

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

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



# FONDS GLOBAL MACRO 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)
	\$	\$
<b>ACTIF</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements à la juste valeur	79 501	50 520
Trésorerie et équivalents de trésorerie	459 298	397 608
Intérêts courus à recevoir	60	42
Sommes à recevoir pour placements vendus	–	–
Sommes à recevoir pour titres émis	–	83
Marge sur instruments dérivés	22 199	32 090
Actifs dérivés	56 354	33 509
<b>Total de l'actif</b>	<b>617 412</b>	<b>513 852</b>
<b>PASSIF</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Sommes à payer pour placements achetés	1	5
Sommes à payer pour titres rachetés	1	–
Sommes à payer au gestionnaire	1	1
Passifs dérivés	52 117	24 965
<b>Total du passif</b>	<b>52 120</b>	<b>24 971</b>
<b>Actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>565 292</b>	<b>488 881</b>

	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)
Série A	10,60	9,89	687	445
Série F	10,78	10,06	17 576	18 665
Série FB	10,76	10,04	4	1
Série IG	10,20	9,52	365 348	290 331
Série O	10,84	10,11	1 040	746
Série PW	10,65	9,93	461	545
Série PWFB	10,79	10,06	8	8
Série PWX	10,83	10,11	502	561
Série R	10,83	10,11	179 666	177 579
			<b>565 292</b>	<b>488 881</b>

## ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

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

	2023 \$	2022 \$
<b>Revenus</b>		
Dividendes	333	506
Revenus d'intérêts aux fins de distribution	11 467	3 296
Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets		
Profit (perte) net(te) réalisé(e)	32 361	2 074
Profit (perte) net(te) latent(e)	4 080	28 812
Revenu tiré du prêt de titres	14	5
Revenu provenant des rabais sur les frais	–	12
<b>Total des revenus (pertes)</b>	<b>48 255</b>	<b>34 705</b>
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	107	26
Frais d'administration	16	3
Intérêts débiteurs	71	28
Commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille	130	136
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
<b>Charges avant les montants absorbés par le gestionnaire</b>	<b>325</b>	<b>194</b>
Charges absorbées par le gestionnaire	–	–
<b>Charges nettes</b>	<b>325</b>	<b>194</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, avant impôt</b>	<b>47 930</b>	<b>34 511</b>
Charge (économie) d'impôt étranger retenu à la source	59	26
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>47 871</b>	<b>34 485</b>

	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
Série A	0,78	0,62	50	13
Série F	0,86	1,57	1 498	355
Série FB	0,69	0,71	–	–
Série IG	0,90	0,74	30 140	21 670
Série O	0,93	0,87	51	119
Série PW	0,78	0,91	35	92
Série PWFB	0,91	0,71	–	1
Série PWX	0,96	0,66	46	106
Série R	0,94	0,86	16 051	12 129
			<b>47 871</b>	<b>34 485</b>

# FONDS GLOBAL MACRO 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 F		Série FB		Série IG	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
À l'ouverture	488 881	373 001	445	169	18 665	642	1	1	290 331	263 006
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	47 871	34 485	50	13	1 498	355	–	–	30 140	21 670
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(11 161)	(3 334)	(5)	–	(251)	(11)	–	–	(7 232)	(2 161)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	(11 161)	(3 334)	(5)	–	(251)	(11)	–	–	(7 232)	(2 161)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	92 242	94 416	519	45	976	5 149	3	–	79 608	11 557
Réinvestissement des distributions	7 515	2 198	5	–	249	11	–	–	7 232	2 161
Paiements au rachat de titres	(60 056)	(26 993)	(327)	(41)	(3 561)	(277)	–	–	(34 731)	(10 144)
Total des opérations sur les titres	39 701	69 621	197	4	(2 336)	4 883	3	–	52 109	3 574
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	76 411	100 772	242	17	(1 089)	5 227	3	–	75 017	23 083
À la clôture	565 292	473 773	687	186	17 576	5 869	4	1	365 348	286 089
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>										
Titres en circulation, à l'ouverture			Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres
Émis			45	18	1 855	67	–	–	30 508	28 888
Réinvestissement des distributions			52	4	95	529	–	–	8 148	1 274
Rachetés			–	–	24	1	–	–	726	228
Titres en circulation, à la clôture			(32)	(4)	(344)	(29)	–	–	(3 566)	(1 091)
			65	18	1 630	568	–	–	35 816	29 299

  

	Série O		Série PW		Série PWFB		Série PWX		Série R	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
À l'ouverture	746	134	545	352	8	7	561	1	177 579	108 689
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	51	119	35	92	–	1	46	106	16 051	12 129
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(15)	(13)	(4)	–	–	–	(10)	(13)	(3 644)	(1 136)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	(15)	(13)	(4)	–	–	–	(10)	(13)	(3 644)	(1 136)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	601	3 479	242	1 954	3	–	58	5 311	10 232	66 921
Réinvestissement des distributions	15	13	4	–	–	–	10	13	–	–
Paiements au rachat de titres	(358)	(1 435)	(361)	(289)	(3)	–	(163)	(3 202)	(20 552)	(11 605)
Total des opérations sur les titres	258	2 057	(115)	1 665	–	–	(95)	2 122	(10 320)	55 316
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	294	2 163	(84)	1 757	–	1	(59)	2 215	2 087	66 309
À la clôture	1 040	2 297	461	2 109	8	8	502	2 216	179 666	174 998
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>										
Titres en circulation, à l'ouverture			Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres	Titres
Émis			74	14	55	37	55	–	17 569	11 240
Réinvestissement des distributions			56	350	23	200	6	547	954	6 823
Rachetés			1	1	–	–	1	1	–	–
Titres en circulation, à la clôture			(35)	(144)	(35)	(30)	(16)	(334)	(1 939)	(1 189)
			96	221	43	207	1	214	16 584	16 874

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS GLOBAL MACRO 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	47 871	34 485
Ajustements pour :		
Perte (profit) net(te) réalisé(e) sur les placements	11 183	1 682
Variation de la perte (du profit) net(te) latent(e) sur les placements	(4 080)	(28 812)
Achat de placements	(45 427)	(42 049)
Produit de la vente et de l'échéance de placements	13 644	86 429
(Augmentation) diminution des sommes à recevoir et autres actifs	9 873	8 463
<b>Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités d'exploitation</b>	<b>33 064</b>	<b>60 198</b>
<b>Flux de trésorerie liés aux activités de financement</b>		
Produit de l'émission de titres	92 079	93 999
Paiements au rachat de titres	(59 809)	(26 968)
Distributions versées, déduction faite des réinvestissements	(3 646)	(1 136)
<b>Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités de financement</b>	<b>28 624</b>	<b>65 895</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>	<b>61 688</b>	<b>126 093</b>
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à l'ouverture	397 608	248 847
Incidence des fluctuations des taux de change sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie	2	846
<b>Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture</b>	<b>459 298</b>	<b>375 786</b>
Trésorerie	3 114	2 499
Équivalents de trésorerie	456 184	373 287
<b>Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture</b>	<b>459 298</b>	<b>375 786</b>
<b>Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :</b>		
Dividendes reçus	333	506
Impôts étrangers payés	59	26
Intérêts reçus	11 449	3 275
Intérêts versés	71	28

# FONDS GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES PLACEMENTS

au 30 septembre 2023

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OPTIONS</b>					
Options achetées (se reporter au tableau des options achetées)				10 918	12 567
<b>Total des options</b>				<b>10 918</b>	<b>12 567</b>
<b>FONDS/BILLETS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>					
SPDR Bloomberg High Yield Bond ETF				28 400	3 480
SPDR S&P Oil & Gas Exploration & Production ETF				184 800	34 486
<b>Total des fonds/billets négociés en bourse</b>				<b>37 966</b>	<b>40 591</b>
<b>FONDS COMMUNS DE PLACEMENT</b>					
<sup>1</sup>	Canada	Fonds communs de placement	1 327 534	24 122	26 343
<b>Total des fonds communs de placement</b>				<b>24 122</b>	<b>26 343</b>
Coûts de transaction				(23)	–
<b>Total des placements</b>				<b>72 983</b>	<b>79 501</b>
Instruments dérivés (se reporter au tableau des instruments dérivés)					
<sup>2</sup>	Trésorerie et équivalents de trésorerie				4 237
	Autres éléments d'actif moins le passif				459 298
<b>Actif net attribuable aux porteurs de titres</b>					<b>22 256</b>
					<b>565 292</b>

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

<sup>2</sup> Comprend 381 574 \$ détenus dans le Fonds du marché monétaire canadien Mackenzie, série R, un fonds géré par Mackenzie.

# FONDS GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## APERÇU DU PORTEFEUILLE

30 SEPTEMBRE 2023

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Autres éléments d'actif (de passif)	3,9	77,7	81,6
Trésorerie et équivalents de trésorerie *	29,7	–	29,7
Actions	19,9	(10,1)	9,8
<i>Actions</i>	6,6	–	6,6
<i>Options achetées</i>	2,2	–	2,2
<i>Contrats à terme standardisés</i>	11,1	(10,1)	1,0
Marchandises	7,3	(2,9)	4,4
<i>Marchandises</i>	4,7	–	4,7
<i>Contrats à terme standardisés</i>	2,6	(2,9)	(0,3)
Swaps	–	–	–
Obligations	37,9	(63,4)	(25,5)
<i>Obligations</i>	0,6	–	0,6
<i>Contrats à terme standardisés</i>	37,3	(63,4)	(26,1)

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Autres éléments d'actif (de passif)	3,9	77,7	81,6
Trésorerie et équivalents de trésorerie *	29,7	–	29,7
Allemagne	11,3	–	11,3
États-Unis	24,6	(16,3)	8,3
Canada	24,7	(17,1)	7,6
Italie	1,5	–	1,5
Espagne	0,9	–	0,9
Australie	1,7	(1,0)	0,7
Suède	0,2	–	0,2
Chine	0,2	–	0,2
France	–	(0,3)	(0,3)
Suisse	–	(0,5)	(0,5)
Mexique	–	(0,6)	(0,6)
Afrique du Sud	–	(1,2)	(1,2)
Royaume-Uni	–	(4,3)	(4,3)
Autre	–	(4,9)	(4,9)
Japon	–	(30,2)	(30,2)

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Autres éléments d'actif (de passif)	3,9	77,7	81,6
Trésorerie et équivalents de trésorerie *	29,7	–	29,7
Obligations fédérales	24,7	(15,6)	9,1
Énergie	6,6	–	6,6
Marchandises	4,7	–	4,7
Autre	2,2	–	2,2
Contrats à terme standardisés sur actions	11,1	(10,1)	1,0
Obligations de sociétés	0,6	–	0,6
Contrats à terme standardisés sur marchandises	2,6	(2,9)	(0,3)
Obligations d'État étrangères	12,6	(47,8)	(35,2)

31 MARS 2023

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Autres éléments d'actif (de passif)	10,1	75,9	86,0
Trésorerie et placements à court terme *	41,1	–	41,1
Marchandises	6,5	(1,9)	4,6
<i>Marchandises</i>	5,1	–	5,1
<i>Contrats à terme standardisés</i>	1,4	(1,9)	(0,5)
Swaps	–	–	–
Actions	16,1	(17,6)	(1,5)
<i>Actions</i>	3,6	–	3,6
<i>Options achetées</i>	1,6	–	1,6
<i>Contrats à terme standardisés</i>	10,9	(17,6)	(6,7)
Obligations	28,4	(58,6)	(30,2)
<i>Obligations</i>	21,6	–	21,6
<i>Contrats à terme standardisés</i>	6,8	(58,6)	(51,8)

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Autres éléments d'actif (de passif)	10,1	75,9	86,0
Trésorerie et placements à court terme *	41,1	–	41,1
Canada	21,6	(7,6)	14,0
Australie	7,4	–	7,4
États-Unis	15,5	(12,0)	3,5
Afrique du Sud	1,5	–	1,5
Italie	1,5	–	1,5
Espagne	0,9	–	0,9
France	0,1	–	0,1
Suède	–	(0,3)	(0,3)
Chine	–	(0,4)	(0,4)
Suisse	–	(1,5)	(1,5)
Mexique	–	(1,6)	(1,6)
Royaume-Uni	–	(2,3)	(2,3)
Allemagne	0,6	(9,5)	(8,9)
Autre	1,9	(11,3)	(9,4)
Japon	–	(31,6)	(31,6)

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Autres éléments d'actif (de passif)	10,1	75,9	86,0
Trésorerie et placements à court terme *	41,1	–	41,1
Obligations de sociétés	20,1	–	20,1
Marchandises	5,1	–	5,1
Énergie	3,6	–	3,6
Autre	1,6	–	1,6
Obligations provinciales	1,1	–	1,1
Obligations fédérales	0,4	–	0,4
Contrats à terme standardisés sur marchandises	1,4	(1,9)	(0,5)
Contrats à terme standardisés sur actions	10,9	(17,6)	(6,7)
Obligations – Contrats à terme standardisés	6,8	(58,6)	(51,8)

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

# FONDS GLOBAL MACRO 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 S&P 500	250	Vente	21 juin 2024	4 000,00 USD	4 787	4 135
Indice S&P 500	316	Vente	20 septembre 2024	4 175,00 USD	6 131	8 432
<b>Total des options</b>					<b>10 918</b>	<b>12 567</b>

# FONDS GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS

au 30 septembre 2023

### Tableau des contrats de swap

Note de crédit de la contrepartie	Nombre de contrats	Échéance	Rendement payé par le Fonds, en fonction de	Rendement reçu par le Fonds, en fonction de	Montant notionnel (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
AA	(203 700)	20 octobre 2023	Swap sur rendement excédentaire sur indice des produits de base 0,68 %	Trésorerie	56 805	–	(472)
<b>Total des contrats de swap</b>					<b>56 805</b>	<b>–</b>	<b>(472)</b>

### Tableau des contrats à terme standardisés

Type de contrat	Nombre de contrats	Date d'échéance	Prix moyen des contrats (\$)	Montant notionnel* (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
Contrats à terme standardisés sur le gazole à faible teneur en soufre, octobre 2023	5	12 octobre 2023	946,98 USD	680	33	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice CAC 40 (10 euros), octobre 2023	(15)	20 octobre 2023	7 197,00 EUR	(1 540)	–	(5)
Contrats à terme standardisés sur l'indice IBEX 35, octobre 2023	39	20 octobre 2023	9 349,00 EUR	5 284	51	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice OMXS30, octobre 2023	44	20 octobre 2023	2 184,51 SEK	1 181	–	(13)
Contrats à terme standardisés sur le gaz naturel, novembre 2023	(10)	27 octobre 2023	2,87 USD	(398)	–	(6)
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE China A50, octobre 2023	71	30 octobre 2023	12 515,49 USD	1 214	8	–
Contrats à terme standardisés sur le pétrole brut Brent, décembre 2023	2	31 octobre 2023	92,41 USD	250	–	(1)
Contrats à terme standardisés sur le carburant diesel à très faible teneur en soufre au port de New York, novembre 2023	(1)	31 octobre 2023	319,97 USD	(188)	–	(6)
Contrats à terme standardisés sur l'essence RBOB, novembre 2023	(9)	31 octobre 2023	250,88 USD	(1 231)	54	–
Contrats à terme standardisés sur le soja, novembre 2023	(5)	14 novembre 2023	1 308,97 USD	(433)	10	–
Contrats à terme standardisés sur le pétrole brut WTI, décembre 2023	10	20 novembre 2023	83,53 USD	1 205	68	–
Contrats à terme standardisés sur le coton n° 2, décembre 2023	3	6 décembre 2023	88,20 USD	177	–	(2)
Contrats à terme standardisés sur euro-obligations, décembre 2023	343	7 décembre 2023	130,90 EUR	63 328	–	(1 720)
Contrats à terme standardisés libellés en yens sur l'indice Nikkei 225, décembre 2023	(24)	7 décembre 2023	32 150,00 JPY	(3 469)	57	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans, décembre 2023	(128)	13 décembre 2023	145,78 JPY	(168 563)	1 280	–
Contrats à terme standardisés sur le maïs, décembre 2023	74	14 décembre 2023	481,73 USD	2 395	–	(59)
Contrats à terme standardisés sur le blé RVH de KC, décembre 2023	(90)	14 décembre 2023	749,60 USD	(4 055)	628	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice S&P/TSX 60, décembre 2023	(37)	14 décembre 2023	1 209,27 CAD	(8 705)	248	–
Contrats à terme standardisés sur la farine de soja, décembre 2023	58	14 décembre 2023	389,32 USD	3 001	–	(40)
Contrats à terme standardisés sur l'huile de soja, décembre 2023	(51)	14 décembre 2023	60,93 USD	(2 319)	190	–
Contrats à terme standardisés sur le blé (CBT), décembre 2023	103	14 décembre 2023	599,91 USD	3 786	–	(436)
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor australien à 10 ans, décembre 2023	98	15 décembre 2023	114,39 AUD	9 582	–	(199)
Contrats à terme standardisés sur l'indice CME E-Mini Standard & Poor's 500, décembre 2023	153	15 décembre 2023	4 473,39 USD	44 920	–	(381)
Contrats à terme standardisés sur l'indice DAX, décembre 2023	4	15 décembre 2023	15 860,00 EUR	2 228	–	(48)
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-Mini NASDAQ 100, décembre 2023	(32)	15 décembre 2023	15 161,61 USD	(12 916)	563	–



# FONDS GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2023

### Tableau des contrats à terme standardisés (suite)

Type de contrat	Nombre de contrats	Date d'échéance	Prix moyen des contrats (\$)	Montant notionnel* (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
Contrats à terme standardisés sur l'indice E-Mini Russell 2000, décembre 2023	(9)	15 décembre 2023	1 797,86 USD	(1 099)	–	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice Euro STOXX 50, décembre 2023	(137)	15 décembre 2023	4 220,15 EUR	(8 235)	103	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE 100, décembre 2023	(13)	15 décembre 2023	7 659,69 GBP	(1 652)	–	(77)
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE/MIB 100, décembre 2023	41	15 décembre 2023	28 505,00 EUR	8 322	–	(11)
Contrats à terme standardisés sur l'indice Bolsa Mexicana, décembre 2023	(89)	15 décembre 2023	52 716,95 MXN	(3 580)	91	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice MSCI Marchés émergents, décembre 2023	(23)	15 décembre 2023	964,40 USD	(1 492)	17	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice Swiss Market, décembre 2023	(18)	15 décembre 2023	11 055,00 CHF	(2 936)	3	–
Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 10 ans, décembre 2023	(788)	18 décembre 2023	117,79 CAD	(90 722)	2 253	–
Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 2 ans, décembre 2023	1 377	18 décembre 2023	102,12 CAD	140 241	–	(476)
Contrats à terme standardisés sur l'aluminium LME, décembre 2023	35	18 décembre 2023	2 199,75 USD	2 794	181	–
Contrats à terme standardisés sur le cuivre LME, décembre 2023	(2)	18 décembre 2023	8 291,00 USD	(561)	1	–
Contrats à terme standardisés sur le plomb LME, décembre 2023	(35)	18 décembre 2023	2 208,83 USD	(2 579)	53	–
Contrats à terme standardisés sur le zinc LME, décembre 2023	(18)	18 décembre 2023	2 488,88 USD	(1 620)	–	(102)
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor américain à 10 ans, décembre 2023	(560)	19 décembre 2023	109,80 USD	(82 149)	1 561	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE/JSE Top 40, décembre 2023	(136)	21 décembre 2023	69 190,90 ZAR	(6 581)	158	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice SPI 200, décembre 2023	(35)	21 décembre 2023	7 167,00 AUD	(5 414)	60	–
Contrats à terme standardisés sur l'or, 100 oz, décembre 2023	(12)	27 décembre 2023	1 939,86 USD	(3 040)	102	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du Royaume-Uni, décembre 2023	(146)	27 décembre 2023	94,72 GBP	(22 773)	88	–
Contrats à terme standardisés sur l'argent, décembre 2023	3	27 décembre 2023	23,20 USD	457	–	(15)
Contrats à terme standardisés sur le sucre n° 11 (monde), mars 2024	(22)	29 février 2024	26,42 USD	(886)	2	–
<b>Total des contrats à terme standardisés</b>				<b>(148 091)</b>	<b>7 863</b>	<b>(3 597)</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	580 USD	(1 179) AUD	19 octobre 2023	(787)	(749)	38	–
A	1 523 USD	(3 034) AUD	19 octobre 2023	(2 067)	(1 909)	158	–
A	325 USD	(644) AUD	19 octobre 2023	(441)	(405)	36	–
A	463 USD	(924) AUD	19 octobre 2023	(629)	(583)	46	–
A	633 USD	(1 262) AUD	19 octobre 2023	(859)	(796)	63	–
A	508 USD	(1 038) AUD	19 octobre 2023	(689)	(660)	29	–
A	3 202 AUD	(1 550) USD	19 octobre 2023	2 104	2 044	–	(60)
A	674 AUD	(323) USD	19 octobre 2023	438	431	–	(7)
A	947 AUD	(449) USD	19 octobre 2023	610	609	–	(1)
A	132 AUD	(63) USD	19 octobre 2023	86	85	–	(1)
A	187 AUD	(88) USD	19 octobre 2023	119	120	1	–

# FONDS GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2023

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	348 AUD	(165) USD	19 octobre 2023	224	225	1	–
A	694 AUD	(331) USD	19 octobre 2023	449	445	–	(4)
A	142 AUD	(67) USD	19 octobre 2023	91	91	–	–
A	1 489 BRL	(220) USD	19 octobre 2023	299	294	–	(5)
A	13 251 BRL	(1 993) USD	19 octobre 2023	2 706	2 602	–	(104)
A	29 973 BRL	(4 508) USD	19 octobre 2023	6 120	5 882	–	(238)
A	295 USD	(1 964) BRL	19 octobre 2023	(401)	(386)	15	–
A	2 523 BRL	(381) USD	19 octobre 2023	517	494	–	(23)
A	5 568 BRL	(842) USD	19 octobre 2023	1 143	1 091	–	(52)
A	3 831 BRL	(587) USD	19 octobre 2023	797	746	–	(51)
A	3 285 BRL	(500) USD	19 octobre 2023	679	642	–	(37)
A	6 526 BRL	(980) USD	19 octobre 2023	1 331	1 281	–	(50)
A	67 USD	(459) BRL	19 octobre 2023	(91)	(91)	–	–
A	55 USD	(368) BRL	19 octobre 2023	(74)	(73)	1	–
A	387 USD	(2 578) BRL	19 octobre 2023	(525)	(507)	18	–
A	894 BRL	(131) USD	19 octobre 2023	178	177	–	(1)
A	2 226 BRL	(329) USD	19 octobre 2023	447	439	–	(8)
A	201 USD	(1 334) BRL	19 octobre 2023	(273)	(261)	12	–
A	189 USD	(1 275) BRL	19 octobre 2023	(256)	(252)	4	–
A	6 072 USD	(10 835) CAD	19 octobre 2023	7 981	8 337	356	–
A	5 273 USD	(9 408) CAD	19 octobre 2023	6 930	7 239	309	–
A	313 USD	(559) CAD	19 octobre 2023	412	430	18	–
A	784 USD	(1 401) CAD	19 octobre 2023	1 032	1 076	44	–
A	259 USD	(464) CAD	19 octobre 2023	342	356	14	–
A	2 951 CAD	(1 638) USD	19 octobre 2023	(2 174)	(2 242)	–	(68)
A	2 413 CAD	(1 327) USD	19 octobre 2023	(1 777)	(1 810)	–	(33)
A	1 755 CAD	(960) USD	19 octobre 2023	(1 293)	(1 307)	–	(14)
A	961 CAD	(523) USD	19 octobre 2023	(708)	(710)	–	(2)
A	766 USD	(1 406) CAD	19 octobre 2023	1 036	1 042	6	–
A	593 USD	(1 099) CAD	19 octobre 2023	810	803	–	(7)
A	161 CAD	(88) USD	19 octobre 2023	(119)	(119)	–	–
A	1 048 CAD	(576) USD	19 octobre 2023	(772)	(785)	–	(13)
A	1 600 CAD	(874) USD	19 octobre 2023	(1 179)	(1 190)	–	(11)
A	597 720 CLP	(537) USD	19 octobre 2023	729	650	–	(79)
A	701 USD	(779 203) CLP	19 octobre 2023	(951)	(848)	103	–
A	303 179 CLP	(273) USD	19 octobre 2023	370	330	–	(40)
A	193 532 CLP	(173) USD	19 octobre 2023	235	211	–	(24)
A	132 873 CLP	(118) USD	19 octobre 2023	160	145	–	(15)
A	143 042 CLP	(126) USD	19 octobre 2023	171	157	–	(14)
A	51 USD	(58 692) CLP	19 octobre 2023	(69)	(65)	4	–
A	29 USD	(33 288) CLP	19 octobre 2023	(39)	(37)	2	–
A	84 USD	(97 802) CLP	19 octobre 2023	(114)	(109)	5	–
A	218 USD	(257 828) CLP	19 octobre 2023	(296)	(288)	8	–
A	99 USD	(115 051) CLP	19 octobre 2023	(134)	(128)	6	–
A	242 USD	(289 401) CLP	19 octobre 2023	(328)	(324)	4	–
A	349 447 CLP	(287) USD	19 octobre 2023	389	394	5	–
A	237 561 CLP	(198) USD	19 octobre 2023	269	266	–	(3)
A	137 USD	(168 232) CLP	19 octobre 2023	(186)	(189)	–	(3)
A	3 699 USD	(35 689) CNY	19 octobre 2023	(5 021)	(4 829)	192	–
A	4 626 USD	(44 635) CNY	19 octobre 2023	(6 280)	(6 040)	240	–
A	15 463 CNY	(1 599) USD	19 octobre 2023	2 170	2 095	–	(75)

# FONDS GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2023

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	1 435 USD	(13 879) CNY	19 octobre 2023	(1 948)	(1 880)	68	–
A	1 834 USD	(17 635) CNY	19 octobre 2023	(2 490)	(2 383)	107	–
A	21 913 CNY	(2 263) USD	19 octobre 2023	3 072	2 967	–	(105)
A	2 939 USD	(28 699) CNY	19 octobre 2023	(3 990)	(3 901)	89	–
A	538 USD	(5 317) CNY	19 octobre 2023	(730)	(726)	4	–
A	18 618 CNY	(1 882) USD	19 octobre 2023	2 555	2 542	–	(13)
A	835 USD	(8 254) CNY	19 octobre 2023	(1 134)	(1 127)	7	–
A	10 170 CNY	(1 022) USD	19 octobre 2023	1 388	1 391	3	–
A	112 USD	(1 112) CNY	19 octobre 2023	(152)	(152)	–	–
A	28 583 CNY	(2 886) USD	19 octobre 2023	3 918	3 905	–	(13)
A	1 326 USD	(13 160) CNY	19 octobre 2023	(1 800)	(1 799)	1	–
A	2 877 382 COP	(492) USD	19 octobre 2023	668	713	45	–
A	9 792 737 COP	(1 711) USD	19 octobre 2023	2 322	2 409	87	–
A	21 846 083 COP	(3 813) USD	19 octobre 2023	5 176	5 375	199	–
A	28 900 715 COP	(5 006) USD	19 octobre 2023	6 795	7 130	335	–
A	1 253 567 COP	(226) USD	19 octobre 2023	307	305	–	(2)
A	5 168 094 COP	(935) USD	19 octobre 2023	1 269	1 256	–	(13)
A	5 392 936 COP	(976) USD	19 octobre 2023	1 325	1 311	–	(14)
A	2 036 737 COP	(365) USD	19 octobre 2023	496	496	–	–
A	145 USD	(799 844) COP	19 octobre 2023	(197)	(194)	3	–
A	495 USD	(2 826 917) COP	19 octobre 2023	(672)	(695)	–	(23)
A	296 USD	(1 686 077) COP	19 octobre 2023	(402)	(413)	–	(11)
A	16 USD	(88 976) COP	19 octobre 2023	(22)	(22)	–	–
A	546 USD	(3 039 269) COP	19 octobre 2023	(741)	(741)	–	–
A	420 USD	(2 297 561) COP	19 octobre 2023	(570)	(557)	13	–
A	766 USD	(4 101 368) COP	19 octobre 2023	(1 040)	(985)	55	–
A	35 USD	(196 096) COP	19 octobre 2023	(48)	(48)	–	–
A	731 USD	(21 641) CZK	19 octobre 2023	(993)	(917)	76	–
A	1 216 USD	(35 451) CZK	19 octobre 2023	(1 651)	(1 493)	158	–
A	2 389 USD	(69 615) CZK	19 octobre 2023	(3 243)	(2 933)	310	–
A	8 105 CZK	(280) USD	19 octobre 2023	380	340	–	(40)
A	571 USD	(16 737) CZK	19 octobre 2023	(775)	(706)	69	–
A	664 USD	(19 690) CZK	19 octobre 2023	(901)	(836)	65	–
A	815 USD	(24 225) CZK	19 octobre 2023	(1 107)	(1 028)	79	–
A	1 264 USD	(37 806) CZK	19 octobre 2023	(1 716)	(1 609)	107	–
A	10 397 CZK	(346) USD	19 octobre 2023	470	442	–	(28)
A	839 CZK	(28) USD	19 octobre 2023	38	36	–	(2)
A	3 252 CZK	(108) USD	19 octobre 2023	147	138	–	(9)
A	26 518 CZK	(857) USD	19 octobre 2023	1 163	1 143	–	(20)
A	1 099 CZK	(35) USD	19 octobre 2023	48	48	–	–
A	5 321 CZK	(172) USD	19 octobre 2023	233	230	–	(3)
A	2 119 CZK	(68) USD	19 octobre 2023	92	92	–	–
A	2 561 EUR	(2 108) USD	19 octobre 2023	2 861	2 653	–	(208)
A	2 355 EUR	(1 938) USD	19 octobre 2023	2 631	2 442	–	(189)
A	1 067 EUR	(888) USD	19 octobre 2023	1 205	1 103	–	(102)
A	457 EUR	(376) USD	19 octobre 2023	511	473	–	(38)
A	394 EUR	(322) USD	19 octobre 2023	437	410	–	(27)
A	2 762 USD	(3 403) EUR	19 octobre 2023	(3 750)	(3 547)	203	–
A	1 304 USD	(1 601) EUR	19 octobre 2023	(1 770)	(1 667)	103	–
A	198 USD	(245) EUR	19 octobre 2023	(269)	(256)	13	–
A	552 USD	(690) EUR	19 octobre 2023	(750)	(722)	28	–

# FONDS GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2023

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	105 USD	(131) EUR	19 octobre 2023	(143)	(136)	7	–
A	1 194 EUR	(943) USD	19 octobre 2023	1 280	1 257	–	(23)
A	291 EUR	(231) USD	19 octobre 2023	313	307	–	(6)
A	305 USD	(386) EUR	19 octobre 2023	(414)	(408)	6	–
A	211 USD	(271) EUR	19 octobre 2023	(287)	(287)	–	–
A	242 USD	(253) GBP	19 octobre 2023	(328)	(301)	27	–
A	3 256 USD	(3 401) GBP	19 octobre 2023	(4 420)	(4 053)	367	–
A	107 GBP	(102) USD	19 octobre 2023	139	126	–	(13)
A	367 USD	(387) GBP	19 octobre 2023	(498)	(464)	34	–
A	274 GBP	(259) USD	19 octobre 2023	352	328	–	(24)
A	1 037 GBP	(975) USD	19 octobre 2023	1 323	1 244	–	(79)
A	1 845 USD	(1 966) GBP	19 octobre 2023	(2 504)	(2 361)	143	–
A	416 USD	(443) GBP	19 octobre 2023	(565)	(532)	33	–
A	343 USD	(365) GBP	19 octobre 2023	(465)	(439)	26	–
A	695 USD	(741) GBP	19 octobre 2023	(944)	(891)	53	–
A	698 GBP	(642) USD	19 octobre 2023	871	845	–	(26)
A	273 USD	(297) GBP	19 octobre 2023	(370)	(359)	11	–
A	441 USD	(482) GBP	19 octobre 2023	(598)	(585)	13	–
A	464 USD	(517) GBP	19 octobre 2023	(630)	(632)	–	(2)
A	26 046 166 IDR	(1 261) USD	19 octobre 2023	1 712	1 669	–	(43)
A	42 631 854 IDR	(2 098) USD	19 octobre 2023	2 848	2 717	–	(131)
A	29 918 015 IDR	(1 473) USD	19 octobre 2023	1 999	1 907	–	(92)
A	41 706 556 IDR	(2 051) USD	19 octobre 2023	2 784	2 658	–	(126)
A	1 201 USD	(24 479 436) IDR	19 octobre 2023	(1 631)	(1 561)	70	–
A	17 552 308 IDR	(859) USD	19 octobre 2023	1 166	1 120	–	(46)
A	20 080 219 IDR	(983) USD	19 octobre 2023	1 334	1 282	–	(52)
A	45 329 797 IDR	(2 200) USD	19 octobre 2023	2 987	2 902	–	(85)
A	45 329 797 IDR	(2 191) USD	19 octobre 2023	2 974	2 908	–	(66)
A	45 926 418 IDR	(2 223) USD	19 octobre 2023	3 018	2 945	–	(73)
A	172 USD	(3 571 608) IDR	19 octobre 2023	(233)	(230)	3	–
A	92 619 IDR	(4) USD	19 octobre 2023	6	6	–	–
A	253 USD	(5 231 554) IDR	19 octobre 2023	(344)	(336)	8	–
A	413 USD	(8 607 140) IDR	19 octobre 2023	(561)	(553)	8	–
A	4 559 087 IDR	(218) USD	19 octobre 2023	296	293	–	(3)
A	429 USD	(8 980 280) IDR	19 octobre 2023	(583)	(578)	5	–
A	248 USD	(5 211 683) IDR	19 octobre 2023	(336)	(336)	–	–
A	3 998 ILS	(810) USD	19 octobre 2023	1 100	1 031	–	(69)
A	5 220 USD	(25 742) ILS	19 octobre 2023	(7 086)	(6 641)	445	–
A	396 USD	(1 923) ILS	19 octobre 2023	(538)	(493)	45	–
A	614 USD	(3 001) ILS	19 octobre 2023	(833)	(771)	62	–
A	776 USD	(3 901) ILS	19 octobre 2023	(1 053)	(1 014)	39	–
A	126 USD	(620) ILS	19 octobre 2023	(171)	(160)	11	–
A	13 USD	(68) ILS	19 octobre 2023	(18)	(17)	1	–
A	986 ILS	(194) USD	19 octobre 2023	264	257	–	(7)
A	1 659 ILS	(323) USD	19 octobre 2023	439	435	–	(4)
A	355 ILS	(69) USD	19 octobre 2023	94	93	–	(1)
A	2 792 ILS	(536) USD	19 octobre 2023	727	735	8	–
A	396 USD	(2 043) ILS	19 octobre 2023	(537)	(536)	1	–
A	730 ILS	(141) USD	19 octobre 2023	192	192	–	–
A	25 USD	(131) ILS	19 octobre 2023	(34)	(34)	–	–
A	12 106 INR	(108) USD	19 octobre 2023	147	145	–	(2)

# FONDS GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2023

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)		Devise à remettre (en milliers de \$)		Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	168 093	INR	(1 505)	USD	19 octobre 2023	2 043	2 009	–	(34)
A	494 015	INR	(4 406)	USD	19 octobre 2023	5 981	5 913	–	(68)
A	17 872	INR	(159)	USD	19 octobre 2023	216	214	–	(2)
A	111 335	INR	(997)	USD	19 octobre 2023	1 353	1 330	–	(23)
A	138 628	INR	(1 244)	USD	19 octobre 2023	1 689	1 656	–	(33)
A	94 618	INR	(845)	USD	19 octobre 2023	1 147	1 132	–	(15)
A	2 216	USD	(249 249)	INR	19 octobre 2023	(3 008)	(2 986)	22	–
A	869	USD	(98 288)	INR	19 octobre 2023	(1 179)	(1 180)	–	(1)
A	1 232	USD	(139 198)	INR	19 octobre 2023	(1 673)	(1 671)	2	–
A	158	USD	(17 759)	INR	19 octobre 2023	(215)	(213)	2	–
A	9 901	INR	(88)	USD	19 octobre 2023	119	119	–	–
A	28 984	INR	(257)	USD	19 octobre 2023	349	347	–	(2)
A	8 529	INR	(76)	USD	19 octobre 2023	103	103	–	–
A	18 935	INR	(167)	USD	19 octobre 2023	227	227	–	–
A	119 488	JPY	(636)	USD	19 octobre 2023	863	781	–	(82)
A	62	USD	(11 468)	JPY	19 octobre 2023	(84)	(74)	10	–
A	1 147 596	JPY	(6 197)	USD	19 octobre 2023	8 412	7 455	–	(957)
A	297 906	JPY	(1 609)	USD	19 octobre 2023	2 184	1 936	–	(248)
A	603	USD	(111 904)	JPY	19 octobre 2023	(819)	(728)	91	–
A	131 722	JPY	(701)	USD	19 octobre 2023	952	861	–	(91)
A	42 581	JPY	(225)	USD	19 octobre 2023	306	279	–	(27)
A	70 847	JPY	(368)	USD	19 octobre 2023	500	467	–	(33)
A	126 488	JPY	(652)	USD	19 octobre 2023	885	837	–	(48)
A	30 867	JPY	(158)	USD	19 octobre 2023	215	205	–	(10)
A	80 954	JPY	(413)	USD	19 octobre 2023	560	538	–	(22)
A	117 358	JPY	(597)	USD	19 octobre 2023	811	780	–	(31)
A	52	USD	(10 242)	JPY	19 octobre 2023	(70)	(68)	2	–
A	26 794	JPY	(135)	USD	19 octobre 2023	183	179	–	(4)
A	494	USD	(98 469)	JPY	19 octobre 2023	(670)	(659)	11	–
A	396	USD	(79 794)	JPY	19 octobre 2023	(538)	(535)	3	–
A	7 968 700	KOR	(4 622)	USD	19 octobre 2023	6 275	5 763	–	(512)
A	8 031	USD	(13 796 654)	KOR	19 octobre 2023	(10 902)	(9 964)	938	–
A	239	USD	(407 294)	KOR	19 octobre 2023	(324)	(293)	31	–
A	505	USD	(871 141)	KOR	19 octobre 2023	(686)	(631)	55	–
A	586	USD	(1 010 732)	KOR	19 octobre 2023	(795)	(731)	64	–
A	161	USD	(279 709)	KOR	19 octobre 2023	(218)	(203)	15	–
A	2 563 859	KOR	(1 442)	USD	19 octobre 2023	1 958	1 875	–	(83)
A	665 336	KOR	(368)	USD	19 octobre 2023	499	491	–	(8)
A	450 474	KOR	(248)	USD	19 octobre 2023	337	332	–	(5)
A	196 603	KOR	(110)	USD	19 octobre 2023	149	144	–	(5)
A	401	USD	(727 034)	KOR	19 octobre 2023	(545)	(535)	10	–
A	143	USD	(256 703)	KOR	19 octobre 2023	(194)	(189)	5	–
A	48	USD	(85 643)	KOR	19 octobre 2023	(65)	(63)	2	–
A	91	USD	(166 530)	KOR	19 octobre 2023	(123)	(123)	–	–
A	1 665	MXN	(71)	USD	19 octobre 2023	96	95	–	(1)
A	69 148	MXN	(2 975)	USD	19 octobre 2023	4 039	3 923	–	(116)
A	3 193	USD	(74 220)	MXN	19 octobre 2023	(4 335)	(4 210)	125	–
A	82 420	MXN	(3 544)	USD	19 octobre 2023	4 811	4 677	–	(134)
A	552	USD	(12 746)	MXN	19 octobre 2023	(749)	(721)	28	–
A	6 526	MXN	(281)	USD	19 octobre 2023	382	371	–	(11)
A	5 316	MXN	(228)	USD	19 octobre 2023	309	302	–	(7)

# FONDS GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2023

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	36 272 MXN	(1 568) USD	19 octobre 2023	2 129	2 054	–	(75)
A	201 USD	(4 686) MXN	19 octobre 2023	(273)	(266)	7	–
A	584 MXN	(25) USD	19 octobre 2023	34	34	–	–
A	7 600 MXN	(331) USD	19 octobre 2023	449	429	–	(20)
A	714 USD	(17 118) MXN	19 octobre 2023	(969)	(982)	–	(13)
A	200 USD	(4 733) MXN	19 octobre 2023	(272)	(270)	2	–
A	300 USD	(6 985) MXN	19 octobre 2023	(407)	(397)	10	–
A	477 USD	(11 303) MXN	19 octobre 2023	(647)	(647)	–	–
A	49 813 NOK	(3 636) USD	19 octobre 2023	4 936	4 563	–	(373)
A	5 051 NOK	(369) USD	19 octobre 2023	501	463	–	(38)
A	63 306 NOK	(4 621) USD	19 octobre 2023	6 273	5 798	–	(475)
A	278 USD	(3 784) NOK	19 octobre 2023	(378)	(346)	32	–
A	9 337 NOK	(687) USD	19 octobre 2023	932	852	–	(80)
A	7 517 NOK	(550) USD	19 octobre 2023	747	688	–	(59)
A	16 613 NOK	(1 204) USD	19 octobre 2023	1 634	1 526	–	(108)
A	36 067 NOK	(2 607) USD	19 octobre 2023	3 539	3 315	–	(224)
A	9 563 NOK	(673) USD	19 octobre 2023	913	888	–	(25)
A	20 803 NOK	(1 445) USD	19 octobre 2023	1 961	1 941	–	(20)
A	24 302 NOK	(1 697) USD	19 octobre 2023	2 304	2 263	–	(41)
A	560 USD	(8 137) NOK	19 octobre 2023	(760)	(761)	–	(1)
A	5 995 NOK	(413) USD	19 octobre 2023	561	561	–	–
A	19 846 NOK	(1 363) USD	19 octobre 2023	1 850	1 860	10	–
A	12 033 NOK	(822) USD	19 octobre 2023	1 116	1 130	14	–
A	2 579 USD	(5 563) NZD	19 octobre 2023	(3 501)	(3 275)	226	–
A	15 813 NZD	(7 330) USD	19 octobre 2023	9 951	9 308	–	(643)
A	11 378 USD	(24 545) NZD	19 octobre 2023	(15 446)	(14 448)	998	–
A	221 NZD	(102) USD	19 octobre 2023	139	130	–	(9)
A	765 USD	(1 668) NZD	19 octobre 2023	(1 039)	(985)	54	–
A	513 USD	(1 122) NZD	19 octobre 2023	(697)	(663)	34	–
A	834 USD	(1 841) NZD	19 octobre 2023	(1 132)	(1 093)	39	–
A	1 011 USD	(2 261) NZD	19 octobre 2023	(1 372)	(1 350)	22	–
A	804 USD	(1 825) NZD	19 octobre 2023	(1 092)	(1 094)	–	(2)
A	477 USD	(1 091) NZD	19 octobre 2023	(648)	(656)	–	(8)
A	1 151 USD	(2 613) NZD	19 octobre 2023	(1 562)	(1 567)	–	(5)
A	1 635 USD	(3 772) NZD	19 octobre 2023	(2 219)	(2 276)	–	(57)
A	660 USD	(1 519) NZD	19 octobre 2023	(896)	(916)	–	(20)
A	396 USD	(905) NZD	19 octobre 2023	(537)	(544)	–	(7)
A	146 USD	(333) NZD	19 octobre 2023	(198)	(199)	–	(1)
A	809 USD	(60 883) PHP	19 octobre 2023	(1 098)	(1 066)	32	–
A	5 053 USD	(374 314) PHP	19 octobre 2023	(6 859)	(6 513)	346	–
A	1 572 USD	(116 684) PHP	19 octobre 2023	(2 134)	(2 032)	102	–
A	94 419 PHP	(1 277) USD	19 octobre 2023	1 734	1 641	–	(93)
A	577 USD	(42 838) PHP	19 octobre 2023	(783)	(747)	36	–
A	527 USD	(39 065) PHP	19 octobre 2023	(715)	(680)	35	–
A	2 496 USD	(186 147) PHP	19 octobre 2023	(3 388)	(3 248)	140	–
A	59 913 PHP	(786) USD	19 octobre 2023	1 067	1 053	–	(14)
A	31 736 PHP	(411) USD	19 octobre 2023	558	560	2	–
A	17 036 PHP	(222) USD	19 octobre 2023	302	300	–	(2)
A	66 USD	(5 028) PHP	19 octobre 2023	(89)	(89)	–	–
A	995 USD	(76 887) PHP	19 octobre 2023	(1 351)	(1 358)	–	(7)
A	668 USD	(51 451) PHP	19 octobre 2023	(907)	(907)	–	–

# FONDS GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2023

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	586 USD	(45 110) PHP	19 octobre 2023	(795)	(797)	–	(2)
A	231 USD	(17 927) PHP	19 octobre 2023	(313)	(317)	–	(4)
A	4 132 PLN	(759) USD	19 octobre 2023	1 031	915	–	(116)
A	16 525 PLN	(3 036) USD	19 octobre 2023	4 122	3 658	–	(464)
A	12 050 PLN	(2 214) USD	19 octobre 2023	3 006	2 668	–	(338)
A	2 203 PLN	(409) USD	19 octobre 2023	555	486	–	(69)
A	4 586 PLN	(843) USD	19 octobre 2023	1 145	1 015	–	(130)
A	3 944 PLN	(721) USD	19 octobre 2023	979	875	–	(104)
A	521 USD	(2 869) PLN	19 octobre 2023	(707)	(638)	69	–
A	2 254 USD	(12 394) PLN	19 octobre 2023	(3 060)	(2 755)	305	–
A	452 USD	(2 517) PLN	19 octobre 2023	(613)	(563)	50	–
A	419 USD	(2 350) PLN	19 octobre 2023	(569)	(526)	43	–
A	109 USD	(608) PLN	19 octobre 2023	(148)	(135)	13	–
A	1 743 PLN	(297) USD	19 octobre 2023	403	397	–	(6)
A	55 USD	(329) PLN	19 octobre 2023	(75)	(75)	–	–
A	180 USD	(1 062) PLN	19 octobre 2023	(244)	(243)	1	–
A	200 USD	(1 186) PLN	19 octobre 2023	(272)	(271)	1	–
A	16 807 SEK	(1 165) USD	19 octobre 2023	1 582	1 524	–	(58)
A	112 322 SEK	(8 001) USD	19 octobre 2023	10 862	10 085	–	(777)
A	7 564 SEK	(538) USD	19 octobre 2023	731	679	–	(52)
A	4 338 USD	(60 898) SEK	19 octobre 2023	(5 889)	(5 467)	422	–
A	1 914 USD	(26 392) SEK	19 octobre 2023	(2 598)	(2 354)	244	–
A	108 USD	(1 515) SEK	19 octobre 2023	(147)	(135)	12	–
A	669 USD	(9 390) SEK	19 octobre 2023	(908)	(843)	65	–
A	30 582 SEK	(2 134) USD	19 octobre 2023	2 897	2 768	–	(129)
A	418 USD	(5 995) SEK	19 octobre 2023	(567)	(543)	24	–
A	72 USD	(1 057) SEK	19 octobre 2023	(98)	(96)	2	–
A	544 USD	(8 061) SEK	19 octobre 2023	(739)	(739)	–	–
A	3 087 SEK	(211) USD	19 octobre 2023	286	282	–	(4)
A	3 016 SEK	(200) USD	19 octobre 2023	271	278	7	–
A	197 USD	(2 975) SEK	19 octobre 2023	(268)	(274)	–	(6)
A	159 USD	(2 404) SEK	19 octobre 2023	(216)	(221)	–	(5)
A	970 SEK	(65) USD	19 octobre 2023	88	89	1	–
A	953 USD	(44 584) THB	19 octobre 2023	(1 294)	(1 195)	99	–
A	4 887 USD	(227 736) THB	19 octobre 2023	(6 634)	(6 091)	543	–
A	3 622 USD	(168 877) THB	19 octobre 2023	(4 917)	(4 517)	400	–
A	36 468 THB	(798) USD	19 octobre 2023	1 083	968	–	(115)
A	683 USD	(31 452) THB	19 octobre 2023	(927)	(837)	90	–
A	754 USD	(35 015) THB	19 octobre 2023	(1 024)	(934)	90	–
A	2 366 USD	(109 660) THB	19 octobre 2023	(3 212)	(2 927)	285	–
A	3 109 USD	(147 572) THB	19 octobre 2023	(4 221)	(3 976)	245	–
A	899 USD	(42 966) THB	19 octobre 2023	(1 221)	(1 160)	61	–
A	992 USD	(46 994) THB	19 octobre 2023	(1 347)	(1 264)	83	–
A	930 USD	(43 988) THB	19 octobre 2023	(1 262)	(1 183)	79	–
A	415 USD	(20 048) THB	19 octobre 2023	(564)	(543)	21	–
A	662 USD	(32 009) THB	19 octobre 2023	(899)	(868)	31	–
A	467 USD	(22 778) THB	19 octobre 2023	(634)	(620)	14	–
A	6 721 THB	(136) USD	19 octobre 2023	185	184	–	(1)
A	23 250 ZAR	(913) USD	19 octobre 2023	1 240	1 221	–	(19)
A	89 338 ZAR	(3 587) USD	19 octobre 2023	4 869	4 655	–	(214)
A	54 306 ZAR	(2 180) USD	19 octobre 2023	2 960	2 830	–	(130)

# FONDS GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2023

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)		Devise à remettre (en milliers de \$)		Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	44 224	ZAR	(1 775)	USD	19 octobre 2023	2 410	2 304	–	(106)
A	180	USD	(4 392)	ZAR	19 octobre 2023	(244)	(227)	17	–
A	20 533	ZAR	(836)	USD	19 octobre 2023	1 135	1 064	–	(71)
A	12 817	ZAR	(533)	USD	19 octobre 2023	723	659	–	(64)
A	14 476	ZAR	(582)	USD	19 octobre 2023	790	754	–	(36)
A	36 530	ZAR	(1 430)	USD	19 octobre 2023	1 941	1 922	–	(19)
A	7 442	ZAR	(285)	USD	19 octobre 2023	387	395	8	–
A	8 029	ZAR	(314)	USD	19 octobre 2023	426	423	–	(3)
A	136	USD	(3 443)	ZAR	19 octobre 2023	(185)	(181)	4	–
A	20 445	ZAR	(783)	USD	19 octobre 2023	1 063	1 083	20	–
A	12 038	ZAR	(466)	USD	19 octobre 2023	633	636	3	–
A	17 877	ZAR	(694)	USD	19 octobre 2023	942	942	–	–
A	1 216	ZAR	(47)	USD	19 octobre 2023	64	64	–	–
A	249	USD	(506)	AUD	19 octobre 2023	(338)	(322)	16	–
A	660	USD	(1 315)	AUD	19 octobre 2023	(896)	(829)	67	–
A	131	USD	(261)	AUD	19 octobre 2023	(178)	(163)	15	–
A	208	USD	(417)	AUD	19 octobre 2023	(283)	(262)	21	–
A	160	USD	(326)	AUD	19 octobre 2023	(217)	(208)	9	–
A	1 167	AUD	(565)	USD	19 octobre 2023	767	745	–	(22)
A	197	AUD	(94)	USD	19 octobre 2023	128	126	–	(2)
A	347	AUD	(164)	USD	19 octobre 2023	223	223	–	–
A	36	AUD	(17)	USD	19 octobre 2023	23	23	–	–
A	36	AUD	(17)	USD	19 octobre 2023	23	23	–	–
A	121	AUD	(57)	USD	19 octobre 2023	78	78	–	–
A	252	AUD	(120)	USD	19 octobre 2023	163	162	–	(1)
A	54	AUD	(26)	USD	19 octobre 2023	35	35	–	–
A	644	BRL	(95)	USD	19 octobre 2023	129	127	–	(2)
A	6 178	BRL	(929)	USD	19 octobre 2023	1 261	1 213	–	(48)
A	18 328	BRL	(2 757)	USD	19 octobre 2023	3 742	3 598	–	(144)
A	1 002	USD	(6 662)	BRL	19 octobre 2023	(1 360)	(1 308)	52	–
A	908	BRL	(137)	USD	19 octobre 2023	186	178	–	(8)
A	850	BRL	(130)	USD	19 octobre 2023	176	166	–	(10)
A	1 649	BRL	(248)	USD	19 octobre 2023	336	323	–	(13)
A	403	BRL	(59)	USD	19 octobre 2023	80	80	–	–
A	77	USD	(522)	BRL	19 octobre 2023	(105)	(103)	2	–
A	119	USD	(790)	BRL	19 octobre 2023	(161)	(155)	6	–
A	1 015	BRL	(149)	USD	19 octobre 2023	202	201	–	(1)
A	776	BRL	(115)	USD	19 octobre 2023	156	153	–	(3)
A	87	USD	(574)	BRL	19 octobre 2023	(118)	(113)	5	–
A	79	USD	(533)	BRL	19 octobre 2023	(107)	(105)	2	–
A	3 148	USD	(5 618)	CAD	19 octobre 2023	4 138	4 322	184	–
A	1 764	USD	(3 148)	CAD	19 octobre 2023	2 319	2 422	103	–
A	86	USD	(153)	CAD	19 octobre 2023	113	118	5	–
A	880	CAD	(492)	USD	19 octobre 2023	(648)	(675)	–	(27)
A	1 156	CAD	(642)	USD	19 octobre 2023	(851)	(878)	–	(27)
A	1 007	CAD	(554)	USD	19 octobre 2023	(742)	(756)	–	(14)
A	461	CAD	(252)	USD	19 octobre 2023	(340)	(344)	–	(4)
A	421	CAD	(229)	USD	19 octobre 2023	(310)	(311)	–	(1)
A	276	USD	(506)	CAD	19 octobre 2023	373	375	2	–
A	307	USD	(570)	CAD	19 octobre 2023	420	416	–	(4)
A	62	CAD	(34)	USD	19 octobre 2023	(46)	(46)	–	–



# FONDS GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2023

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	401 CAD	(220) USD	19 octobre 2023	(295)	(300)	–	(5)
A	584 CAD	(319) USD	19 octobre 2023	(430)	(434)	–	(4)
A	221 525 CLP	(199) USD	19 octobre 2023	270	241	–	(29)
A	281 USD	(312 424) CLP	19 octobre 2023	(381)	(340)	41	–
A	145 608 CLP	(131) USD	19 octobre 2023	178	159	–	(19)
A	81 173 CLP	(73) USD	19 octobre 2023	99	89	–	(10)
A	73 154 CLP	(65) USD	19 octobre 2023	88	81	–	(7)
A	21 USD	(24 718) CLP	19 octobre 2023	(29)	(27)	2	–
A	14 USD	(16 068) CLP	19 octobre 2023	(19)	(18)	1	–
A	24 USD	(27 987) CLP	19 octobre 2023	(33)	(31)	2	–
A	76 USD	(89 862) CLP	19 octobre 2023	(103)	(100)	3	–
A	35 USD	(41 290) CLP	19 octobre 2023	(48)	(46)	2	–
A	85 USD	(102 065) CLP	19 octobre 2023	(116)	(115)	1	–
A	121 765 CLP	(99) USD	19 octobre 2023	135	137	2	–
A	85 718 CLP	(71) USD	19 octobre 2023	97	96	–	(1)
A	46 USD	(56 865) CLP	19 octobre 2023	(63)	(64)	–	(1)
A	1 402 USD	(13 524) CNY	19 octobre 2023	(1 903)	(1 830)	73	–
A	2 203 USD	(21 258) CNY	19 octobre 2023	(2 991)	(2 877)	114	–
A	6 978 CNY	(721) USD	19 octobre 2023	979	945	–	(34)
A	663 USD	(6 375) CNY	19 octobre 2023	(900)	(861)	39	–
A	8 156 CNY	(843) USD	19 octobre 2023	1 144	1 105	–	(39)
A	922 USD	(9 006) CNY	19 octobre 2023	(1 252)	(1 224)	28	–
A	279 USD	(2 758) CNY	19 octobre 2023	(379)	(377)	2	–
A	7 031 CNY	(711) USD	19 octobre 2023	965	960	–	(5)
A	303 USD	(2 990) CNY	19 octobre 2023	(411)	(408)	3	–
A	2 537 CNY	(255) USD	19 octobre 2023	346	347	1	–
A	39 USD	(388) CNY	19 octobre 2023	(53)	(53)	–	–
A	10 254 CNY	(1 036) USD	19 octobre 2023	1 406	1 401	–	(5)
A	457 USD	(4 535) CNY	19 octobre 2023	(620)	(619)	1	–
A	1 311 246 COP	(225) USD	19 octobre 2023	305	325	20	–
A	2 583 195 COP	(451) USD	19 octobre 2023	612	635	23	–
A	9 353 669 COP	(1 632) USD	19 octobre 2023	2 216	2 301	85	–
A	14 236 830 COP	(2 466) USD	19 octobre 2023	3 347	3 512	165	–
A	234 268 COP	(42) USD	19 octobre 2023	57	57	–	–
A	188 USD	(1 036 685) COP	19 octobre 2023	(255)	(252)	3	–
A	310 178 COP	(56) USD	19 octobre 2023	76	76	–	–
A	189 USD	(1 036 124) COP	19 octobre 2023	(256)	(252)	4	–
A	53 USD	(302 161) COP	19 octobre 2023	(72)	(75)	–	(3)
A	182 USD	(1 034 407) COP	19 octobre 2023	(247)	(254)	–	(7)
A	79 774 COP	(14) USD	19 octobre 2023	19	19	–	–
A	48 USD	(266 576) COP	19 octobre 2023	(65)	(65)	–	–
A	148 USD	(809 073) COP	19 octobre 2023	(201)	(196)	5	–
A	298 USD	(1 591 949) COP	19 octobre 2023	(404)	(383)	21	–
A	26 USD	(144 499) COP	19 octobre 2023	(35)	(35)	–	–
A	320 USD	(9 489) CZK	19 octobre 2023	(435)	(402)	33	–
A	520 USD	(15 151) CZK	19 octobre 2023	(706)	(638)	68	–
A	1 037 USD	(30 230) CZK	19 octobre 2023	(1 408)	(1 273)	135	–
A	4 020 CZK	(139) USD	19 octobre 2023	189	169	–	(20)
A	141 USD	(4 178) CZK	19 octobre 2023	(191)	(177)	14	–
A	254 USD	(7 560) CZK	19 octobre 2023	(345)	(320)	25	–
A	370 USD	(11 053) CZK	19 octobre 2023	(502)	(471)	31	–

# FONDS GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2023

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	1 655 CZK	(55) USD	19 octobre 2023	75	71	–	(4)
A	1 507 CZK	(50) USD	19 octobre 2023	68	65	–	(3)
A	836 CZK	(28) USD	19 octobre 2023	38	36	–	(2)
A	7 105 CZK	(230) USD	19 octobre 2023	312	307	–	(5)
A	468 CZK	(15) USD	19 octobre 2023	20	20	–	–
A	2 235 CZK	(72) USD	19 octobre 2023	98	97	–	(1)
A	996 CZK	(32) USD	19 octobre 2023	43	43	–	–
A	539 EUR	(444) USD	19 octobre 2023	603	560	–	(43)
A	1 591 EUR	(1 309) USD	19 octobre 2023	1 777	1 649	–	(128)
A	436 EUR	(362) USD	19 octobre 2023	492	450	–	(42)
A	113 USD	(139) EUR	19 octobre 2023	(154)	(144)	10	–
A	994 USD	(1 225) EUR	19 octobre 2023	(1 350)	(1 277)	73	–
A	472 USD	(580) EUR	19 octobre 2023	(641)	(604)	37	–
A	55 USD	(69) EUR	19 octobre 2023	(75)	(71)	4	–
A	196 USD	(245) EUR	19 octobre 2023	(266)	(256)	10	–
A	38 USD	(47) EUR	19 octobre 2023	(51)	(49)	2	–
A	433 EUR	(342) USD	19 octobre 2023	464	456	–	(8)
A	103 EUR	(81) USD	19 octobre 2023	110	108	–	(2)
A	108 USD	(137) EUR	19 octobre 2023	(147)	(145)	2	–
A	78 USD	(101) EUR	19 octobre 2023	(106)	(106)	–	–
A	346 GBP	(331) USD	19 octobre 2023	450	413	–	(37)
A	1 847 USD	(1 929) GBP	19 octobre 2023	(2 507)	(2 299)	208	–
A	63 GBP	(60) USD	19 octobre 2023	82	74	–	(8)
A	222 GBP	(210) USD	19 octobre 2023	285	265	–	(20)
A	382 GBP	(359) USD	19 octobre 2023	487	458	–	(29)
A	602 USD	(641) GBP	19 octobre 2023	(817)	(770)	47	–
A	183 USD	(194) GBP	19 octobre 2023	(248)	(234)	14	–
A	89 USD	(95) GBP	19 octobre 2023	(121)	(114)	7	–
A	245 USD	(261) GBP	19 octobre 2023	(332)	(313)	19	–
A	178 GBP	(164) USD	19 octobre 2023	222	215	–	(7)
A	97 USD	(106) GBP	19 octobre 2023	(132)	(128)	4	–
A	147 USD	(161) GBP	19 octobre 2023	(200)	(196)	4	–
A	156 USD	(174) GBP	19 octobre 2023	(212)	(213)	–	(1)
A	11 303 759 IDR	(547) USD	19 octobre 2023	743	724	–	(19)
A	15 306 852 IDR	(753) USD	19 octobre 2023	1 022	975	–	(47)
A	12 751 798 IDR	(628) USD	19 octobre 2023	852	813	–	(39)
A	21 381 739 IDR	(1 051) USD	19 octobre 2023	1 427	1 363	–	(64)
A	544 USD	(11 090 768) IDR	19 octobre 2023	(739)	(707)	32	–
A	4 793 575 IDR	(234) USD	19 octobre 2023	318	306	–	(12)
A	15 414 578 IDR	(748) USD	19 octobre 2023	1 016	987	–	(29)
A	15 414 578 IDR	(745) USD	19 octobre 2023	1 011	988	–	(23)
A	13 161 220 IDR	(637) USD	19 octobre 2023	865	844	–	(21)
A	1 340 122 IDR	(64) USD	19 octobre 2023	87	86	–	(1)
A	81 USD	(1 692 610) IDR	19 octobre 2023	(110)	(109)	1	–
A	67 USD	(1 381 386) IDR	19 octobre 2023	(91)	(89)	2	–
A	86 979 IDR	(4) USD	19 octobre 2023	6	6	–	–
A	1 645 274 IDR	(79) USD	19 octobre 2023	107	106	–	(1)
A	178 USD	(3 714 295) IDR	19 octobre 2023	(241)	(239)	2	–
A	104 USD	(2 183 858) IDR	19 octobre 2023	(141)	(141)	–	–
A	472 ILS	(96) USD	19 octobre 2023	130	122	–	(8)
A	2 004 USD	(9 884) ILS	19 octobre 2023	(2 721)	(2 550)	171	–

# FONDS GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2023

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	150 USD	(727) ILS	19 octobre 2023	(203)	(186)	17	–
A	138 USD	(697) ILS	19 octobre 2023	(188)	(181)	7	–
A	13 USD	(64) ILS	19 octobre 2023	(18)	(17)	1	–
A	289 ILS	(57) USD	19 octobre 2023	78	75	–	(3)
A	59 ILS	(12) USD	19 octobre 2023	16	16	–	–
A	770 ILS	(150) USD	19 octobre 2023	204	202	–	(2)
A	64 ILS	(13) USD	19 octobre 2023	17	17	–	–
A	671 ILS	(129) USD	19 octobre 2023	175	177	2	–
A	139 USD	(718) ILS	19 octobre 2023	(189)	(188)	1	–
A	313 ILS	(60) USD	19 octobre 2023	82	82	–	–
A	4 USD	(19) ILS	19 octobre 2023	(5)	(5)	–	–
A	7 837 INR	(70) USD	19 octobre 2023	95	94	–	(1)
A	39 599 INR	(354) USD	19 octobre 2023	481	473	–	(8)
A	1 400 INR	(13) USD	19 octobre 2023	17	17	–	–
A	243 120 INR	(2 168) USD	19 octobre 2023	2 943	2 910	–	(33)
A	4 753 INR	(42) USD	19 octobre 2023	57	57	–	–
A	37 385 INR	(335) USD	19 octobre 2023	455	446	–	(9)
A	27 912 INR	(249) USD	19 octobre 2023	338	334	–	(4)
A	841 USD	(94 505) INR	19 octobre 2023	(1 141)	(1 133)	8	–
A	244 USD	(27 579) INR	19 octobre 2023	(331)	(331)	–	–
A	460 USD	(51 890) INR	19 octobre 2023	(624)	(623)	1	–
A	48 USD	(5 344) INR	19 octobre 2023	(65)	(64)	1	–
A	9 780 INR	(86) USD	19 octobre 2023	117	117	–	–
A	10 124 INR	(90) USD	19 octobre 2023	122	121	–	(1)
A	1 736 INR	(15) USD	19 octobre 2023	21	21	–	–
A	5 960 INR	(53) USD	19 octobre 2023	72	72	–	–
A	52 011 JPY	(277) USD	19 octobre 2023	376	340	–	(36)
A	4 338 JPY	(24) USD	19 octobre 2023	32	28	–	(4)
A	495 327 JPY	(2 675) USD	19 octobre 2023	3 631	3 218	–	(413)
A	120 716 JPY	(652) USD	19 octobre 2023	885	784	–	(101)
A	292 USD	(54 067) JPY	19 octobre 2023	(396)	(352)	44	–
A	240 USD	(45 425) JPY	19 octobre 2023	(326)	(297)	29	–
A	16 049 JPY	(83) USD	19 octobre 2023	113	105	–	(8)
A	26 462 JPY	(136) USD	19 octobre 2023	185	175	–	(10)
A	27 136 JPY	(139) USD	19 octobre 2023	189	180	–	(9)
A	16 511 JPY	(84) USD	19 octobre 2023	114	109	–	(5)
A	43 256 JPY	(220) USD	19 octobre 2023	299	288	–	(11)
A	18 777 JPY	(94) USD	19 octobre 2023	128	125	–	(3)
A	9 454 JPY	(48) USD	19 octobre 2023	65	64	–	(1)
A	193 USD	(38 481) JPY	19 octobre 2023	(262)	(258)	4	–
A	153 USD	(30 795) JPY	19 octobre 2023	(208)	(207)	1	–
A	3 258 149 KOR	(1 890) USD	19 octobre 2023	2 566	2 356	–	(210)
A	3 364 USD	(5 780 092) KOR	19 octobre 2023	(4 567)	(4 174)	393	–
A	87 USD	(148 055) KOR	19 octobre 2023	(118)	(107)	11	–
A	122 USD	(211 230) KOR	19 octobre 2023	(166)	(153)	13	–
A	28 USD	(49 396) KOR	19 octobre 2023	(38)	(35)	3	–
A	951 137 KOR	(536) USD	19 octobre 2023	727	696	–	(31)
A	181 463 KOR	(100) USD	19 octobre 2023	136	134	–	(2)
A	185 610 KOR	(102) USD	19 octobre 2023	139	137	–	(2)
A	58 239 KOR	(32) USD	19 octobre 2023	44	43	–	(1)
A	172 USD	(310 735) KOR	19 octobre 2023	(233)	(229)	4	–

# FONDS GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2023

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	48 USD	(86 599) KOR	19 octobre 2023	(65)	(63)	2	–
A	13 USD	(22 188) KOR	19 octobre 2023	(17)	(17)	–	–
A	27 USD	(48 875) KOR	19 octobre 2023	(36)	(36)	–	–
A	747 MXN	(32) USD	19 octobre 2023	43	43	–	–
A	30 055 MXN	(1 294) USD	19 octobre 2023	1 756	1 706	–	(50)
A	1 605 USD	(37 311) MXN	19 octobre 2023	(2 179)	(2 116)	63	–
A	40 712 MXN	(1 750) USD	19 octobre 2023	2 376	2 310	–	(66)
A	250 USD	(5 782) MXN	19 octobre 2023	(340)	(327)	13	–
A	32 USD	(762) MXN	19 octobre 2023	(44)	(43)	1	–
A	12 257 MXN	(530) USD	19 octobre 2023	719	694	–	(25)
A	115 USD	(2 681) MXN	19 octobre 2023	(156)	(152)	4	–
A	1 130 MXN	(48) USD	19 octobre 2023	65	64	–	(1)
A	29 USD	(671) MXN	19 octobre 2023	(39)	(38)	1	–
A	2 803 MXN	(122) USD	19 octobre 2023	166	159	–	(7)
A	195 USD	(4 678) MXN	19 octobre 2023	(265)	(269)	–	(4)
A	74 USD	(1 764) MXN	19 octobre 2023	(101)	(100)	1	–
A	112 USD	(2 616) MXN	19 octobre 2023	(152)	(148)	4	–
A	172 USD	(4 084) MXN	19 octobre 2023	(234)	(234)	–	–
A	26 742 NOK	(1 952) USD	19 octobre 2023	2 650	2 450	–	(200)
A	717 USD	(9 824) NOK	19 octobre 2023	(973)	(899)	74	–
A	34 263 NOK	(2 501) USD	19 octobre 2023	3 395	3 138	–	(257)
A	156 USD	(2 128) NOK	19 octobre 2023	(212)	(194)	18	–
A	185 USD	(2 523) NOK	19 octobre 2023	(251)	(231)	20	–
A	5 118 NOK	(371) USD	19 octobre 2023	503	470	–	(33)
A	10 810 NOK	(782) USD	19 octobre 2023	1 061	994	–	(67)
A	4 923 NOK	(346) USD	19 octobre 2023	470	457	–	(13)
A	5 961 NOK	(414) USD	19 octobre 2023	562	556	–	(6)
A	8 695 NOK	(607) USD	19 octobre 2023	824	809	–	(15)
A	17 USD	(242) NOK	19 octobre 2023	(23)	(23)	–	–
A	2 146 NOK	(148) USD	19 octobre 2023	201	201	–	–
A	6 480 NOK	(445) USD	19 octobre 2023	604	607	3	–
A	3 948 NOK	(270) USD	19 octobre 2023	366	371	5	–
A	1 181 USD	(2 548) NZD	19 octobre 2023	(1 603)	(1 499)	104	–
A	8 756 NZD	(4 059) USD	19 octobre 2023	5 510	5 154	–	(356)
A	5 746 USD	(12 394) NZD	19 octobre 2023	(7 800)	(7 296)	504	–
A	153 NZD	(71) USD	19 octobre 2023	96	90	–	(6)
A	54 NZD	(24) USD	19 octobre 2023	33	31	–	(2)
A	250 USD	(552) NZD	19 octobre 2023	(339)	(327)	12	–
A	262 USD	(586) NZD	19 octobre 2023	(356)	(350)	6	–
A	359 USD	(816) NZD	19 octobre 2023	(488)	(489)	–	(1)
A	105 USD	(238) NZD	19 octobre 2023	(142)	(144)	–	(2)
A	413 USD	(937) NZD	19 octobre 2023	(560)	(562)	–	(2)
A	708 USD	(1 635) NZD	19 octobre 2023	(961)	(986)	–	(25)
A	236 USD	(544) NZD	19 octobre 2023	(321)	(328)	–	(7)
A	108 USD	(247) NZD	19 octobre 2023	(147)	(149)	–	(2)
A	34 USD	(77) NZD	19 octobre 2023	(46)	(46)	–	–
A	355 USD	(26 718) PHP	19 octobre 2023	(482)	(468)	14	–
A	2 218 USD	(164 346) PHP	19 octobre 2023	(3 011)	(2 859)	152	–
A	645 USD	(47 924) PHP	19 octobre 2023	(876)	(834)	42	–
A	42 934 PHP	(580) USD	19 octobre 2023	788	746	–	(42)
A	4 767 PHP	(64) USD	19 octobre 2023	87	83	–	(4)

# FONDS GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2023

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	830 USD	(61 951) PHP	19 octobre 2023	(1 127)	(1 080)	47	–
A	27 146 PHP	(357) USD	19 octobre 2023	484	478	–	(6)
A	5 207 PHP	(68) USD	19 octobre 2023	92	92	–	–
A	9 827 PHP	(128) USD	19 octobre 2023	174	173	–	(1)
A	37 USD	(2 841) PHP	19 octobre 2023	(50)	(50)	–	–
A	442 USD	(34 150) PHP	19 octobre 2023	(600)	(603)	–	(3)
A	237 USD	(18 262) PHP	19 octobre 2023	(322)	(322)	–	–
A	184 USD	(14 189) PHP	19 octobre 2023	(250)	(251)	–	(1)
A	69 USD	(5 375) PHP	19 octobre 2023	(94)	(95)	–	(1)
A	3 314 PLN	(609) USD	19 octobre 2023	827	734	–	(93)
A	8 774 PLN	(1 613) USD	19 octobre 2023	2 189	1 943	–	(246)
A	2 068 PLN	(380) USD	19 octobre 2023	516	458	–	(58)
A	816 PLN	(151) USD	19 octobre 2023	205	180	–	(25)
A	442 PLN	(81) USD	19 octobre 2023	110	98	–	(12)
A	226 USD	(1 246) PLN	19 octobre 2023	(307)	(277)	30	–
A	836 USD	(4 598) PLN	19 octobre 2023	(1 135)	(1 022)	113	–
A	114 USD	(639) PLN	19 octobre 2023	(155)	(142)	13	–
A	169 USD	(949) PLN	19 octobre 2023	(230)	(213)	17	–
A	32 USD	(181) PLN	19 octobre 2023	(44)	(40)	4	–
A	885 PLN	(151) USD	19 octobre 2023	205	202	–	(3)
A	22 USD	(130) PLN	19 octobre 2023	(30)	(30)	–	–
A	72 USD	(426) PLN	19 octobre 2023	(98)	(98)	–	–
A	74 USD	(439) PLN	19 octobre 2023	(101)	(101)	–	–
A	7 265 SEK	(504) USD	19 octobre 2023	684	659	–	(25)
A	62 237 SEK	(4 434) USD	19 octobre 2023	6 019	5 588	–	(431)
A	3 800 SEK	(271) USD	19 octobre 2023	368	342	–	(26)
A	2 885 USD	(40 502) SEK	19 octobre 2023	(3 917)	(3 637)	280	–
A	842 USD	(11 615) SEK	19 octobre 2023	(1 143)	(1 036)	107	–
A	538 USD	(7 556) SEK	19 octobre 2023	(731)	(679)	52	–
A	10 494 SEK	(732) USD	19 octobre 2023	994	950	–	(44)
A	189 USD	(2 717) SEK	19 octobre 2023	(257)	(246)	11	–
A	195 SEK	(13) USD	19 octobre 2023	18	18	–	–
A	212 USD	(3 144) SEK	19 octobre 2023	(288)	(288)	–	–
A	1 143 SEK	(78) USD	19 octobre 2023	106	104	–	(2)
A	1 743 SEK	(116) USD	19 octobre 2023	157	161	4	–
A	71 USD	(1 071) SEK	19 octobre 2023	(96)	(98)	–	(2)
A	66 USD	(998) SEK	19 octobre 2023	(90)	(92)	–	(2)
A	290 SEK	(19) USD	19 octobre 2023	26	26	–	–
A	418 USD	(19 583) THB	19 octobre 2023	(568)	(524)	44	–
A	2 315 USD	(107 850) THB	19 octobre 2023	(3 142)	(2 885)	257	–
A	1 366 USD	(63 678) THB	19 octobre 2023	(1 854)	(1 703)	151	–
A	17 614 THB	(385) USD	19 octobre 2023	523	467	–	(56)
A	6 312 THB	(136) USD	19 octobre 2023	185	169	–	(16)
A	768 USD	(35 619) THB	19 octobre 2023	(1 043)	(950)	93	–
A	937 USD	(44 479) THB	19 octobre 2023	(1 272)	(1 198)	74	–
A	448 USD	(21 405) THB	19 octobre 2023	(608)	(578)	30	–
A	239 USD	(11 344) THB	19 octobre 2023	(325)	(305)	20	–
A	345 USD	(16 335) THB	19 octobre 2023	(469)	(440)	29	–
A	350 USD	(16 880) THB	19 octobre 2023	(475)	(457)	18	–
A	236 USD	(11 406) THB	19 octobre 2023	(320)	(309)	11	–
A	124 USD	(6 069) THB	19 octobre 2023	(169)	(165)	4	–

# FONDS GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2023

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	3 430 THB	(69) USD	19 octobre 2023	94	93	–	(1)
A	10 196 ZAR	(401) USD	19 octobre 2023	544	536	–	(8)
A	41 661 ZAR	(1 672) USD	19 octobre 2023	2 270	2 170	–	(100)
A	19 364 ZAR	(777) USD	19 octobre 2023	1 055	1 009	–	(46)
A	20 208 ZAR	(811) USD	19 octobre 2023	1 101	1 053	–	(48)
A	114 USD	(2 782) ZAR	19 octobre 2023	(155)	(144)	11	–
A	145 USD	(3 490) ZAR	19 octobre 2023	(197)	(180)	17	–
A	3 788 ZAR	(152) USD	19 octobre 2023	207	198	–	(9)
A	9 843 ZAR	(385) USD	19 octobre 2023	523	518	–	(5)
A	5 162 ZAR	(197) USD	19 octobre 2023	268	274	6	–
A	957 ZAR	(38) USD	19 octobre 2023	51	51	–	–
A	28 USD	(715) ZAR	19 octobre 2023	(38)	(37)	1	–
A	10 652 ZAR	(408) USD	19 octobre 2023	554	565	11	–
A	4 279 ZAR	(166) USD	19 octobre 2023	225	226	1	–
A	5 577 ZAR	(217) USD	19 octobre 2023	294	294	–	–
A	75 ZAR	(3) USD	19 octobre 2023	4	4	–	–
A	151 CAD	(84) USD	19 octobre 2023	(111)	(115)	–	(4)
A	866 USD	(1 545) CAD	19 octobre 2023	1 138	1 189	51	–
A	3 701 CAD	(2 074) USD	19 octobre 2023	(2 726)	(2 847)	–	(121)
A	201 CAD	(112) USD	19 octobre 2023	(148)	(154)	–	(6)
A	670 CAD	(374) USD	19 octobre 2023	(494)	(514)	–	(20)
A	101 CAD	(56) USD	19 octobre 2023	(74)	(76)	–	(2)
A	119 CAD	(66) USD	19 octobre 2023	(88)	(90)	–	(2)
A	73 CAD	(40) USD	19 octobre 2023	(54)	(55)	–	(1)
A	46 USD	(85) CAD	19 octobre 2023	62	62	–	–
A	47 USD	(86) CAD	19 octobre 2023	63	63	–	–
A	355 CAD	(192) USD	19 octobre 2023	(262)	(260)	2	–
A	34 CAD	(18) USD	19 octobre 2023	(25)	(25)	–	–
A	85 CAD	(46) USD	19 octobre 2023	(62)	(63)	–	(1)
A	79 USD	(144) CAD	19 octobre 2023	106	107	1	–
A	835 USD	(1 697) AUD	19 octobre 2023	(1 133)	(1 078)	55	–
A	2 217 USD	(4 417) AUD	19 octobre 2023	(3 009)	(2 783)	226	–
A	419 USD	(830) AUD	19 octobre 2023	(569)	(523)	46	–
A	1 065 USD	(2 126) AUD	19 octobre 2023	(1 446)	(1 340)	106	–
A	1 511 USD	(3 015) AUD	19 octobre 2023	(2 051)	(1 901)	150	–
A	46 USD	(95) AUD	19 octobre 2023	(63)	(60)	3	–
A	4 485 AUD	(2 172) USD	19 octobre 2023	2 948	2 864	–	(84)
A	440 AUD	(211) USD	19 octobre 2023	286	282	–	(4)
A	1 389 AUD	(659) USD	19 octobre 2023	894	893	–	(1)
A	18 USD	(38) AUD	19 octobre 2023	(25)	(25)	–	–
A	71 USD	(151) AUD	19 octobre 2023	(96)	(97)	–	(1)
A	432 AUD	(204) USD	19 octobre 2023	277	278	1	–
A	1 506 AUD	(718) USD	19 octobre 2023	975	967	–	(8)
A	93 AUD	(44) USD	19 octobre 2023	60	60	–	–
A	5 764 BRL	(853) USD	19 octobre 2023	1 158	1 138	–	(20)
A	30 896 BRL	(4 647) USD	19 octobre 2023	6 308	6 066	–	(242)
A	9 102 USD	(60 517) BRL	19 octobre 2023	(12 356)	(11 882)	474	–
A	247 995 BRL	(37 299) USD	19 octobre 2023	50 633	48 690	–	(1 943)
A	5 832 BRL	(881) USD	19 octobre 2023	1 196	1 143	–	(53)
A	305 USD	(2 015) BRL	19 octobre 2023	(414)	(395)	19	–
A	1 112 USD	(7 255) BRL	19 octobre 2023	(1 510)	(1 414)	96	–

# FONDS GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2023

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	3 516 USD	(23 080) BRL	19 octobre 2023	(4 773)	(4 510)	263	–
A	3 188 USD	(21 212) BRL	19 octobre 2023	(4 328)	(4 166)	162	–
A	2 998 USD	(20 485) BRL	19 octobre 2023	(4 070)	(4 062)	8	–
A	3 118 USD	(21 056) BRL	19 octobre 2023	(4 233)	(4 158)	75	–
A	2 838 USD	(18 925) BRL	19 octobre 2023	(3 852)	(3 719)	133	–
A	3 249 USD	(22 150) BRL	19 octobre 2023	(4 410)	(4 388)	22	–
A	3 751 USD	(25 350) BRL	19 octobre 2023	(5 092)	(5 006)	86	–
A	2 569 USD	(17 019) BRL	19 octobre 2023	(3 487)	(3 336)	151	–
A	1 362 BRL	(202) USD	19 octobre 2023	274	269	–	(5)
A	8 585 USD	(15 318) CAD	19 octobre 2023	11 284	11 786	502	–
A	4 235 USD	(7 557) CAD	19 octobre 2023	5 567	5 815	248	–
A	119 USD	(212) CAD	19 octobre 2023	156	163	7	–
A	3 182 USD	(5 685) CAD	19 octobre 2023	4 188	4 367	179	–
A	2 600 USD	(4 650) CAD	19 octobre 2023	3 425	3 565	140	–
A	8 390 CAD	(4 658) USD	19 octobre 2023	(6 180)	(6 374)	–	(194)
A	1 876 CAD	(1 032) USD	19 octobre 2023	(1 382)	(1 408)	–	(26)
A	107 USD	(195) CAD	19 octobre 2023	144	146	2	–
A	23 USD	(42) CAD	19 octobre 2023	31	31	–	–
A	2 674 USD	(4 909) CAD	19 octobre 2023	3 616	3 636	20	–
A	3 080 USD	(5 712) CAD	19 octobre 2023	4 208	4 173	–	(35)
A	1 036 USD	(1 905) CAD	19 octobre 2023	1 403	1 406	3	–
A	1 310 CAD	(720) USD	19 octobre 2023	(965)	(981)	–	(16)
A	1 970 CAD	(1 076) USD	19 octobre 2023	(1 451)	(1 464)	–	(13)
A	811 USD	(909 114) CLP	19 octobre 2023	(1 101)	(992)	109	–
A	5 741 USD	(6 387 247) CLP	19 octobre 2023	(7 793)	(6 946)	847	–
A	1 584 531 CLP	(1 424) USD	19 octobre 2023	1 933	1 723	–	(210)
A	1 486 656 CLP	(1 336) USD	19 octobre 2023	1 814	1 617	–	(197)
A	125 301 CLP	(112) USD	19 octobre 2023	152	136	–	(16)
A	8 541 054 CLP	(7 580) USD	19 octobre 2023	10 290	9 335	–	(955)
A	21 USD	(24 624) CLP	19 octobre 2023	(29)	(27)	2	–
A	499 USD	(577 527) CLP	19 octobre 2023	(678)	(638)	40	–
A	368 USD	(428 102) CLP	19 octobre 2023	(499)	(473)	26	–
A	469 USD	(546 778) CLP	19 octobre 2023	(636)	(606)	30	–
A	727 USD	(860 648) CLP	19 octobre 2023	(987)	(959)	28	–
A	536 USD	(625 789) CLP	19 octobre 2023	(727)	(693)	34	–
A	872 USD	(1 046 044) CLP	19 octobre 2023	(1 184)	(1 170)	14	–
A	306 088 CLP	(251) USD	19 octobre 2023	341	345	4	–
A	69 845 CLP	(58) USD	19 octobre 2023	79	78	–	(1)
A	271 USD	(332 050) CLP	19 octobre 2023	(368)	(375)	–	(7)
A	5 220 USD	(50 363) CNY	19 octobre 2023	(7 086)	(6 814)	272	–
A	6 905 USD	(66 620) CNY	19 octobre 2023	(9 373)	(9 014)	359	–
A	23 919 CNY	(2 472) USD	19 octobre 2023	3 356	3 240	–	(116)
A	2 716 USD	(26 276) CNY	19 octobre 2023	(3 687)	(3 558)	129	–
A	4 777 USD	(45 926) CNY	19 octobre 2023	(6 485)	(6 206)	279	–
A	52 895 CNY	(5 463) USD	19 octobre 2023	7 416	7 166	–	(250)
A	5 151 USD	(50 303) CNY	19 octobre 2023	(6 993)	(6 837)	156	–
A	2 434 USD	(24 056) CNY	19 octobre 2023	(3 304)	(3 284)	20	–
A	25 635 CNY	(2 592) USD	19 octobre 2023	3 518	3 500	–	(18)
A	2 565 USD	(25 345) CNY	19 octobre 2023	(3 482)	(3 459)	23	–
A	4 467 CNY	(449) USD	19 octobre 2023	610	611	1	–
A	1 055 USD	(10 462) CNY	19 octobre 2023	(1 432)	(1 429)	3	–

# FONDS GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2023

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	60 497 CNY	(6 108) USD	19 octobre 2023	8 292	8 264	–	(28)
A	3 646 USD	(36 175) CNY	19 octobre 2023	(4 949)	(4 945)	4	–
A	13 227 599 COP	(2 310) USD	19 octobre 2023	3 136	3 254	118	–
A	37 027 544 COP	(6 463) USD	19 octobre 2023	8 774	9 112	338	–
A	65 745 175 COP	(11 387) USD	19 octobre 2023	15 458	16 221	763	–
A	1 546 885 COP	(279) USD	19 octobre 2023	379	376	–	(3)
A	9 633 USD	(53 274 637) COP	19 octobre 2023	(13 077)	(12 947)	130	–
A	1 226 USD	(6 773 890) COP	19 octobre 2023	(1 664)	(1 646)	18	–
A	1 669 USD	(9 304 962) COP	19 octobre 2023	(2 266)	(2 267)	–	(1)
A	813 USD	(4 467 319) COP	19 octobre 2023	(1 103)	(1 084)	19	–
A	1 043 USD	(5 960 316) COP	19 octobre 2023	(1 416)	(1 465)	–	(49)
A	376 USD	(2 140 277) COP	19 octobre 2023	(511)	(526)	–	(15)
A	895 USD	(5 028 003) COP	19 octobre 2023	(1 215)	(1 229)	–	(14)
A	1 246 USD	(6 941 921) COP	19 octobre 2023	(1 692)	(1 691)	1	–
A	891 USD	(4 881 494) COP	19 octobre 2023	(1 210)	(1 182)	28	–
A	2 599 921 COP	(485) USD	19 octobre 2023	659	624	–	(35)
A	262 722 COP	(47) USD	19 octobre 2023	64	64	–	–
A	1 085 USD	(32 092) CZK	19 octobre 2023	(1 473)	(1 360)	113	–
A	1 719 USD	(50 099) CZK	19 octobre 2023	(2 334)	(2 110)	224	–
A	3 502 USD	(102 066) CZK	19 octobre 2023	(4 754)	(4 299)	455	–
A	14 451 CZK	(499) USD	19 octobre 2023	678	607	–	(71)
A	1 468 USD	(43 025) CZK	19 octobre 2023	(1 993)	(1 817)	176	–
A	1 783 USD	(52 919) CZK	19 octobre 2023	(2 421)	(2 245)	176	–
A	155 USD	(4 612) CZK	19 octobre 2023	(211)	(196)	15	–
A	2 403 USD	(71 874) CZK	19 octobre 2023	(3 262)	(3 058)	204	–
A	433 USD	(13 004) CZK	19 octobre 2023	(588)	(554)	34	–
A	441 USD	(13 327) CZK	19 octobre 2023	(599)	(569)	30	–
A	542 USD	(16 263) CZK	19 octobre 2023	(736)	(692)	44	–
A	20 969 CZK	(678) USD	19 octobre 2023	920	904	–	(16)
A	465 USD	(14 484) CZK	19 octobre 2023	(631)	(626)	5	–
A	8 387 CZK	(270) USD	19 octobre 2023	366	361	–	(5)
A	394 USD	(12 366) CZK	19 octobre 2023	(535)	(535)	–	–
A	295 EUR	(242) USD	19 octobre 2023	329	305	–	(24)
A	9 929 USD	(12 066) EUR	19 octobre 2023	(13 479)	(12 511)	968	–
A	1 367 EUR	(1 136) USD	19 octobre 2023	1 542	1 411	–	(131)
A	20 531 EUR	(16 931) USD	19 octobre 2023	22 984	21 272	–	(1 712)
A	1 599 EUR	(1 306) USD	19 octobre 2023	1 773	1 662	–	(111)
A	5 320 USD	(6 553) EUR	19 octobre 2023	(7 222)	(6 831)	391	–
A	1 870 USD	(2 297) EUR	19 octobre 2023	(2 539)	(2 392)	147	–
A	125 USD	(155) EUR	19 octobre 2023	(170)	(162)	8	–
A	890 USD	(1 110) EUR	19 octobre 2023	(1 208)	(1 163)	45	–
A	134 USD	(166) EUR	19 octobre 2023	(182)	(174)	8	–
A	2 627 EUR	(2 075) USD	19 octobre 2023	2 817	2 766	–	(51)
A	8 665 USD	(10 962) EUR	19 octobre 2023	(11 763)	(11 540)	223	–
A	682 USD	(865) EUR	19 octobre 2023	(926)	(912)	14	–
A	336 USD	(431) EUR	19 octobre 2023	(456)	(455)	1	–
A	690 USD	(721) GBP	19 octobre 2023	(937)	(859)	78	–
A	4 400 USD	(4 595) GBP	19 octobre 2023	(5 973)	(5 478)	495	–
A	235 GBP	(226) USD	19 octobre 2023	307	279	–	(28)
A	1 045 USD	(1 103) GBP	19 octobre 2023	(1 418)	(1 320)	98	–
A	71 USD	(75) GBP	19 octobre 2023	(97)	(90)	7	–



# FONDS GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2023

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	2 299 GBP	(2 161) USD	19 octobre 2023	2 934	2 759	–	(175)
A	3 076 USD	(3 277) GBP	19 octobre 2023	(4 175)	(3 937)	238	–
A	1 333 USD	(1 419) GBP	19 octobre 2023	(1 809)	(1 704)	105	–
A	944 USD	(1 006) GBP	19 octobre 2023	(1 281)	(1 208)	73	–
A	1 863 USD	(1 987) GBP	19 octobre 2023	(2 529)	(2 387)	142	–
A	403 GBP	(371) USD	19 octobre 2023	503	488	–	(15)
A	1 063 USD	(1 158) GBP	19 octobre 2023	(1 443)	(1 402)	41	–
A	1 042 USD	(1 141) GBP	19 octobre 2023	(1 415)	(1 384)	31	–
A	1 655 USD	(1 846) GBP	19 octobre 2023	(2 246)	(2 254)	–	(8)
A	38 819 729 IDR	(1 880) USD	19 octobre 2023	2 552	2 488	–	(64)
A	69 839 085 IDR	(3 436) USD	19 octobre 2023	4 665	4 450	–	(215)
A	45 293 943 IDR	(2 229) USD	19 octobre 2023	3 026	2 886	–	(140)
A	50 361 988 IDR	(2 476) USD	19 octobre 2023	3 361	3 209	–	(152)
A	1 871 USD	(38 127 948) IDR	19 octobre 2023	(2 540)	(2 432)	108	–
A	43 694 115 IDR	(2 138) USD	19 octobre 2023	2 903	2 789	–	(114)
A	53 233 981 IDR	(2 606) USD	19 octobre 2023	3 537	3 399	–	(138)
A	52 717 640 IDR	(2 559) USD	19 octobre 2023	3 474	3 376	–	(98)
A	52 717 640 IDR	(2 548) USD	19 octobre 2023	3 459	3 382	–	(77)
A	88 350 718 IDR	(4 276) USD	19 octobre 2023	5 805	5 664	–	(141)
A	35 981 881 IDR	(1 729) USD	19 octobre 2023	2 347	2 313	–	(34)
A	20 418 227 IDR	(980) USD	19 octobre 2023	1 330	1 313	–	(17)
A	21 252 431 IDR	(1 028) USD	19 octobre 2023	1 396	1 362	–	(34)
A	18 060 361 IDR	(868) USD	19 octobre 2023	1 178	1 161	–	(17)
A	859 USD	(17 932 945) IDR	19 octobre 2023	(1 166)	(1 154)	12	–
A	23 024 676 IDR	(1 101) USD	19 octobre 2023	1 495	1 483	–	(12)
A	432 USD	(9 098 785) IDR	19 octobre 2023	(587)	(587)	–	–
A	3 110 ILS	(631) USD	19 octobre 2023	856	802	–	(54)
A	7 063 USD	(34 830) ILS	19 octobre 2023	(9 588)	(8 986)	602	–
A	436 USD	(2 117) ILS	19 octobre 2023	(592)	(543)	49	–
A	1 665 USD	(8 136) ILS	19 octobre 2023	(2 260)	(2 092)	168	–
A	2 088 USD	(10 499) ILS	19 octobre 2023	(2 834)	(2 728)	106	–
A	5 396 ILS	(1 097) USD	19 octobre 2023	1 489	1 391	–	(98)
A	435 USD	(2 187) ILS	19 octobre 2023	(591)	(568)	23	–
A	554 USD	(2 805) ILS	19 octobre 2023	(752)	(731)	21	–
A	780 ILS	(152) USD	19 octobre 2023	206	204	–	(2)
A	450 USD	(2 307) ILS	19 octobre 2023	(611)	(603)	8	–
A	959 ILS	(184) USD	19 octobre 2023	250	253	3	–
A	1 330 USD	(6 868) ILS	19 octobre 2023	(1 806)	(1 801)	5	–
A	1 164 ILS	(225) USD	19 octobre 2023	306	306	–	–
A	603 USD	(3 129) ILS	19 octobre 2023	(818)	(822)	–	(4)
A	1 402 288 INR	(12 554) USD	19 octobre 2023	17 042	16 762	–	(280)
A	793 USD	(88 947) INR	19 octobre 2023	(1 077)	(1 065)	12	–
A	18 270 USD	(2 048 603) INR	19 octobre 2023	(24 802)	(24 521)	281	–
A	181 USD	(20 364) INR	19 octobre 2023	(246)	(244)	2	–
A	431 507 INR	(3 864) USD	19 octobre 2023	5 245	5 158	–	(87)
A	525 327 INR	(4 714) USD	19 octobre 2023	6 399	6 275	–	(124)
A	124 849 INR	(1 115) USD	19 octobre 2023	1 513	1 494	–	(19)
A	1 298 USD	(145 946) INR	19 octobre 2023	(1 762)	(1 749)	13	–
A	122 822 INR	(1 086) USD	19 octobre 2023	1 474	1 475	1	–
A	99 USD	(11 150) INR	19 octobre 2023	(134)	(134)	–	–
A	193 882 INR	(1 725) USD	19 octobre 2023	2 342	2 323	–	(19)

# FONDS GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2023

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	286 494 INR	(2 533) USD	19 octobre 2023	3 439	3 440	1	–
A	288 183 INR	(2 558) USD	19 octobre 2023	3 472	3 456	–	(16)
A	204 782 INR	(1 816) USD	19 octobre 2023	2 465	2 456	–	(9)
A	101 265 INR	(895) USD	19 octobre 2023	1 215	1 216	1	–
A	95 848 JPY	(510) USD	19 octobre 2023	692	626	–	(66)
A	84 986 JPY	(459) USD	19 octobre 2023	623	552	–	(71)
A	2 444 764 JPY	(13 202) USD	19 octobre 2023	17 921	15 883	–	(2 038)
A	6 997 705 JPY	(37 787) USD	19 octobre 2023	51 296	45 461	–	(5 835)
A	793 USD	(147 020) JPY	19 octobre 2023	(1 076)	(956)	120	–
A	488 758 JPY	(2 601) USD	19 octobre 2023	3 531	3 194	–	(337)
A	428 729 JPY	(2 268) USD	19 octobre 2023	3 079	2 808	–	(271)
A	971 USD	(186 536) JPY	19 octobre 2023	(1 318)	(1 230)	88	–
A	308 494 JPY	(1 590) USD	19 octobre 2023	2 158	2 041	–	(117)
A	367 249 JPY	(1 882) USD	19 octobre 2023	2 555	2 435	–	(120)
A	204 178 JPY	(1 040) USD	19 octobre 2023	1 412	1 356	–	(56)
A	527 100 JPY	(2 683) USD	19 octobre 2023	3 642	3 504	–	(138)
A	335 938 JPY	(1 693) USD	19 octobre 2023	2 298	2 242	–	(56)
A	2 053 900 JPY	(10 335) USD	19 octobre 2023	14 030	13 711	–	(319)
A	483 USD	(96 503) JPY	19 octobre 2023	(656)	(645)	11	–
A	4 511 JPY	(22) USD	19 octobre 2023	30	30	–	–
A	21 USD	(35 736) KOR	19 octobre 2023	(28)	(26)	2	–
A	18 008 USD	(31 043 594) KOR	19 octobre 2023	(24 446)	(22 448)	1 998	–
A	2 611 USD	(4 486 171) KOR	19 octobre 2023	(3 545)	(3 240)	305	–
A	206 USD	(352 108) KOR	19 octobre 2023	(280)	(253)	27	–
A	279 972 KOR	(162) USD	19 octobre 2023	220	202	–	(18)
A	204 USD	(352 677) KOR	19 octobre 2023	(277)	(255)	22	–
A	4 058 836 KOR	(2 329) USD	19 octobre 2023	3 161	2 948	–	(213)
A	5 931 708 KOR	(3 338) USD	19 octobre 2023	4 531	4 340	–	(191)
A	2 910 976 KOR	(1 607) USD	19 octobre 2023	2 181	2 145	–	(36)
A	3 412 825 KOR	(1 883) USD	19 octobre 2023	2 556	2 515	–	(41)
A	2 730 538 KOR	(1 526) USD	19 octobre 2023	2 071	2 003	–	(68)
A	468 463 KOR	(259) USD	19 octobre 2023	351	345	–	(6)
A	1 797 116 KOR	(998) USD	19 octobre 2023	1 355	1 321	–	(34)
A	2 476 066 KOR	(1 376) USD	19 octobre 2023	1 868	1 819	–	(49)
A	503 USD	(923 222) KOR	19 octobre 2023	(683)	(683)	–	–
A	229 MXN	(10) USD	19 octobre 2023	13	13	–	–
A	327 383 MXN	(14 087) USD	19 octobre 2023	19 123	18 573	–	(550)
A	1 003 914 MXN	(43 199) USD	19 octobre 2023	58 642	56 956	–	(1 686)
A	3 494 USD	(81 261) MXN	19 octobre 2023	(4 743)	(4 611)	132	–
A	283 USD	(6 535) MXN	19 octobre 2023	(384)	(370)	14	–
A	3 990 USD	(92 634) MXN	19 octobre 2023	(5 416)	(5 254)	162	–
A	3 764 USD	(87 898) MXN	19 octobre 2023	(5 109)	(4 996)	113	–
A	3 570 USD	(82 570) MXN	19 octobre 2023	(4 846)	(4 676)	170	–
A	4 702 USD	(109 450) MXN	19 octobre 2023	(6 383)	(6 213)	170	–
A	4 376 USD	(102 996) MXN	19 octobre 2023	(5 940)	(5 871)	69	–
A	4 975 USD	(115 349) MXN	19 octobre 2023	(6 754)	(6 538)	216	–
A	3 787 USD	(86 942) MXN	19 octobre 2023	(5 141)	(4 910)	231	–
A	5 071 USD	(121 585) MXN	19 octobre 2023	(6 884)	(6 976)	–	(92)
A	5 080 USD	(119 951) MXN	19 octobre 2023	(6 896)	(6 845)	51	–
A	5 593 USD	(130 392) MXN	19 octobre 2023	(7 593)	(7 406)	187	–
A	692 USD	(16 440) MXN	19 octobre 2023	(940)	(939)	1	–

# FONDS GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2023

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)		Devise à remettre (en milliers de \$)		Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	274 660	NOK	(20 048)	USD	19 octobre 2023	27 215	25 157	–	(2 058)
A	47 087	NOK	(3 437)	USD	19 octobre 2023	4 666	4 313	–	(353)
A	121 455	NOK	(8 866)	USD	19 octobre 2023	12 035	11 125	–	(910)
A	1 015	USD	(13 802)	NOK	19 octobre 2023	(1 378)	(1 260)	118	–
A	13 856	USD	(188 347)	NOK	19 octobre 2023	(18 809)	(17 199)	1 610	–
A	25 721	NOK	(1 882)	USD	19 octobre 2023	2 555	2 354	–	(201)
A	1 676	USD	(23 132)	NOK	19 octobre 2023	(2 275)	(2 125)	150	–
A	4 564	USD	(63 140)	NOK	19 octobre 2023	(6 196)	(5 804)	392	–
A	2 175	USD	(30 909)	NOK	19 octobre 2023	(2 952)	(2 870)	82	–
A	3 085	USD	(44 433)	NOK	19 octobre 2023	(4 188)	(4 146)	42	–
A	3 559	USD	(50 962)	NOK	19 octobre 2023	(4 832)	(4 746)	86	–
A	1 501	USD	(21 810)	NOK	19 octobre 2023	(2 038)	(2 041)	–	(3)
A	2 109	USD	(30 606)	NOK	19 octobre 2023	(2 863)	(2 864)	–	(1)
A	2 494	USD	(36 323)	NOK	19 octobre 2023	(3 385)	(3 403)	–	(18)
A	2 897	USD	(42 412)	NOK	19 octobre 2023	(3 933)	(3 982)	–	(49)
A	369	USD	(15 588)	NTD	19 octobre 2023	(501)	(479)	22	–
A	8 721	USD	(365 958)	NTD	19 octobre 2023	(11 839)	(11 194)	645	–
A	21 971	USD	(923 762)	NTD	19 octobre 2023	(29 825)	(28 279)	1 546	–
A	413	USD	(17 222)	NTD	19 octobre 2023	(560)	(526)	34	–
A	121 611	NTD	(2 903)	USD	19 octobre 2023	3 941	3 718	–	(223)
A	118 462	NTD	(2 809)	USD	19 octobre 2023	3 813	3 631	–	(182)
A	133 543	NTD	(3 130)	USD	19 octobre 2023	4 249	4 110	–	(139)
A	137 612	NTD	(3 210)	USD	19 octobre 2023	4 358	4 244	–	(114)
A	134 577	NTD	(3 122)	USD	19 octobre 2023	4 238	4 158	–	(80)
A	142 212	NTD	(3 291)	USD	19 octobre 2023	4 468	4 398	–	(70)
A	130 384	NTD	(3 028)	USD	19 octobre 2023	4 111	4 027	–	(84)
A	135 691	NTD	(3 121)	USD	19 octobre 2023	4 237	4 205	–	(32)
A	133 906	NTD	(3 084)	USD	19 octobre 2023	4 186	4 149	–	(37)
A	134 534	NTD	(3 098)	USD	19 octobre 2023	4 205	4 168	–	(37)
A	3 958	USD	(8 538)	NZD	19 octobre 2023	(5 373)	(5 026)	347	–
A	11 933	USD	(25 742)	NZD	19 octobre 2023	(16 199)	(15 153)	1 046	–
A	21 479	NZD	(9 957)	USD	19 octobre 2023	13 516	12 643	–	(873)
A	674	NZD	(312)	USD	19 octobre 2023	424	396	–	(28)
A	2 378	USD	(5 180)	NZD	19 octobre 2023	(3 228)	(3 061)	167	–
A	2 263	USD	(4 943)	NZD	19 octobre 2023	(3 072)	(2 924)	148	–
A	66	USD	(145)	NZD	19 octobre 2023	(89)	(86)	3	–
A	2 506	USD	(5 608)	NZD	19 octobre 2023	(3 402)	(3 347)	55	–
A	3 074	USD	(6 974)	NZD	19 octobre 2023	(4 173)	(4 182)	–	(9)
A	1 926	USD	(4 401)	NZD	19 octobre 2023	(2 615)	(2 646)	–	(31)
A	1 768	NZD	(779)	USD	19 octobre 2023	1 057	1 061	4	–
A	8 772	NZD	(3 801)	USD	19 octobre 2023	5 160	5 292	132	–
A	3 968	NZD	(1 724)	USD	19 octobre 2023	2 341	2 392	51	–
A	681	NZD	(298)	USD	19 octobre 2023	405	410	5	–
A	3 995	NZD	(1 755)	USD	19 octobre 2023	2 382	2 399	17	–
A	1 219	USD	(91 803)	PHP	19 octobre 2023	(1 655)	(1 607)	48	–
A	24 887	USD	(1 843 752)	PHP	19 octobre 2023	(33 784)	(32 082)	1 702	–
A	334	USD	(24 840)	PHP	19 octobre 2023	(454)	(432)	22	–
A	145 176	PHP	(1 964)	USD	19 octobre 2023	2 666	2 524	–	(142)
A	359	USD	(26 643)	PHP	19 octobre 2023	(487)	(464)	23	–
A	331	USD	(24 587)	PHP	19 octobre 2023	(450)	(428)	22	–
A	733	USD	(54 692)	PHP	19 octobre 2023	(995)	(954)	41	–

# FONDS GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2023

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	150 562 PHP	(1 976) USD	19 octobre 2023	2 682	2 647	–	(35)
A	77 701 PHP	(1 007) USD	19 octobre 2023	1 367	1 372	5	–
A	116 141 PHP	(1 518) USD	19 octobre 2023	2 061	2 045	–	(16)
A	36 677 PHP	(477) USD	19 octobre 2023	647	647	–	–
A	1 865 USD	(144 077) PHP	19 octobre 2023	(2 532)	(2 545)	–	(13)
A	718 USD	(55 292) PHP	19 octobre 2023	(975)	(975)	–	–
A	6 190 PHP	(80) USD	19 octobre 2023	109	109	–	–
A	1 596 USD	(124 035) PHP	19 octobre 2023	(2 166)	(2 197)	–	(31)
A	26 USD	(141) PLN	19 octobre 2023	(35)	(31)	4	–
A	27 750 PLN	(5 099) USD	19 octobre 2023	6 922	6 143	–	(779)
A	20 023 PLN	(3 679) USD	19 octobre 2023	4 994	4 432	–	(562)
A	2 404 PLN	(446) USD	19 octobre 2023	605	530	–	(75)
A	12 030 PLN	(2 212) USD	19 octobre 2023	3 003	2 662	–	(341)
A	12 394 PLN	(2 265) USD	19 octobre 2023	3 075	2 749	–	(326)
A	2 407 USD	(13 250) PLN	19 octobre 2023	(3 267)	(2 947)	320	–
A	3 059 USD	(16 815) PLN	19 octobre 2023	(4 152)	(3 738)	414	–
A	57 USD	(319) PLN	19 octobre 2023	(78)	(72)	6	–
A	417 USD	(2 339) PLN	19 octobre 2023	(566)	(523)	43	–
A	1 357 PLN	(244) USD	19 octobre 2023	331	303	–	(28)
A	7 475 PLN	(1 274) USD	19 octobre 2023	1 730	1 703	–	(27)
A	1 565 PLN	(264) USD	19 octobre 2023	359	358	–	(1)
A	318 USD	(1 882) PLN	19 octobre 2023	(432)	(430)	2	–
A	46 USD	(270) PLN	19 octobre 2023	(62)	(62)	–	–
A	24 865 SEK	(1 724) USD	19 octobre 2023	2 341	2 256	–	(85)
A	24 348 SEK	(1 735) USD	19 octobre 2023	2 355	2 187	–	(168)
A	15 198 SEK	(1 083) USD	19 octobre 2023	1 470	1 365	–	(105)
A	46 048 SEK	(3 280) USD	19 octobre 2023	4 453	4 134	–	(319)
A	2 870 USD	(39 578) SEK	19 octobre 2023	(3 896)	(3 530)	366	–
A	4 471 SEK	(320) USD	19 octobre 2023	435	401	–	(34)
A	659 USD	(9 257) SEK	19 octobre 2023	(895)	(831)	64	–
A	38 100 SEK	(2 659) USD	19 octobre 2023	3 609	3 448	–	(161)
A	340 USD	(4 884) SEK	19 octobre 2023	(462)	(443)	19	–
A	7 374 SEK	(504) USD	19 octobre 2023	684	672	–	(12)
A	681 USD	(10 090) SEK	19 octobre 2023	(925)	(924)	1	–
A	11 750 SEK	(802) USD	19 octobre 2023	1 089	1 072	–	(17)
A	15 887 SEK	(1 053) USD	19 octobre 2023	1 429	1 465	36	–
A	52 USD	(790) SEK	19 octobre 2023	(71)	(73)	–	(2)
A	276 USD	(4 163) SEK	19 octobre 2023	(374)	(383)	–	(9)
A	7 859 SEK	(527) USD	19 octobre 2023	715	722	7	–
A	1 414 USD	(66 143) THB	19 octobre 2023	(1 919)	(1 772)	147	–
A	11 127 USD	(518 520) THB	19 octobre 2023	(15 105)	(13 869)	1 236	–
A	16 915 USD	(788 574) THB	19 octobre 2023	(22 962)	(21 095)	1 867	–
A	56 379 THB	(1 233) USD	19 octobre 2023	1 674	1 496	–	(178)
A	589 USD	(27 133) THB	19 octobre 2023	(800)	(722)	78	–
A	1 241 USD	(57 541) THB	19 octobre 2023	(1 684)	(1 537)	147	–
A	9 360 THB	(202) USD	19 octobre 2023	274	250	–	(24)
A	4 312 USD	(204 654) THB	19 octobre 2023	(5 853)	(5 513)	340	–
A	725 USD	(34 630) THB	19 octobre 2023	(984)	(935)	49	–
A	208 352 THB	(4 401) USD	19 octobre 2023	5 974	5 607	–	(367)
A	184 012 THB	(3 890) USD	19 octobre 2023	5 281	4 951	–	(330)
A	193 160 THB	(4 005) USD	19 octobre 2023	5 437	5 234	–	(203)

# FONDS GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2023

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

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	179 565 THB	(3 716) USD	19 octobre 2023	5 045	4 869	–	(176)
A	101 374 THB	(2 077) USD	19 octobre 2023	2 820	2 759	–	(61)
A	46 420 THB	(941) USD	19 octobre 2023	1 277	1 269	–	(8)
A	35 965 ZAR	(1 413) USD	19 octobre 2023	1 918	1 889	–	(29)
A	37 160 ZAR	(1 492) USD	19 octobre 2023	2 025	1 936	–	(89)
A	82 671 ZAR	(3 319) USD	19 octobre 2023	4 505	4 307	–	(198)
A	152 221 ZAR	(6 111) USD	19 octobre 2023	8 296	7 931	–	(365)
A	462 USD	(11 278) ZAR	19 octobre 2023	(627)	(583)	44	–
A	55 780 ZAR	(2 272) USD	19 octobre 2023	3 084	2 890	–	(194)
A	345 USD	(8 291) ZAR	19 octobre 2023	(468)	(427)	41	–
A	1 320 USD	(32 829) ZAR	19 octobre 2023	(1 792)	(1 710)	82	–
A	1 380 USD	(35 268) ZAR	19 octobre 2023	(1 874)	(1 855)	19	–
A	1 601 USD	(41 844) ZAR	19 octobre 2023	(2 173)	(2 218)	–	(45)
A	1 313 USD	(33 607) ZAR	19 octobre 2023	(1 782)	(1 769)	13	–
A	1 161 USD	(29 372) ZAR	19 octobre 2023	(1 576)	(1 539)	37	–
A	2 048 USD	(53 469) ZAR	19 octobre 2023	(2 780)	(2 833)	–	(53)
A	1 919 USD	(49 554) ZAR	19 octobre 2023	(2 605)	(2 616)	–	(11)
A	1 223 USD	(31 482) ZAR	19 octobre 2023	(1 660)	(1 661)	–	(1)
A	1 544 USD	(39 932) ZAR	19 octobre 2023	(2 096)	(2 109)	–	(13)
<b>Total des contrats de change à terme de gré à gré</b>						<b>48 491</b>	<b>(48 048)</b>
<b>Total des actifs dérivés</b>							<b>56 354</b>
<b>Total des passifs dérivés</b>							<b>(52 117)</b>

# FONDS GLOBAL MACRO 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.

## NOTES ANNEXES

### 3. Principales méthodes comptables (suite)

#### b) Évaluation de la juste valeur

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

Les placements dans des titres cotés à une Bourse des valeurs mobilières ou négociés sur un marché hors cote 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 GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

### 3. Principales méthodes comptables (suite)

#### c) Comptabilisation des revenus et des charges

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

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

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

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

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

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

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

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

#### f) Compensation

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

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

#### g) Devise

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

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

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

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

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

#### 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.



# FONDS GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

### 3. Principales méthodes comptables (suite)

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

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

k) Fusions

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

l) Frais de vente à découvert et d'emprunt

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

m) Modifications comptables futures

Le Fonds a déterminé qu'aucune incidence 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 assujétiées 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.

## NOTES ANNEXES

### 5. Impôts sur le résultat

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

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

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

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

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

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

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

### 7. Capital du Fonds

Le capital du Fonds, qui comprend l'actif net attribuable aux porteurs de titres, est réparti entre les différentes séries, lesquelles comportent chacune un nombre illimité de titres. Les titres en circulation du Fonds aux 30 septembre 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).

## NOTES ANNEXES

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

#### 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.

#### 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 et titres vendus à découvert, le risque maximal découlant des instruments financiers équivaut à leur juste valeur. Le risque maximal de perte sur certains contrats dérivés, comme des contrats à terme de gré à gré, des swaps ou des contrats à terme standardisés équivaut à leurs montants notionnels. Dans le cas d'options d'achat (de vente) et de positions vendeur sur contrats à terme standardisés, la perte pour le Fonds continue d'augmenter, théoriquement sans limite, au fur et à mesure que la juste valeur de l'élément sous-jacent augmente (diminue). Toutefois, ces instruments sont généralement utilisés dans le cadre du processus global de gestion des placements afin de gérer le risque provenant des placements sous-jacents et n'augmentent généralement pas le risque de perte global du Fonds. Pour atténuer ce risque, le Fonds s'assure de détenir à la fois l'élément sous-jacent, la couverture en espèces ou la marge, dont la valeur équivaut à celle du contrat dérivé ou lui est supérieure. Dans le cas de titres vendus à découvert, la perte pour le Fonds continue d'augmenter, sans limite, au fur et à mesure que la juste valeur de l'élément sous-jacent augmente. Ce risque est atténué au moyen de restrictions quant à la capacité du Fonds de vendre des titres à découvert. Ces restrictions sont décrites à la note 3 I).

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

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

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

#### c) Prêt de titres

	30 septembre 2023	31 mars 2023
	(\$)	(\$)
Valeur des titres prêtés	3 039	8 309
Valeur des biens reçus en garantie	3 193	8 968

	30 septembre 2023		30 septembre 2022	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
Revenus de prêts de titres bruts	22	100,0	7	100,0
Impôt retenu à la source	(5)	(22,7)	(1)	(14,3)
	17	77,3	6	85,7
Paiements à l'agent de prêt de titres	(3)	(13,6)	(1)	(14,3)
Revenu tiré du prêt de titres	14	63,7	5	71,4

#### d) Commissions

	(\$)
30 septembre 2023	4
30 septembre 2022	10

#### e) Risques découlant des instruments financiers

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

Le Fonds cherche à procurer un rendement total positif sur un cycle de marché, peu importe la direction générale du marché, en investissant dans des positions acheteur et/ou vendeur sur titres de capitaux propres et titres à revenu fixe; il peut également investir dans des marchandises et/ou des devises. Les stratégies du Fonds comprennent un ensemble de processus qui devraient tirer une valeur des marchés de négociation qui sont animés par les données et les événements macroéconomiques mondiaux, comme les fluctuations des prix des marchandises, des taux de change ainsi que des marchés boursiers et obligataires.

Le Fonds peut également effectuer des ventes à découvert, emprunter des fonds et/ou investir dans des dérivés, comme des contrats à terme et des contrats à terme standardisés.

L'exposition globale du Fonds à ses sources de levier correspond à la somme des sources de levier suivantes et ne doit pas dépasser 300 % de sa valeur liquidative : i) la valeur de marché globale des titres vendus à découvert; ii) l'encours total des emprunts aux termes des conventions d'emprunt aux fins de placement; et iii) la valeur notionnelle globale des positions sur dérivés visés du Fonds, à l'exception des dérivés visés utilisés aux fins de couverture.

L'effet cumulatif du recours au levier financier dans un marché qui évolue au détriment d'un placement avec effet de levier pourrait se solder par une perte importante plus lourde qu'en l'absence de recours au levier financier. Par conséquent, toute incidence défavorable découlant d'un événement sur la valeur d'un placement du Fonds sera amplifiée dans la mesure selon laquelle est employé le levier financier.

# FONDS GLOBAL MACRO 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 %	
					(\$)	%	(\$)	%
JPY	–	(624)	108 905	108 281				
IDR	–	–	57 828	57 828				
USD	53 158	8 512	(23 707)	37 963				
BRL	–	–	26 603	26 603				
COP	–	–	26 367	26 367				
INR	–	–	25 998	25 998				
NOK	–	–	25 956	25 956				
ZAR	–	168	24 872	25 040				
SEK	–	12	18 330	18 342				
PLN	–	–	17 577	17 577				
MXN	–	441	15 969	16 410				
CLP	–	–	582	582				
NTD	–	–	330	330				
CHF	–	108	3	111				
AUD	–	32	(4 023)	(3 991)				
EUR	–	1 368	(8 161)	(6 793)				
KOR	–	–	(14 842)	(14 842)				
ILS	–	–	(25 277)	(25 277)				
CZK	–	–	(25 715)	(25 715)				
GBP	–	244	(29 402)	(29 158)				
CNY	–	–	(36 193)	(36 193)				
NZD	–	–	(38 361)	(38 361)				
PHP	–	–	(51 530)	(51 530)				
THB	–	–	(52 756)	(52 756)				
Total	53 158	10 261	39 353	102 772				
% de l'actif net	9,4	1,8	7,0	18,2				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					(5 139)	(0,9)	5 139	0,9

# FONDS GLOBAL MACRO 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)

Devise	31 mars 2023				Incidence sur l'actif net			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Renforcement de 5 %		Affaiblissement de 5 %	
					(\$)	%	(\$)	%
MXN	–	(46)	79 097	79 051				
BRL	–	–	54 426	54 426				
COP	–	–	34 878	34 878				
EUR	–	2 354	31 149	33 503				
PLN	–	–	28 572	28 572				
ZAR	–	(400)	24 062	23 662				
IDR	–	–	21 408	21 408				
NOK	–	–	19 819	19 819				
SEK	–	(42)	16 037	15 995				
CLP	–	–	9 704	9 704				
AUD	–	(623)	6 435	5 812				
CHF	–	85	(294)	(209)				
NZD	–	–	(3 308)	(3 308)				
JPY	–	3 030	(7 367)	(4 337)				
CZK	–	–	(10 689)	(10 689)				
ILS	–	–	(14 089)	(14 089)				
GBP	–	389	(17 521)	(17 132)				
USD	25 631	10 039	(55 707)	(20 037)				
THB	–	–	(23 185)	(23 185)				
CNY	–	–	(24 405)	(24 405)				
KOR	–	–	(27 378)	(27 378)				
PHP	–	–	(29 165)	(29 165)				
NTD	–	–	(36 049)	(36 049)				
INR	–	–	(47 602)	(47 602)				
Total	25 631	14 786	28 828	69 245				
% de l'actif net	5,2	3,0	5,9	14,1				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					(4 697)	(1,0)	4 697	1,0

\* 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	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
		Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
		(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	(151 058)				
1 an à 5 ans	–				
5 ans à 10 ans	–				
Plus de 10 ans	–				
Total	(151 058)				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt		17 564	3,1	(17 564)	(3,1)



# FONDS GLOBAL MACRO 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)

##### iii. Risque de taux d'intérêt (suite)

31 mars 2023	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
		Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
		(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	(246 403)				
1 an à 5 ans	–				
5 ans à 10 ans	–				
Plus de 10 ans	–				
Total	(246 403)				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt		17 767	3,6	(17 767)	(3,6)

##### iv. Autre risque de prix

Au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023, le Fonds n'avait aucune exposition importante à l'autre risque de prix.

##### v. Risque de crédit

Au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023, le Fonds n'avait aucune exposition importante au risque de crédit.

#### f) Classement de la juste valeur

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

	30 septembre 2023				31 mars 2023			
	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Options	–	12 567	–	12 567	–	7 751	–	7 751
Fonds/billets négociés en bourse	40 591	–	–	40 591	17 880	–	–	17 880
Fonds communs de placement	26 343	–	–	26 343	24 889	–	–	24 889
Actifs dérivés	7 863	48 491	–	56 354	2 539	30 970	–	33 509
Passifs dérivés	(3 597)	(48 520)	–	(52 117)	(10 999)	(13 966)	–	(24 965)
Placements à court terme	381 574	74 610	–	456 184	329 074	65 765	–	394 839
Total	452 774	87 148	–	539 922	363 383	90 520	–	453 903

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, aucun transfert n'a eu lieu entre le niveau 1 et le niveau 2.

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

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

	30 septembre 2023	31 mars 2023
	(\$)	(\$)
Gestionnaire	10	–
Autres fonds gérés par le gestionnaire	179 666	177 579
Fonds gérés par des sociétés affiliées au gestionnaire	365 348	290 331

# FONDS GLOBAL MACRO MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2023

## NOTES ANNEXES

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

#### 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	27 356	(23 090)	–	4 266
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(24 161)	23 090	22 199	21 128
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	3 195	–	22 199	25 394

	31 mars 2023			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	7 513	(4 995)	–	2 518
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(13 455)	4 995	31 941	23 481
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	(5 942)	–	31 941	25 999

#### 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 (\$)
Fonds de lingots d'or Mackenzie, série R	10,5	26 343
SPDR Bloomberg High Yield Bond ETF	0,0	3 485
SPDR S&P Oil & Gas Exploration & Production ETF	0,7	37 106

31 mars 2023	% de l'actif net du Fonds sous-jacent	Juste valeur des placements du Fonds (\$)
Fonds de lingots d'or Mackenzie, série R	9,3	24 889
SPDR S&P Oil & Gas Exploration & Production ETF	0,4	17 880

#### j) Effet de levier

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

Au cours de la période de six mois close le 30 septembre 2023, l'exposition globale du Fonds aux sources de levier a varié entre 104 % et 164 % de la valeur liquidative du Fonds. Le bas de la fourchette a été atteint en avril 2023 et correspond aux sommes généralement empruntées pour le Fonds. Le haut de la fourchette a été atteint en juillet 2023, lorsque l'équipe de gestion de portefeuille a ajouté des contrats à terme standardisés sur obligations à 2 ans. Les sources de levier étaient des positions acheteur et vendeur sur contrats à terme standardisés, options achetées, swaps et contrats de change à terme de gré à gré. Incluant la valeur notionnelle des dérivés utilisés aux fins de couverture, les montants de levier minimaux et maximaux ont varié entre 311 % et 393 %.

Au cours de l'exercice clos le 31 mars 2023, l'exposition globale du Fonds aux sources de levier a varié entre 73 % et 190 % de la valeur liquidative du Fonds. Le haut de la fourchette a été atteint en avril 2022, lorsque les positions actives du Fonds ont nécessité un levier accru pour atteindre les objectifs en matière de profil risque/rendement. Le bas de la fourchette a été atteint en juillet 2022, lorsque les expositions dans l'ensemble du portefeuille étaient généralement plus basses en réaction à la volatilité élevée des marchés. Les sources de levier étaient des positions acheteur et vendeur sur contrats à terme standardisés et contrats de change à terme de gré à gré. Incluant la valeur notionnelle des dérivés utilisés aux fins de couverture, les montants de levier minimaux et maximaux ont varié entre 235 % et 331 %.