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 544 000	1 447	1 436
Banque Royale du Canada, taux variable 24-02-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	787 000	697	695
Banque MI Canada, taux variable 24-11-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 240 000	3 620	3 089
Métaux Russel Inc. 6,00 % 16-03-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	920 000	911	913
Sabre Global Inc. 8,63 % 01-06-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	708 000 USD	817	818
Sagen MI Canada Inc. 3,26 % 05-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	262 000	219	205
Sagen MI Canada Inc., taux variable 24-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	194 000	161	162
Schlumberger Holdings Corp. 3,90 % 17-05-2028, rachetables 2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 682 000 USD	2 109	2 132
Schweitzer-Mauduit International, prêt à terme B de premier rang, taux variable 20-04-2028	États-Unis	Prêts à terme	840 396 USD	1 091	1 129
Sealed Air Corp. 6,13 % 01-02-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	570 000 USD	759	752
Sealed Air Corp. 5,00 % 15-04-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	960 000 USD	1 200	1 174
Secure Acquisition Inc., prêt à terme à prélèvement différé de premier rang, taux variable 15-12-2028	États-Unis	Prêts à terme	85 345 USD	109	115
Secure Acquisition Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 15-12-2028	États-Unis	Prêts à terme	566 035 USD	719	764
Secure Acquisition Inc., prêt à terme de second rang, taux variable 15-12-2029	États-Unis	Prêts à terme	310 000 USD	388	379
Secure Energy Services Inc. 7,25 % 30-12-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 183 000	2 191	2 158
Sienna Senior Living Inc. 3,11 % 04-11-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	179 000	171	172
Sienna Senior Living Inc. 3,45 % 27-02-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	164 000	154	152
Silgan Holdings Inc. 4,13 % 01-02-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	792 000 USD	994	965
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	1 872 000 USD	958	100
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 4,75 % 14-01-2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	400 000 USD	129	29
Sorenson Communications LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 12-03-2026	États-Unis	Prêts à terme	335 800 USD	429	437
Source Energy Services Canada LP 10,50 % 15-03-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 688 000	2 968	3 185
South Coast British Columbia Transportation Authority 1,60 % 03-07-2030	Canada	Administrations municipales	441 000	385	362
Spa Holdings 3 Oy 4,88 % 04-02-2028 144A	Finlande	Sociétés – Non convertibles	822 000 USD	933	934
Specialty Pharma III Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 24-02-2028	États-Unis	Prêts à terme	622 753 USD	789	828
Financière Sun Life inc., taux variable 13-08-2029, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	456 000	438	442
Financière Sun Life inc., taux variable 21-11-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	470 000	470	403
Financière Sun Life inc., taux variable 10-08-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	166 000	166	156
Financière Sun Life inc., taux variable 04-07-2035	Canada	Sociétés – Non convertibles	98 000	98	95
Financière Sun Life inc., taux variable 01-10-2035	Canada	Sociétés – Non convertibles	419 000	340	323
Financière Sun Life inc., taux variable 30-06-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 778 000	2 313	2 066
Sunac China Holdings Ltd. 5,95 % 26-04-2024	Chine	Sociétés – Non convertibles	835 000 USD	305	150
Sunac China Holdings Ltd. 6,50 % 10-01-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	1 269 000 USD	379	227
Suncor Énergie Inc. 3,75 % 04-03-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 468 000 USD	3 472	3 161
Suncor Énergie Inc. 3,95 % 04-03-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	67 000	52	49
Supérieur Plus S.E.C. 4,25 % 18-05-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 468 000	3 100	3 074
Supérieur Plus S.E.C. 4,50 % 15-03-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	935 000 USD	1 127	1 105
Suzano Austria GmbH 2,50 % 15-09-2028	Brésil	Sociétés – Non convertibles	270 000 USD	309	307
Tacora Resources Inc. 8,25 % 15-05-2026 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	381 000 USD	391	283
Tamarack Valley Energy Ltd. 7,25 % 10-05-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 540 000	2 457	2 418
TELUS Corp. 3,30 % 02-05-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 320 000	1 194	1 168
TELUS Corp. 3,15 % 19-02-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 159 000	1 054	997

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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>					
TELUS Corp. 2,05 % 07-10-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 196 000	2 551	2 503
TELUS Corp. 2,85 % 13-11-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	185 000	154	149
TELUS Corp. 4,95 % 28-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	128 000	128	118
Tenet Health 6,13 % 01-10-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 782 000 USD	2 279	2 272
Tenet Healthcare Corp. 4,38 % 15-01-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	960 000 USD	1 206	1 123
Tenet Healthcare 4,88 % 01-01-2026, rachetables	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	448 000 USD	589	583
Tenet Healthcare 4,25 % 01-06-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 044 000 USD	1 254	1 223
Teranet Holdings LP 3,72 % 23-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	489 000	489	432
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 5,13 % 09-05-2029	Israël	Sociétés – Non convertibles	456 000 USD	567	562
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 8,13 % 15-09-2031	Israël	Sociétés – Non convertibles	1 250 000 USD	1 721	1 756
Timber Servicios Empresariales SA, prêt à terme B de premier rang, taux variable 29-03-2029	Espagne	Prêts à terme	472 000 EUR	671	640
T-Mobile USA Inc. 4,75 % 01-02-2028, rachetables 2023	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	808 000 USD	1 052	1 053
T-Mobile USA Inc. 2,55 % 15-02-2031, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	194 000 USD	220	210
T-Mobile USA Inc. 5,20 % 15-01-2033	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	244 000 USD	315	313
Groupe TMX Ltée 2,30 % 11-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	501 000	486	486
Groupe TMX Ltée 3,78 % 05-06-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	374 000	362	348
Groupe TMX Ltée 2,02 % 12-02-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	172 000	143	135
La Banque Toronto-Dominion 2,67 % 09-09-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	129 000	123	122
La Banque Toronto-Dominion 4,34 % 27-01-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	332 000	332	322
La Banque Toronto-Dominion 5,42 % 10-07-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	233 000	233	231
La Banque Toronto-Dominion 2,26 % 07-01-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	199 000	199	179
La Banque Toronto-Dominion 5,38 % 21-10-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	261 000	261	257
La Banque Toronto-Dominion 4,48 % 18-01-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	449 000	449	427
La Banque Toronto-Dominion 5,49 % 08-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	389 000	389	385
La Banque Toronto-Dominion 4,68 % 08-01-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 294 000	1 268	1 235
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 22-04-2030, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 842 000	1 780	1 757
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-10-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 326 000	2 736	2 424
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-10-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 400 000	1 400	1 356
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-10-2170	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 700 000	1 700	1 415
Tourmaline Oil Corp. 2,53 % 12-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 956 000	1 700	1 674
TransCanada PipeLines Ltd. 5,28 % 15-07-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	427 000	427	411
TransCanada PipeLines Ltd. 4,20 % 04-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	727 000	588	553
TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	7 132 000	6 397	6 241
Transurban Finance Co. Pty. Ltd. 4,56 % 14-11-2028, rachetables 2028	Australie	Sociétés – Non convertibles	791 000	772	739
TRC Cos. Inc., prêt à terme de second rang, taux variable 19-11-2029	États-Unis	Prêts à terme	460 000 USD	576	593
Trulieve Cannabis Corp. 9,75 % 18-06-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 966 000 USD	2 500	2 619
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,50 % 15-04-2024	États-Unis	Gouvernements étrangers	6 940 000 USD	11 059	11 225
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2032	États-Unis	Gouvernements étrangers	5 900 000 USD	8 857	7 407
Obligations du Trésor des États-Unis 1,88 % 15-02-2032	États-Unis	Gouvernements étrangers	3 500 000 USD	4 024	3 861
Obligations du Trésor des États-Unis 2,75 % 15-08-2032	États-Unis	Gouvernements étrangers	589 000 USD	734	692
Obligations du Trésor des États-Unis 2,38 % 15-02-2042	États-Unis	Gouvernements étrangers	1 742 000 USD	1 912	1 634
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2051	États-Unis	Gouvernements étrangers	10 280 000 USD	16 537	9 144
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052	États-Unis	Gouvernements étrangers	11 800 000 USD	12 100	9 682
Obligations du Trésor des États-Unis 3,00 % 15-08-2052	États-Unis	Gouvernements étrangers	276 000 USD	331	273
Univision Communications Inc. 7,38 % 30-06-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	400 000 USD	504	496
UPC Broadband Finco BV 4,88 % 15-07-2031 144A	Pays-Bas	Sociétés – Non convertibles	778 000 USD	906	856
Upfield BV, prêt à terme B de premier rang, taux variable 31-01-2028	Pays-Bas	Prêts à terme	1 198 400 EUR	1 665	1 683
US Foods Inc. 4,75 % 15-02-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	709 000 USD	878	862
US Radiology Specialists Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 15-12-2027	États-Unis	Prêts à terme	191 357 USD	241	253
U.S. Renal Care Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 14-06-2026	États-Unis	Prêts à terme	118 765 USD	105	81
Administration de l'aéroport de Vancouver 1,76 % 20-09-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	77 000	65	62
Vector WP Holdco LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 08-10-2028	États-Unis	Prêts à terme	776 175 USD	954	1 046
Ventas Canada Finance Ltd. 5,40 % 21-04-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	287 000	287	278

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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>					
Verano Holdings Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 30-10-2026	États-Unis	Prêts à terme	1 534 000 USD	2 010	2 082
Verizon Communications Inc. 2,38 % 22-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 272 000	2 025	1 973
Vermilion Energy Inc. 6,88 % 01-05-2030 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 558 000 USD	1 918	2 011
Vesta Energy Corp. 10 % 15-10-2025 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	860 000	845	839
Viasat Inc. 6,50 % 15-07-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	493 000 USD	522	464
Vidéotron ltée 5,63 % 15-06-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 730 000	4 704	4 676
Vidéotron ltée 5,75 % 15-01-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	773 000	765	760
Vidéotron ltée 3,63 % 15-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 582 000	3 154	3 129
Vidéotron ltée 4,50 % 15-01-2030, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 023 000	1 787	1 765
Virgin Media Secured Finance PLC 4,50 % 15-08-2030, rachetables 2025 144A	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	330 000 USD	384	369
Visa Inc. 2,00 % 15-08-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 737 000 USD	3 187	2 799
VistaJet Malta Finance PLC 9,50 % 01-06-2028 144A	Suisse	Sociétés – Non convertibles	350 000 USD	469	419
Walmart Inc. 2,38 % 24-09-2029, rachetables 2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	69 000 USD	83	82
Waste Management of Canada Corp. 2,60 % 23-09-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	669 000	625	617
WDB Holding PA Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 18-12-2024	États-Unis	Prêts à terme	349 825 USD	420	380
Weatherford International Ltd. 8,63 % 30-04-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	750 000 USD	1 017	1 025
Wells Fargo & Co. 2,98 % 19-05-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	317 000	300	295
Wells Fargo & Co. 2,49 % 18-02-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	319 000	292	286
Welltower Inc. 2,95 % 15-01-2027, rachetables 2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	114 000	104	102
Welltower Inc. 4,25 % 15-04-2028, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	312 000 USD	400	395
Whole Earth Brands Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 02-02-2026	États-Unis	Prêts à terme	845 534 USD	960	1 049
WildBrain Ltd. 5,88 % 30-09-2024, conv.	Canada	Sociétés – Convertibles	434 000	408	401
Women's Care Holdings Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 15-01-2028	États-Unis	Prêts à terme	375 888 USD	469	456
Zoetis Inc. 2,00 % 15-05-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	295 000 USD	324	321
<b>Total des obligations</b>				<b>613 661</b>	<b>569 102</b>
<b>ACTIONS</b>					
AbbVie Inc.	États-Unis	Soins de santé	31 337	4 459	6 341
Mines Agnico Eagle Ltée	Canada	Matériaux	136 969	9 859	8 454
AIA Group Ltd.	Hong Kong	Services financiers	236 283	2 659	2 595
Air Liquide SA	France	Matériaux	21 799	2 877	4 987
Alimentation Couche-Tard inc.	Canada	Consommation de base	110 071	5 271	7 593
Alphabet Inc., cat. A	États-Unis	Services de communication	65 885	5 375	11 704
Altria Group Inc.	États-Unis	Consommation de base	76 934	4 255	4 392
Amadeus IT Group SA	Espagne	Consommation discrétionnaire	59 168	4 999	4 840
Amazon.com Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	52 992	4 842	9 145
American Addiction Centers Holdings Inc.	États-Unis	Soins de santé	42 347	282	287
American Tower Corp., cat. A	États-Unis	Biens immobiliers	16 051	5 745	3 583
Aon PLC	États-Unis	Services financiers	17 788	5 388	7 829
Apple Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	41 936	3 284	9 747
ARC Resources Ltd.	Canada	Énergie	131 290	1 328	2 846
AstraZeneca PLC	Royaume-Uni	Soins de santé	39 620	7 264	7 239
Atlas Copco AB, A	Suède	Produits industriels	172 733	1 555	3 142
AutoZone Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	963	3 462	3 320
Banque de Montréal	Canada	Services financiers	236 159	26 761	27 058
La Banque de Nouvelle-Écosse	Canada	Services financiers	191 268	12 738	11 644
Société aurifère Barrick	Canada	Matériaux	342 757	8 614	6 763
BCE Inc., priv., série AA	Canada	Services de communication	12 068	218	182
BCE Inc., priv., série AI	Canada	Services de communication	15 539	234	216
BCE Inc., priv., série AL	Canada	Services de communication	37 216	603	581
BCE Inc. 4,54 %, à div. cumulatif rachetable, priv. de premier rang, série R, rachetables	Canada	Services de communication	15 363	223	220
Becton, Dickinson and Co.	États-Unis	Soins de santé	22 187	4 692	7 787
Boralex inc., cat. A	Canada	Services publics	49 779	1 857	1 453
Broadcom Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	10 033	4 098	11 312

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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 46	Canada	Biens immobiliers	44 067	886	776
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 48	Canada	Biens immobiliers	17 721	388	327
Brookfield Asset Management Inc.	Canada	Services financiers	92 542	3 130	4 188
Brookfield Corp., cat. A (\$ CA)	Canada	Services financiers	185 860	8 284	7 893
Brookfield Infrastructure Partners L.P.	Canada	Services publics	140 082	6 576	5 584
Brookfield Renewable Partners L.P., priv., série 13	Canada	Services publics	5 121	109	95
CAE Inc.	Canada	Produits industriels	196 868	5 938	6 243
Calfrac Well Services Ltd.	Canada	Énergie	20 055	328	112
Fonds de placement immobilier d'immeubles résidentiels canadien	Canada	Biens immobiliers	28 162	1 250	1 270
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	Canada	Produits industriels	102 239	13 472	15 038
Canadian Natural Resources Ltd.	Canada	Énergie	280 025	18 406	24 596
Canadian Pacific Kansas City Ltd.	Canada	Produits industriels	186 004	16 060	18 778
CCL Industries Inc., cat. B, sans droit de vote	Canada	Matériaux	163 010	9 711	9 293
Cenovus Energy Inc., priv., série 3	Canada	Énergie	13 846	270	267
Cenovus Energy Inc., priv., série 7	Canada	Énergie	16 821	338	316
Cenovus Energy Inc. 4,45 % 31-12-2049, priv., série 1	Canada	Énergie	9 190	126	110
Groupe CGI inc.	Canada	Technologie de l'information	66 156	6 996	8 857
Chevron Corp.	États-Unis	Énergie	50 353	7 423	11 526
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix	Canada	Biens immobiliers	258 874	3 643	3 283
CME Group Inc.	États-Unis	Services financiers	28 087	4 827	7 634
Cogeco Communications inc.	Canada	Services de communication	35 507	3 402	2 232
Colgate-Palmolive Co.	États-Unis	Consommation de base	35 925	3 664	3 468
Corteva Inc.	États-Unis	Matériaux	46 309	2 126	3 216
CRH PLC	Irlande	Matériaux	44 354	3 158	3 295
DBS Group Holdings Ltd.	Singapour	Services financiers	136 700	4 247	4 557
Deutsche Börse AG	Allemagne	Services financiers	37 144	5 287	8 715
Diageo PLC	Royaume-Uni	Consommation de base	53 760	2 305	2 692
Dollarama inc.	Canada	Consommation discrétionnaire	33 899	2 179	3 172
Emera Inc., priv., série J	Canada	Services publics	51 451	1 132	906
Emera Inc.	Canada	Services publics	139 529	7 511	6 616
Enbridge Inc.	Canada	Énergie	308 707	14 632	13 907
Equifax Inc.	États-Unis	Produits industriels	9 535	1 500	2 371
Eurofins Scientific	Luxembourg	Soins de santé	22 309	1 279	1 708
Fairfax Financial Holdings Ltd., priv., série E	Canada	Services financiers	17 494	253	243
Fairfax Financial Holdings Ltd., priv., série F	Canada	Services financiers	12 238	207	196
Finning International Inc.	Canada	Produits industriels	110 975	2 965	4 446
Fortis Inc.	Canada	Services publics	63 548	3 167	3 278
Frontera Generation Holdings LLC	États-Unis	Énergie	6 992	17	18
Glencore PLC	Australie	Matériaux	436 922	3 721	3 393
Fiducie de placement immobilier Granite	Canada	Biens immobiliers	36 635	2 864	2 641
HDFC Bank Ltd.	Inde	Services financiers	136 842	3 808	3 395
Heineken Holding NV, A	Pays-Bas	Consommation de base	35 422	3 807	3 619
Honeywell International Inc.	États-Unis	Produits industriels	26 006	4 030	6 522
Hoya Corp.	Japon	Soins de santé	21 700	2 983	3 036
Intact Corporation financière	Canada	Services financiers	97 302	14 684	19 267
Intelsat Jackson Holdings SA, A, bons de souscription éch. 05-12-2025	Luxembourg	Services de communication	219	2	2
Intelsat Jackson Holdings SA, B, bons de souscription éch. 05-12-2025	Luxembourg	Services de communication	219	2	1
Intelsat Jackson Holdings SA	Luxembourg	Services de communication	2 099	67	73
iQor US Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	3 757	38	8
ITOCHU Corp.	Japon	Produits industriels	69 200	3 637	3 394
Japan Exchange Group Inc.	Japon	Services financiers	168 153	3 434	4 234
Johnson & Johnson	États-Unis	Soins de santé	44 080	6 655	9 320
JPMorgan Chase & Co.	États-Unis	Services financiers	50 564	6 704	9 954
Kenvue Inc.	États-Unis	Consommation de base	85 480	2 910	2 330
Keyence Corp.	Japon	Technologie de l'information	7 130	2 746	3 598
Kweichow Moutai Co. Ltd., cat. A	Chine	Consommation de base	6 190	2 212	2 087
Lam Research Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	5 565	4 143	4 735
Linde PLC (Bourse de New York)	Royaume-Uni	Matériaux	9 271	2 348	4 686
Les Compagnies Loblaw Itée	Canada	Consommation de base	97 040	10 318	11 198
Les Compagnies Loblaw Itée 5,30 %, à div. cumulatif rachetable, priv. de second rang, Série B	Canada	Consommation de base	25 434	565	521
L'Oréal SA	France	Consommation de base	3 337	1 836	1 876

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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>ACTIONS (suite)</b>					
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	France	Consommation discrétionnaire	3 899	1 974	3 993
Magna International Inc.	Canada	Consommation discrétionnaire	75 701	6 608	5 510
Société Financière Manuvie, priv., série 13	Canada	Services financiers	26 016	462	520
Société Financière Manuvie	Canada	Services financiers	476 037	11 079	11 815
McDonald's Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	13 260	2 260	4 742
McKesson Corp.	États-Unis	Soins de santé	5 813	2 999	3 431
Meta Platforms Inc., cat. A	États-Unis	Services de communication	7 420	3 041	3 024
Microsoft Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	46 012	5 901	19 721
Moody's Corp.	États-Unis	Services financiers	5 298	1 061	2 274
Motorola Solutions Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	19 266	4 710	7 120
Nestlé SA, nom.	États-Unis	Consommation de base	48 388	5 174	7 415
Northland Power Inc.	Canada	Services publics	199 716	7 058	4 418
Northrop Grumman Corp.	États-Unis	Produits industriels	6 623	4 451	3 958
Novo Nordisk AS, B	Danemark	Soins de santé	60 758	2 387	7 503
Nutrien Ltd.	Canada	Matériaux	132 632	10 459	11 125
NVIDIA Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	4 968	3 193	2 934
Open Text Corp.	Canada	Technologie de l'information	164 274	8 314	7 831
Oracle Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	20 188	3 133	2 903
Pembina Pipeline Corp.	Canada	Énergie	180 491	7 368	7 371
PepsiCo Inc.	États-Unis	Consommation de base	22 809	4 380	5 246
<sup>1</sup> Pernod Ricard SA	France	Consommation de base	11 445	2 026	2 586
Philip Morris International Inc.	États-Unis	Consommation de base	72 008	7 426	9 050
Polymetal International PLC	Russie	Matériaux	666	2	3
<sup>1</sup> Power Corporation du Canada, à droit de vote subalterne	Canada	Services financiers	154 234	4 625	5 333
Restaurant Brands International Inc.	Canada	Consommation discrétionnaire	74 221	6 292	6 713
Roche Holding AG Genussscheine	États-Unis	Soins de santé	18 225	6 340	6 747
Rogers Communications Inc., cat. B, sans droit de vote	Canada	Services de communication	90 739	5 331	4 732
Banque Royale du Canada	Canada	Services financiers	273 209	26 504	32 429
S&P Global Inc.	États-Unis	Services financiers	12 565	5 470	6 233
Safran SA	France	Produits industriels	31 651	3 656	6 718
SAP AG	Allemagne	Technologie de l'information	46 478	5 977	8 190
Schlumberger Ltd.	États-Unis	Énergie	62 589	2 355	4 953
Shell PLC (actions en livres sterling)	Pays-Bas	Énergie	154 648	5 751	6 667
The Sherwin-Williams Co.	États-Unis	Matériaux	8 630	1 517	2 988
Siemens AG	Allemagne	Produits industriels	12 903	2 919	2 511
Sika AG	Suisse	Matériaux	7 402	1 522	2 546
Sony Corp.	Japon	Consommation discrétionnaire	55 552	4 295	6 169
Source Energy Services Ltd.	Canada	Énergie	112 086	168	628
Starbucks Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	32 894	2 920	4 076
Financière Sun Life inc.	Canada	Services financiers	236 047	14 229	15 642
Suncor Énergie Inc.	Canada	Énergie	317 852	10 621	14 847
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	Taiwan	Technologie de l'information	287 000	7 612	6 329
Corporation TC Énergie	Canada	Énergie	305 675	17 252	14 278
Ressources Teck Ltée, cat. B	Canada	Matériaux	79 290	3 069	4 635
TELUS Corp.	Canada	Services de communication	638 904	16 377	14 171
TELUS International (Cda) Inc.	Philippines	Produits industriels	187 620	6 342	1 938
Texas Instruments Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	19 362	2 994	4 179
Thermo Fisher Scientific Inc.	États-Unis	Soins de santé	3 367	2 434	2 314
Thomson Reuters Corp.	Canada	Produits industriels	34 419	4 720	5 719
Toromont Industries Ltd.	Canada	Produits industriels	35 143	3 834	3 888
La Banque Toronto-Dominion	Canada	Services financiers	312 046	21 415	25 534
Tourmaline Oil Corp.	Canada	Énergie	84 486	4 789	5 775
TransAlta Corp., perpétuelles, priv., série C	Canada	Services publics	30 046	565	501
TransAlta Corp., priv., série A	Canada	Services publics	71 152	907	834
Union Pacific Corp.	États-Unis	Produits industriels	15 980	4 428	4 417
UnitedHealth Group Inc.	États-Unis	Soins de santé	8 347	5 827	5 713
Visa Inc., cat. A	États-Unis	Services financiers	24 649	3 451	7 696
Wal-Mart Stores Inc.	États-Unis	Consommation de base	20 165	4 003	4 378
WeWork Inc., cat. A	États-Unis	Biens immobiliers	27 466	665	112
The Williams Companies Inc.	États-Unis	Énergie	89 350	3 700	4 086
Wolters Kluwer NV	Pays-Bas	Produits industriels	24 903	2 673	4 094
<b>Total des actions</b>				<b>716 663</b>	<b>849 578</b>

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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>OPTIONS</b>					
Options achetées (se reporter au tableau des options achetées)				78	19
<b>Total des options</b>				<b>78</b>	<b>19</b>
<b>FONDS/BILLETS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>					
iShares S&P/TSX Global Gold Index ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	288 307	4 966	4 567
<sup>2</sup> FINB Obligations toutes sociétés canadiennes Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	66 500	6 003	5 826
<sup>2</sup> FINB Obligations à court terme canadiennes Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	63 600	6 021	5 963
<sup>2</sup> FINB Obligations de marchés émergents Mackenzie (couvert en \$ CA)	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	62 137	6 238	4 475
<sup>2</sup> FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	103 948	9 282	7 954
<sup>2</sup> FNB de revenu fixe à rendement élevé mondial Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	5 520 414	112 294	92 245
<sup>2</sup> FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	314 000	6 321	5 238
<sup>2</sup> FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	70 750	5 936	5 807
<b>Total des fonds/billets négociés en bourse</b>				<b>157 061</b>	<b>132 075</b>
<b>FONDS COMMUNS DE PLACEMENT</b>					
<sup>3</sup> Fonds à rendement absolu de titres de créance Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	1 616 813	16 298	13 147
<sup>3</sup> Fonds d'obligations tactique mondial Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	1 008 720	9 968	7 725
<sup>3</sup> Fonds d'obligations de sociétés nord-américaines Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	442 138	4 696	3 944
<b>Total des fonds communs de placement</b>				<b>30 962</b>	<b>24 816</b>
<b>FONDS PRIVÉS</b>					
<sup>4</sup> Sagard Credit Partners II LP	Canada	Services financiers	1 060	4 946	5 191
<b>Total des fonds privés</b>				<b>4 946</b>	<b>5 191</b>
Coûts de transaction				(716)	–
<b>Total des placements</b>				<b>1 522 655</b>	<b>1 580 781</b>
Instruments dérivés (se reporter au tableau des instruments dérivés)					1 921
Trésorerie et équivalents de trésorerie					24 506
Autres éléments d'actif moins le passif					8 063
<b>Actif net attribuable aux porteurs de titres</b>					<b>1 615 271</b>

<sup>1</sup> L'émetteur de ce titre est lié à Mackenzie. Voir note 1.

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

<sup>3</sup> Ce fonds est géré par Mackenzie.

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

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## APERÇU DU PORTEFEUILLE

30 SEPTEMBRE 2023

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Actions	53,3
Obligations	44,2
<i>Obligations</i>	43,8
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)</i>	0,2
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)</i>	0,2
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,7
Autres éléments d'actif (de passif)	0,8
Options sur swaps achetées	–

31 MARS 2023

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Actions	54,7
<i>Actions</i>	54,7
<i>Options achetées</i>	–
Obligations	41,7
<i>Obligations</i>	42,0
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)</i>	–
<i>Options achetées</i>	–
<i>Options vendues</i>	–
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)</i>	(0,3)
Autres éléments d'actif (de passif)	2,1
Trésorerie et placements à court terme	1,2
Fonds privés	0,3

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	47,4
États-Unis	35,8
Autre	3,4
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,7
Allemagne	1,6
France	1,6
Japon	1,5
Pays-Bas	1,4
Royaume-Uni	1,3
Autres éléments d'actif (de passif)	0,8
Luxembourg	0,7
Brésil	0,6
Danemark	0,5
Australie	0,5
Irlande	0,4
Mexique	0,4
Taiwan	0,4

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	45,9
États-Unis	35,4
Autre	4,0
Autres éléments d'actif (de passif)	2,1
France	1,7
Pays-Bas	1,7
Allemagne	1,6
Japon	1,4
Royaume-Uni	1,4
Trésorerie et placements à court terme	1,2
Luxembourg	0,9
Chine	0,6
Mexique	0,6
Danemark	0,5
Taiwan	0,5
Brésil	0,5

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	35,1
Services financiers	14,8
Énergie	6,9
Technologie de l'information	6,0
Produits industriels	5,8
Obligations d'État étrangères	5,2
Matériaux	4,3
Consommation de base	4,2
Soins de santé	3,8
Consommation discrétionnaire	3,2
Services de communication	2,2
Prêts à terme	2,1
Autre	1,7
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,7
Services publics	1,4
Obligations fédérales	0,8
Autres éléments d'actif (de passif)	0,8

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	33,0
Services financiers	15,4
Énergie	6,8
Produits industriels	6,2
Technologie de l'information	6,0
Matériaux	4,7
Obligations d'État étrangères	4,2
Soins de santé	4,0
Consommation de base	4,0
Consommation discrétionnaire	3,5
Prêts à terme	2,5
Services de communication	2,1
Autres éléments d'actif (de passif)	2,1
Services publics	1,5
Obligations fédérales	1,5
Autre	1,3
Trésorerie et placements à court terme	1,2

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

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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	23 456 000	Vente	20 décembre 2023	100,00 USD	78	19
<b>Total des options</b>					<b>78</b>	<b>19</b>

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS

au 30 septembre 2023

### 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 euro-OAT, décembre 2023	(126)	7 décembre 2023	127,41 EUR	(22 279)	760	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans, décembre 2023	(55)	13 décembre 2023	146,28 JPY	(72 429)	661	–
Contrats à terme standardisés à très long terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans, décembre 2023	(156)	19 décembre 2023	114,77 USD	(23 626)	679	–
Contrats à terme standardisés à très long terme sur obligations du Trésor américain, décembre 2023	(100)	19 décembre 2023	127,42 USD	(16 112)	1 185	–
				<b>(134 446)</b>	<b>3 285</b>	<b>–</b>

\* Le montant notionnel représente l'exposition aux instruments sous-jacents 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 \$)
A	3 367 CAD	(2 550) USD	6 octobre 2023	(3 367)	(3 461)	–	(94)
A	4 CAD	(4) AUD	18 octobre 2023	(4)	(4)	–	–
A	65 AUD	(57) CAD	18 octobre 2023	57	57	–	–
A	35 CAD	(40) AUD	18 octobre 2023	(35)	(35)	–	–
A	40 AUD	(35) CAD	18 octobre 2023	35	35	–	–
AA	2 055 CAD	(1 391) EUR	20 octobre 2023	(2 055)	(1 999)	56	–
AA	150 EUR	(213) CAD	20 octobre 2023	213	215	2	–
A	5 670 USD	(7 643) CAD	20 octobre 2023	7 643	7 697	54	–
A	3 100 CAD	(2 100) EUR	27 octobre 2023	(3 100)	(3 018)	82	–
A	9 779 CAD	(7 424) USD	27 octobre 2023	(9 779)	(10 078)	–	(299)
AA	21 870 CAD	(16 311) USD	27 octobre 2023	(21 870)	(22 143)	–	(273)
AA	11 683 CAD	(8 850) USD	3 novembre 2023	(11 683)	(12 013)	–	(330)
AA	36 045 CAD	(26 783) USD	3 novembre 2023	(36 045)	(36 358)	–	(313)
A	28 493 CAD	(20 953) USD	3 novembre 2023	(28 493)	(28 442)	51	–
AA	5 670 USD	(7 646) CAD	3 novembre 2023	7 646	7 697	51	–
A	11 340 USD	(15 282) CAD	3 novembre 2023	15 282	15 394	112	–
AA	4 260 USD	(5 772) CAD	3 novembre 2023	5 772	5 783	11	–
A	2 386 CAD	(2 716) AUD	8 novembre 2023	(2 386)	(2 373)	13	–
A	45 AUD	(39) CAD	8 novembre 2023	39	39	–	–
A	45 AUD	(39) CAD	8 novembre 2023	39	39	–	–
A	95 AUD	(83) CAD	8 novembre 2023	83	83	–	–
AA	22 223 CAD	(16 407) USD	9 novembre 2023	(22 223)	(22 269)	–	(46)
A	5 781 CAD	(4 270) USD	9 novembre 2023	(5 781)	(5 796)	–	(15)
A	2 351 CAD	(1 735) USD	9 novembre 2023	(2 351)	(2 355)	–	(4)
AA	5 670 USD	(7 644) CAD	9 novembre 2023	7 644	7 696	52	–
AA	5 670 USD	(7 641) CAD	9 novembre 2023	7 641	7 696	55	–
AA	72 903 CAD	(53 620) USD	12 janvier 2024	(72 903)	(72 694)	209	–
A	22 261 CAD	(16 360) USD	12 janvier 2024	(22 261)	(22 180)	81	–
A	20 229 CAD	(14 905) USD	12 janvier 2024	(20 229)	(20 207)	22	–
AA	40 483 CAD	(30 075) USD	19 janvier 2024	(40 483)	(40 771)	–	(288)
AA	52 399 CAD	(38 921) USD	19 janvier 2024	(52 399)	(52 763)	–	(364)
AA	11 101 CAD	(8 230) USD	25 janvier 2024	(11 101)	(11 156)	–	(55)
A	6 080 CAD	(4 225) EUR	26 janvier 2024	(6 080)	(6 091)	–	(11)
A	24 981 CAD	(18 523) USD	9 février 2024	(24 981)	(25 104)	–	(123)
<b>Total des contrats de change à terme de gré à gré</b>						<b>851</b>	<b>(2 215)</b>

Total des actifs dérivés

4 136

Total des passifs dérivés

(2 215)

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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 DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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 DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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 DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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 DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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 DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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 DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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 DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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 : 30 novembre 2005

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, B et T8 sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$ (5 000 \$ pour la série T8). Les investisseurs des séries A 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 investisseurs de série D désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année.

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

Les titres des séries F 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 la série F8); ils sont également proposés aux employés de Mackenzie et de ses filiales, et aux administrateurs de Mackenzie. Les investisseurs des séries F et F8 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % ou de 8 % par année, respectivement.

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

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

Les titres des séries PW, PWB 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 PW et PWT8 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % ou de 8 % par année, respectivement.

Les titres de série PWFB sont offerts à certains investisseurs à valeur nette élevée de nos Solutions Patrimoine privé qui investissent un minimum de 100 000 \$. Les investisseurs doivent négocier leurs honoraires de service du conseiller, lesquels ne peuvent dépasser 1,50 %, avec leur conseiller financier. Les investisseurs de série PWFB 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 des séries PWX et PWX8 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % ou de 8 % par année, respectivement.

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 des séries F5, GF, GF8, GLF, GO, GPW, GPWFB, GPWT8, GPWX, GW, GP, J5 et T5 ont été créés exclusivement afin de mettre en œuvre les fusions touchant le Fonds et ne sont pas offerts à la vente.

Les titres de série J ne sont plus 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, LW, LW5 et LX 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 LF ont été créés exclusivement afin de mettre en œuvre les fusions touchant le Fonds et ne sont pas offerts à la vente, sauf dans le cas d'achats supplémentaires effectués par des investisseurs qui détiennent ces titres depuis le 25 novembre 2021.

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.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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)

Série	Date d'établissement/ de rétablissement	Frais de gestion	Frais d'administration
Série A	19 décembre 2005	1,85 %	0,21 %
Série AR	17 octobre 2013	1,85 %	0,24 %
Série B	9 mai 2013	1,85 %	0,21 %
Série D	17 janvier 2014	0,85 % <sup>4)</sup>	0,16 %
Série DZ	13 août 2019	1,50 %	0,24 %
Série F	20 décembre 2005	0,70 %	0,15 %
Série F5	30 juillet 2021	0,70 %	0,15 %
Série F8	18 juillet 2013	0,70 %	0,15 %
Série FB	26 octobre 2015	0,85 %	0,21 %
Série GF	17 juin 2023	0,60 %	0,15 %
Série GF8	17 juin 2023	0,60 %	0,15 %
Série GLF	17 juin 2023	0,60 %	0,15 %
Série GO	17 juin 2023	–	0,15 %
Série GPW	17 juin 2023	1,60 %	–
Série GPWFB	17 juin 2023	0,60 %	0,15 %
Série GPWT8	17 juin 2023	1,60 %	0,15 %
Série GPWX	17 juin 2023	–	0,15 %
Série GW	17 juin 2023	1,60 %	0,15 %
Série J	29 novembre 2010	1,55 %	0,20 %
Série J5	30 juillet 2021	1,55 %	0,27 %
Série O	16 octobre 2009	– <sup>1)</sup>	s.o.
Série PW	9 octobre 2013	1,70 %	0,15 %
Série PWB	3 avril 2017	1,70 %	0,15 %
Série PWFB	3 avril 2017	0,70 %	0,15 %
Série PWR	1 <sup>er</sup> avril 2019	1,70 %	0,15 %
Série PWT8	4 novembre 2013	1,70 %	0,15 %
Série PWX	22 octobre 2013	– <sup>2)</sup>	– <sup>2)</sup>
Série PWX8	4 novembre 2013	– <sup>2)</sup>	– <sup>2)</sup>
Série R	6 juin 2023 <sup>3)</sup>	s.o.	s.o.
Série T5	30 juillet 2021	1,85 %	0,21 %
Série T8	9 mai 2013	1,85 %	0,21 %
Série LB	12 décembre 2012	1,85 %	0,21 %
Série LF	16 décembre 2021	0,70 %	0,15 %
Série LW	1 <sup>er</sup> décembre 2017	1,70 %	0,15 %
Série LW5	1 <sup>er</sup> décembre 2017	1,70 %	0,15 %
Série LX	3 février 2012	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) La date d'établissement initiale de la série est le 3 juillet 2007. Tous les titres de la série ont été rachetés le 24 septembre 2021. La série a été rétablie à un prix de 10,00 \$ le titre le 6 juin 2023.

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

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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	24 101	52 857
Valeur des biens reçus en garantie	25 437	55 585

	30 septembre 2023		30 septembre 2022	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
Revenus de prêts de titres bruts	119	100,0	114	100,0
Impôt retenu à la source	(13)	(10,9)	(15)	(13,2)
	106	89,1	99	86,8
Paiements à l'agent de prêt de titres	(19)	(16,0)	(20)	(17,5)
Revenu tiré du prêt de titres	87	73,1	79	69,3

#### d) Commissions

	(\$)
30 septembre 2023	56
30 septembre 2022	25

#### e) Risques découlant des instruments financiers

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

Le Fonds vise un revenu et une croissance du capital à long terme en investissant principalement dans des titres à revenu fixe et/ou des titres de participation axés sur le revenu partout dans le monde, mais il investit principalement en Amérique du Nord à l'heure actuelle. Selon la conjoncture économique et les évaluations relatives des conseillers en valeurs du Fonds, ce dernier investira généralement de 30 % à 70 % de son actif dans des titres de participation et dans des titres à revenu fixe, mais il peut investir jusqu'à 100 % de son actif dans l'une ou l'autre de ces catégories d'actifs.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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

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	582 730	20 523	(333 963)	269 290				
EUR	64 617	(553)	(10 133)	53 931				
JPY	22 284	(388)	661	22 557				
GBP	19 994	71	–	20 065				
CHF	16 708	–	–	16 708				
DKK	7 503	1	–	7 504				
NTD	6 329	–	–	6 329				
SGD	4 557	–	–	4 557				
BRL	3 851	–	–	3 851				
INR	3 395	–	–	3 395				
SEK	3 142	–	–	3 142				
HKD	2 595	18	–	2 613				
CNY	2 087	355	–	2 442				
AUD	2 135	–	(2 159)	(24)				
<b>Total</b>	<b>741 927</b>	<b>20 027</b>	<b>(345 594)</b>	<b>416 360</b>				
% de l'actif net	45,9	1,2	(21,4)	25,7				
<b>Total de la sensibilité aux variations des taux de change</b>					<b>(21 684)</b>	<b>(1,3)</b>	<b>21 684</b>	<b>1,3</b>

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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)

31 mars 2023

Devise	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Incidence sur l'actif net			
					Renforcement de 5 %		Affaiblissement de 5 %	
					(\$)	%	(\$)	%
USD	481 823	12 279	(213 542)	280 560				
EUR	72 232	2 501	(11 750)	62 983				
JPY	21 913	2 874	(2 403)	22 384				
GBP	19 064	–	–	19 064				
CHF	18 994	–	–	18 994				
DKK	8 494	–	–	8 494				
NTD	8 103	148	–	8 251				
SGD	4 783	–	–	4 783				
HKD	4 262	(6)	–	4 256				
BRL	3 614	–	–	3 614				
SEK	3 221	–	–	3 221				
INR	3 182	–	–	3 182				
CNY	2 214	347	–	2 561				
EGP	–	–	1 462	1 462				
AUD	2 716	–	(2 614)	102				
<b>Total</b>	<b>654 615</b>	<b>18 143</b>	<b>(228 847)</b>	<b>443 911</b>				
% de l'actif net	40,3	1,1	(14,1)	27,3				
<b>Total de la sensibilité aux variations des taux de change</b>					<b>(27 874)</b>	<b>(1,7)</b>	<b>27 874</b>	<b>1,7</b>

\* 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	21 001	(134 446)				
1 an à 5 ans	147 681	–				
5 ans à 10 ans	207 196	–				
Plus de 10 ans	193 224	–				
<b>Total</b>	<b>569 102</b>	<b>(134 446)</b>				
<b>Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt</b>			<b>(32 623)</b>	<b>(2,0)</b>	<b>32 689</b>	<b>2,0</b>

31 mars 2023	Obligations (\$)	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
			Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
			(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	2 753	(244 784)				
1 an à 5 ans	51 744	–				
5 ans à 10 ans	139 312	–				
Plus de 10 ans	147 117	–				
<b>Total</b>	<b>340 926</b>	<b>(244 784)</b>				
<b>Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt</b>			<b>(31 103)</b>	<b>(1,9)</b>	<b>31 296</b>	<b>1,9</b>

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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)

##### 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	86 257	5,3	(86 257)	(5,3)
31 mars 2023	89 534	5,5	(88 997)	(5,5)

##### v. Risque de crédit

Pour ce Fonds, la plus forte concentration du risque de crédit se trouve dans les titres de créance, tels que les obligations. La juste valeur des titres de créance tient compte de la solvabilité de l'émetteur de ces titres. L'exposition maximale à tout émetteur de titres de créance au 30 septembre 2023 était de 2,7 % de l'actif net du Fonds (2,0 % 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	1,8	2,4
AA	5,4	4,1
A	2,1	1,5
BBB	10,3	4,6
Inférieure à BBB	11,9	6,9
Sans note	3,7	1,5
Total	35,2	21,0

\* 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	401	568 701	–	569 102	–	340 926	–	340 926
Actions	708 611	140 578	389	849 578	715 095	154 612	–	869 707
Options	–	19	–	19	–	350	–	350
Fonds/billets négociés en bourse	132 075	–	–	132 075	137 567	–	–	137 567
Fonds communs de placement	24 816	–	–	24 816	242 846	–	–	242 846
Fonds privés	–	–	5 191	5 191	–	–	4 890	4 890
Actifs dérivés	3 285	851	–	4 136	1	1 193	–	1 194
Passifs dérivés	–	(2 215)	–	(2 215)	(5 298)	(1 655)	–	(6 953)
Placements à court terme	–	2 465	–	2 465	–	5 167	–	5 167
Total	869 188	710 399	5 580	1 585 167	1 090 211	500 593	4 890	1 595 694

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 DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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 (\$)	Obligations (\$)	Fonds privés (\$)	Total (\$)	Actions (\$)	Obligations (\$)	Fonds privés (\$)	Total (\$)
Solde, à l'ouverture	–	–	4 890	4 890	–	157	1 016	1 173
Achats	409	–	57	466	–	–	3 863	3 863
Ventes	–	–	–	–	–	(2 671)	–	(2 671)
Transferts entrants	–	–	–	–	–	–	–	–
Transferts sortants	–	–	–	–	–	–	–	–
Profits (pertes) au cours de la période :								
Réalisé(e)s	–	–	–	–	–	(5 817)	–	(5 817)
Latent(e)s	(20)	–	244	224	–	8 331	11	8 342
Solde, à la clôture	389	–	5 191	5 580	–	–	4 890	4 890
Variation des profits (pertes) latent(e)s au cours de la période attribuables aux titres détenus à la clôture de la période	(20)	–	244	224	–	–	11	11

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 Mackenzie 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	2 962	2 985
Autres fonds gérés par le gestionnaire	1	–
Fonds gérés par des sociétés affiliées au gestionnaire	–	–

#### 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	3 927	(128)	–	3 799
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(554)	128	–	(426)
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	3 373	–	–	3 373

  

	31 mars 2023			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	287	(287)	–	–
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(5 837)	287	13 174	7 624
Obligation pour options vendues	(202)	–	–	(202)
Total	(5 752)	–	13 174	7 422

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

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 (\$)
iShares S&P/TSX Global Gold Index ETF	0,5	4 567
FINB Obligations toutes sociétés canadiennes Mackenzie	1,5	5 826
FINB Obligations à court terme canadiennes Mackenzie	4,1	5 963
Fonds à rendement absolu de titres de créance Mackenzie, série R	13,2	13 147
FINB Obligations de marchés émergents Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,8	4 475
FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	1,7	7 954
FNB de revenu fixe à rendement élevé mondial Mackenzie	37,0	92 245
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	2,9	5 238
Fonds d'obligations tactique mondial Mackenzie, série R	3,0	7 725
Fonds d'obligations de sociétés nord-américaines Mackenzie, série R	0,4	3 944
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,2	5 807
Sagard Credit Partners II LP	0,9	5 191

31 mars 2023	% de l'actif net du Fonds sous-jacent	Juste valeur des placements du Fonds (\$)
iShares S&P/TSX Global Gold Index ETF	0,5	5 501
FINB Obligations toutes sociétés canadiennes Mackenzie	1,3	6 082
FINB Obligations à court terme canadiennes Mackenzie	2,8	6 099
SEC Mackenzie CL Revenu stratégique (Revenu fixe), série R	74,7	212 744
Fonds à rendement absolu de titres de créance Mackenzie, série R	11,5	13 836
FINB Obligations de marchés émergents Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,8	4 751
FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	1,9	8 432
FNB de revenu fixe à rendement élevé mondial Mackenzie	38,8	95 034
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	3,0	5 479
Fonds d'obligations tactique mondial Mackenzie, série R	2,8	8 182
Fonds international de dividendes Mackenzie, série R	0,7	4 032
Fonds d'obligations de sociétés nord-américaines Mackenzie, série R	0,4	4 052
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,2	6 189
Sagard Credit Partners II LP	1,4	4 890

#### j) Engagement

	30 septembre 2023		31 mars 2023	
	Montant appelé (\$ US)	Engagement d'investissement total (\$ US)	Montant appelé (\$ US)	Engagement d'investissement total (\$ US)
Sagard Credit Partners II LP <sup>1)</sup>	3 607	10 600	3 607	10 600

<sup>1)</sup> Ce fonds est géré par Sagard Holdings Inc., une société affiliée à Mackenzie.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

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

#### k) Fusion de fonds

La fusion du Mandat privé équilibré de revenu Mackenzie (le « Fonds dissous ») avec le Fonds a eu lieu le 16 juin 2023. Cette fusion a été réalisée avec report d'impôt. Puisque le Fonds dissous investissait la totalité de son actif net dans la série R du Fonds avant la fusion, la fusion a été effectuée en échangeant 13 399 titres de série R contre d'autres titres du Fonds à la juste valeur de marché, donnant lieu à un transfert d'actif net au Fonds de 34 \$.

Séries du Fonds dissous	Séries du Fonds	Titres émis
Série LF	Série GLF	770
Série LW	Série GW	122
Série O	Série GO	40
Série PW	Série GPW	3 172
Série PWF	Série GF	4 068
Série PWF8	Série GF8	174
Série PWFB	Série GPWFB	183
Série PWT8	Série GPWT8	103
Série PWX	Série GPWX	339

Par suite de la fusion, le Fonds dissous a été fermé. Les charges engagées dans le cadre de la fusion ont été acquittées par Mackenzie.