

PORTEFEUILLE PRUDENT SYMÉTRIE

États financiers intermédiaires non audités

Pour la période de six mois close le 30 septembre 2025

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

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

AVIS DE NON-AUDIT DES ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES

Corporation Financière Mackenzie, le gestionnaire du Portefeuille prudent Symétrie (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.



MACKENZIE
Placements

PORTEFEUILLE PRUDENT SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2025

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

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

	30 sept. 2025	31 mars 2025 (Audité)	Actif net attribuable aux porteurs de titres (note 3)				
			par titre		par série		
			30 sept. 2025	31 mars 2025 (Audité)	30 sept. 2025	31 mars 2025 (Audité)	
ACTIF	\$	\$					
Actifs courants							
Placements à la juste valeur	1 029 150	1 021 082	Série A	15,30	14,32	135 039	139 504
Trésorerie et équivalents de trésorerie	7 262	332	Série AR	12,98	12,15	45 721	46 032
Sommes à recevoir pour placements vendus	–	–	Série B	12,05	11,28	2 239	2 309
Sommes à recevoir pour titres émis	116	71	Série D	12,20	11,35	1 393	1 523
Sommes à recevoir du gestionnaire	28	493	Série F	16,42	15,27	71 952	69 382
Marge sur instruments dérivés	2 768	814	Série F5	10,80	10,29	1 966	2 046
Actifs dérivés	706	3 954	Série F8	8,56	8,29	4 704	4 519
Total de l'actif	1 040 030	1 026 746	Série FB	11,80	10,98	365	367
			Série FB5	11,69	11,15	2	1
			Série FR	12,73	11,85	8 964	8 683
PASSIF			Série G	13,66	12,75	142	155
Passifs courants			Série J	14,75	13,78	50	51
Sommes à payer pour placements achetés	27	20	Série O	13,10	12,13	5 394	5 243
Sommes à payer pour titres rachetés	375	489	Série PW	12,25	11,45	274 380	268 575
Sommes à payer au gestionnaire	53	159	Série PWFB	11,47	10,67	5 795	6 087
Passifs dérivés	1 072	4 439	Série PWFB5	12,47	11,89	1	1
Total du passif	1 527	5 107	Série PWR	11,08	10,36	28 825	24 653
Actif net attribuable aux porteurs de titres	1 038 503	1 021 639	Série PWT5	11,27	10,81	13 596	14 535
			Série PWT8	8,78	8,55	4 275	4 205
			Série PWX	12,23	11,32	5 876	5 746
			Série PWX8	11,37	10,95	1	1
			Série S	11,46	10,61	3 991	3 901
			Série T5	9,83	9,43	6 717	6 701
			Série T8	6,97	6,79	338	399
			Série LB	12,52	11,73	80 802	88 259
			Série LF	11,72	10,90	55 462	52 348
			Série LF5	13,59	12,95	9 446	9 463
			Série LM	6,48	6,22	13 146	14 533
			Série LW	10,91	10,21	196 401	180 773
			Série LW5	11,40	10,93	59 152	58 965
			Série LX	9,56	9,17	2 368	2 679
						1 038 503	1 021 639

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

PORTEFEUILLE PRUDENT SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2025

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

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

	2025 \$	2024 \$	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation (note 3)			
			par titre		par série	
			2025	2024	2025	2024
Revenus						
Dividendes	4 342	5 872				
Revenus d'intérêts aux fins de distribution	12 753	13 151				
Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets						
Profit (perte) net(te) réalisé(e)	12 107	(6 034)				
Profit (perte) net(te) latent(e)	48 966	59 613				
Revenu tiré du prêt de titres	1	24				
Revenu provenant des rabais sur les frais	165	141				
Total des revenus (pertes)	78 334	72 767				
Charges (note 6)						
Frais de gestion	8 573	9 181				
Rabais sur les frais de gestion	(2)	(2)				
Frais d'administration	929	993				
Intérêts débiteurs	5	18				
Commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille	6	23				
Frais du comité d'examen indépendant	1	2				
Charges avant les montants absorbés par le gestionnaire	9 512	10 215				
Charges absorbées par le gestionnaire	–	–				
Charges nettes	9 512	10 215				
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, avant impôt	68 822	62 552				
Charge (économie) d'impôt étranger retenu à la source	–	43				
Charge d'impôt étranger sur le résultat (recouvrée)	–	–				
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation	68 822	62 509				
Série A	0,96	0,78	8 898	8 703		
Série AR	0,82	0,68	3 020	2 720		
Série B	0,76	0,61	152	142		
Série D	0,82	0,69	101	114		
Série F	1,14	0,93	5 056	4 576		
Série F5	0,76	0,65	146	141		
Série F8	0,61	0,57	332	313		
Série FB	0,80	0,64	26	26		
Série FB5	0,82	0,71	1	–		
Série FR	0,91	0,75	803	481		
Série G	0,84	0,74	9	9		
Série J	0,95	0,50	4	8		
Série O	0,96	0,77	409	389		
Série PW	0,79	0,64	17 969	16 202		
Série PWFB	0,82	0,64	448	425		
Série PWFB5	0,88	0,77	–	–		
Série PWR	0,73	0,60	1 815	1 212		
Série PWT5	0,70	0,65	869	1 073		
Série PWT8	0,57	0,47	281	273		
Série PWX	0,90	0,73	445	516		
Série PWX8	0,86	0,78	–	–		
Série S	0,82	0,71	286	253		
Série T5	0,64	0,54	442	430		
Série T8	0,43	0,37	20	35		
Série LB	0,74	0,63	5 104	5 479		
Série LF	0,82	0,66	3 858	3 025		
Série LF5	0,92	0,82	627	565		
Série LM	0,39	0,35	853	983		
Série LW	0,71	0,56	12 830	10 525		
Série LW5	0,73	0,63	3 861	3 709		
Série LX	0,58	0,51	157	182		
			68 822	62 509		

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

PORTEFEUILLE PRUDENT SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2025

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

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

	Série FR		Série G		Série J		Série O		Série PW	
	2025	2024	2025	2024	2025	2024	2025	2024	2025	2024
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	8 683	6 928	155	154	51	449	5 243	6 251	268 575	287 904
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	803	481	9	9	4	8	409	389	17 969	16 202
Distributions versées aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Gains en capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Rabais sur les frais de gestion	-	-	-	-	-	-	-	-	(2)	(2)
Total des distributions versées aux porteurs de titres	-	-	-	-	-	-	-	-	(2)	(2)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	7 456	762	-	-	-	-	19	487	14 751	13 457
Réinvestissement des distributions	-	-	-	-	-	-	-	-	1	1
Paiements au rachat de titres	(7 978)	(101)	(22)	(5)	(5)	(406)	(277)	(1 416)	(26 914)	(35 065)
Total des opérations sur les titres	(522)	661	(22)	(5)	(5)	(406)	(258)	(929)	(12 162)	(21 607)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	281	1 142	(13)	4	(1)	(398)	151	(540)	5 805	(5 407)
À la clôture	8 964	8 070	142	158	50	51	5 394	5 711	274 380	282 497
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :	Titres		Titres		Titres		Titres		Titres	
Titres en circulation, à l'ouverture	733	614	12	13	4	34	432	541	23 446	26 391
Émis	639	66	-	-	-	-	2	42	1 269	1 218
Réinvestissement des distributions	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Rachetés	(668)	(9)	(2)	(1)	(1)	(30)	(22)	(121)	(2 317)	(3 173)
Titres en circulation, à la clôture	704	671	10	12	3	4	412	462	22 398	24 436

	Série PWFB		Série PWFB5		Série PWR		Série PWT5		Série PWT8	
	2025	2024	2025	2024	2025	2024	2025	2024	2025	2024
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	6 087	7 249	1	1	24 653	19 699	14 535	16 853	4 205	5 921
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	448	425	-	-	1 815	1 212	869	1 073	281	273
Distributions versées aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Gains en capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-	(336)	(440)	(168)	(207)
Rabais sur les frais de gestion	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Total des distributions versées aux porteurs de titres	-	-	-	-	-	-	(336)	(440)	(168)	(207)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	872	104	-	-	3 731	2 212	1 279	2 251	29	5
Réinvestissement des distributions	-	-	-	-	-	-	108	144	112	117
Paiements au rachat de titres	(1 612)	(1 042)	-	-	(1 374)	(1 014)	(2 859)	(1 159)	(184)	(1 161)
Total des opérations sur les titres	(740)	(938)	-	-	2 357	1 198	(1 472)	1 236	(43)	(1 039)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	(292)	(513)	-	-	4 172	2 410	(939)	1 869	70	(973)
À la clôture	5 795	6 736	1	1	28 825	22 109	13 596	18 722	4 275	4 948
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :	Titres		Titres		Titres		Titres		Titres	
Titres en circulation, à l'ouverture	570	713	-	-	2 379	1 996	1 345	1 559	492	671
Émis	85	10	-	-	351	220	118	210	4	-
Réinvestissement des distributions	-	-	-	-	-	-	10	13	13	13
Rachetés	(150)	(101)	-	-	(129)	(102)	(267)	(107)	(22)	(133)
Titres en circulation, à la clôture	505	622	-	-	2 601	2 114	1 206	1 675	487	551

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

PORTEFEUILLE PRUDENT SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2025

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

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

	Série PWX		Série PWX8		Série S		Série T5		Série T8	
	2025	2024	2025	2024	2025	2024	2025	2024	2025	2024
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	5 746	8 265	1	1	3 901	3 573	6 701	7 461	399	723
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	445	516	–	–	286	253	442	430	20	35
Distributions versées aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	–	–	–	–	(163)	(188)	(14)	(26)
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Total des distributions versées aux porteurs de titres	–	–	–	–	–	–	(163)	(188)	(14)	(26)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	125	26	–	–	269	114	1 483	1 659	8	61
Réinvestissement des distributions	–	–	–	–	–	–	26	49	9	13
Paiements au rachat de titres	(440)	(1 169)	–	–	(465)	(80)	(1 772)	(1 702)	(84)	(140)
Total des opérations sur les titres	(315)	(1 143)	–	–	(196)	34	(263)	6	(67)	(66)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	130	(627)	–	–	90	287	16	248	(61)	(57)
À la clôture	5 876	7 638	1	1	3 991	3 860	6 717	7 709	338	666
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :	Titres		Titres		Titres		Titres		Titres	
Titres en circulation, à l'ouverture	508	766	–	–	368	353	711	791	59	103
Émis	11	2	–	–	25	12	158	177	2	8
Réinvestissement des distributions	–	–	–	–	–	–	3	5	1	2
Rachetés	(38)	(107)	–	–	(45)	(8)	(188)	(182)	(13)	(20)
Titres en circulation, à la clôture	481	661	–	–	348	357	684	791	49	93

	Série LB		Série LF		Série LF5		Série LM		Série LW	
	2025	2024	2025	2024	2025	2024	2025	2024	2025	2024
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	88 259	102 016	52 348	50 351	9 463	9 185	14 533	18 622	180 773	190 963
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	5 104	5 479	3 858	3 025	627	565	853	983	12 830	10 525
Distributions versées aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	–	–	–	–	(218)	(219)	(336)	(434)	–	–
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Total des distributions versées aux porteurs de titres	–	–	–	–	(218)	(219)	(336)	(434)	–	–
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	5 586	5 271	2 540	3 171	530	141	24	30	17 934	9 435
Réinvestissement des distributions	–	–	–	–	148	144	335	432	–	–
Paiements au rachat de titres	(18 147)	(16 038)	(3 284)	(6 903)	(1 104)	(698)	(2 263)	(2 519)	(15 136)	(23 627)
Total des opérations sur les titres	(12 561)	(10 767)	(744)	(3 732)	(426)	(413)	(1 904)	(2 057)	2 798	(14 192)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	(7 457)	(5 288)	3 114	(707)	(17)	(67)	(1 387)	(1 508)	15 628	(3 667)
À la clôture	80 802	96 728	55 462	49 644	9 446	9 118	13 146	17 114	196 401	187 296
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :	Titres		Titres		Titres		Titres		Titres	
Titres en circulation, à l'ouverture	7 527	9 136	4 803	4 849	731	709	2 337	2 994	17 711	19 645
Émis	466	467	227	301	40	11	3	4	1 748	955
Réinvestissement des distributions	–	–	–	–	11	11	54	69	–	–
Rachetés	(1 541)	(1 418)	(297)	(663)	(87)	(54)	(365)	(403)	(1 459)	(2 411)
Titres en circulation, à la clôture	6 452	8 185	4 733	4 487	695	677	2 029	2 664	18 000	18 189

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

PORTEFEUILLE PRUDENT SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2025

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

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

	Série LW5		Série LX	
	2025	2024	2025	2024
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES				
À l'ouverture	58 965	67 042	2 679	3 487
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	3 861	3 709	157	182
Distributions versées aux porteurs de titres :				
Revenu de placement	–	–	–	–
Gains en capital	–	–	–	–
Remboursement de capital	(1 438)	(1 600)	(62)	(80)
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–
Total des distributions versées aux porteurs de titres	(1 438)	(1 600)	(62)	(80)
Opérations sur les titres :				
Produit de l'émission de titres	2 078	1 091	123	138
Réinvestissement des distributions	1 319	1 453	60	76
Paievements au rachat de titres	(5 633)	(6 321)	(589)	(591)
Total des opérations sur les titres	(2 236)	(3 777)	(406)	(377)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	187	(1 668)	(311)	(275)
À la clôture	59 152	65 374	2 368	3 212
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :				
Titres en circulation, à l'ouverture	5 393	6 130	292	380
Émis	191	98	13	15
Réinvestissement des distributions	121	133	7	8
Rachetés	(516)	(577)	(64)	(64)
Titres en circulation, à la clôture	5 189	5 784	248	339

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

PORTEFEUILLE PRUDENT SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2025

TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

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

	2025 \$	2024 \$
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation	68 822	62 509
Ajustements pour :		
Perte (profit) net(te) réalisé(e) sur les placements	(13 199)	797
Variation de la perte (du profit) net(te) latent(e) sur les placements	(48 966)	(59 613)
Achat de placements	(46 938)	(137 083)
Produit de la vente et de l'échéance de placements	100 910	234 328
(Augmentation) diminution des sommes à recevoir et autres actifs	(1 489)	2 001
Augmentation (diminution) des sommes à payer et autres passifs	(106)	(4)
Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités d'exploitation	59 034	102 935
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de titres	51 490	45 956
Paiements au rachat de titres	(102 881)	(135 339)
Distributions versées, déduction faite des réinvestissements	(726)	(865)
Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités de financement	(52 117)	(90 248)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie	6 917	12 687
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à l'ouverture	332	567
Incidence des fluctuations des taux de change sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie	13	(48)
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture	7 262	13 206
Trésorerie	3 745	–
Équivalents de trésorerie	3 517	13 406
Dette bancaire	–	(200)
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture	7 262	13 206
Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :		
Dividendes reçus déduction faite des retenues d'impôt	4 342	5 829
Impôts étrangers payés (recouvrés)	–	–
Intérêts reçus déduction faite des retenues d'impôt	12 753	13 135
Intérêts versés	5	18

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

PORTEFEUILLE PRUDENT SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2025

TABLEAU DES PLACEMENTS

Au 30 septembre 2025

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
FONDS/BILLETS NÉGOCIÉS EN BOURSE					
¹ FNB de revenu fixe canadien stratégique Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	1 378 200	25 984	26 916
¹ FINB Obligations de marchés émergents Mackenzie (couvert en \$ CA)	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	119 900	11 835	9 620
¹ FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	1 138 260	104 176	98 983
Total des fonds/billets négociés en bourse				141 995	135 519
FONDS COMMUNS DE PLACEMENT					
² Mandat d'obligations canadiennes Mack, série R	Canada	Fonds communs de placement	27 488 425	272 564	249 852
² Mandat d'actions canadiennes Mack, série R	Canada	Fonds communs de placement	5 290 941	72 220	108 057
² Mandat élargi d'actions Mack, série R	Canada	Fonds communs de placement	2 587 401	29 295	42 987
² Mandat d'actions EAEO Mack, série R	Canada	Fonds communs de placement	3 414 914	47 503	60 593
² Mandat d'obligations mondiales Mack, série R	Canada	Fonds communs de placement	1 492 382	14 122	12 222
² Mandat d'actions américaines Mack, série R	Canada	Fonds communs de placement	4 359 374	65 441	101 139
² Fonds de perception de primes de risque diversifiées Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	2 088 396	29 546	32 789
² Fonds de grandes capitalisations des marchés émergents Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	551 964	6 288	9 148
² Fonds de petites capitalisations des marchés émergents Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	233 942	2 343	3 218
² Fonds de primes de risque améliorées sur actions Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	791 684	11 197	13 033
² Fonds de primes de risque améliorées sur titres à revenu fixe Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	4 844 903	46 926	30 306
² Fonds mondial de dividendes Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	677 427	9 407	17 074
² Fonds mondial lié à l'inflation Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	98 124	938	805
² Fonds mondial macro Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	2 915 927	30 111	31 022
² Fonds quantitatif international de grandes capitalisations Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	509 200	5 313	7 423
² Fonds d'obligations de sociétés nord-américaines Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	8 108 228	80 889	77 663
² Fonds d'obligations souveraines Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	10 551 006	94 661	90 454
² Fonds quantitatif américain de grandes capitalisations Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	93 501	1 113	1 870
² Fonds quantitatif américain de petites capitalisations Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	193 428	2 174	2 818
Total des fonds communs de placement				822 051	892 473
FONDS PRIVÉS					
³ Northleaf Global Private Markets Investors-B LP	Canada	Fonds privés	792	1 156	1 158
Total des fonds privés				1 156	1 158
Coûts de transaction				(59)	–
Total des placements				965 143	1 029 150
Instruments dérivés (se reporter au tableau des instruments dérivés)					(366)
Trésorerie et équivalents de trésorerie					7 262
Autres éléments d'actif moins le passif					2 457
Actif net attribuable aux porteurs de titres					1 038 503

¹ Ce fonds négocié en bourse est géré par Mackenzie.

² Ce fonds est géré par Mackenzie.

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

PORTEFEUILLE PRUDENT SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2025

APERÇU DU PORTEFEUILLE

30 SEPTEMBRE 2025

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	63,5
Obligations	49,0
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)	14,5
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)	–
Actions	46,0
Actions	36,3
Contrats à terme standardisés sur actions (acheteur)	9,7
Contrats à terme standardisés sur actions (vendeur)	–
Fonds communs de placement	0,9
Marchandises	0,4
Contrats à terme standardisés sur marchandises (acheteur)	0,4
Marchandises	–
Contrats à terme standardisés sur marchandises (vendeur)	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie	0,3
Fonds/billets négociés en bourse	0,1
Autres éléments d'actif (de passif)	(11,2)

31 MARS 2025

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	63,7
Obligations	50,2
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)	13,5
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)	–
Actions	41,1
Actions	36,0
Contrats à terme standardisés sur actions (acheteur)	5,1
Contrats à terme standardisés sur actions (vendeur)	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie	2,2
Fonds communs de placement	0,8
Marchandises	0,4
Contrats à terme standardisés sur marchandises (acheteur)	0,4
Contrats à terme standardisés sur marchandises (vendeur)	–
Fonds/billets négociés en bourse	0,1
Autres éléments d'actif (de passif)	(8,3)

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	45,9
Canada	45,8
Autre	6,1
Royaume-Uni	2,7
Allemagne	1,6
Japon	1,6
Mexique	1,2
France	1,2
Australie	1,1
Pologne	0,9
Espagne	0,8
Suisse	0,7
Pays-Bas	0,7
Chine	0,6
Trésorerie et équivalents de trésorerie	0,3
Autres éléments d'actif (de passif)	(11,2)

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	45,2
États-Unis	42,2
Autre	5,7
Royaume-Uni	2,8
Allemagne	2,2
Trésorerie et équivalents de trésorerie	2,2
Australie	1,6
Japon	1,3
France	1,1
Suisse	0,8
Nouvelle-Zélande	0,8
Pays-Bas	0,7
Chine	0,6
Espagne	0,6
Taiwan	0,5
Autres éléments d'actif (de passif)	(8,3)

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	30,0
Obligations d'État étrangères	14,2
Obligations fédérales	13,3
Autre	13,0
Services financiers	8,5
Technologie de l'information	7,2
Obligations provinciales	4,9
Produits industriels	4,1
Consommation discrétionnaire	3,0
Soins de santé	3,0
Énergie	2,6
Matériaux	2,6
Services de communication	2,2
Consommation de base	1,8
Marchandises	0,5
Trésorerie et équivalents de trésorerie	0,3
Autres éléments d'actif (de passif)	(11,2)

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	30,8
Obligations d'État étrangères	14,8
Obligations fédérales	11,5
Services financiers	8,7
Autre	8,3
Technologie de l'information	6,1
Obligations provinciales	5,5
Produits industriels	4,2
Consommation discrétionnaire	3,1
Soins de santé	3,1
Énergie	3,0
Matériaux	2,3
Consommation de base	2,3
Trésorerie et équivalents de trésorerie	2,2
Services de communication	2,0
Marchandises	0,4
Autres éléments d'actif (de passif)	(8,3)

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

PORTEFEUILLE PRUDENT SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2025

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS

Au 30 septembre 2025

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 l'indice CAC 40 (10 euros), octobre 2025	(7)	17 octobre 2025	7 878,47 EUR	(903)	–	(4)
Contrats à terme standardisés sur l'indice IBEX 35, octobre 2025	7	17 octobre 2025	15 199,75 EUR	1 773	33	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice OMXS30, octobre 2025	(39)	17 octobre 2025	2 642,79 SEK	(1 536)	–	(18)
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE Taiwan, octobre 2025	13	30 octobre 2025	2 175,00 USD	1 547	–	(27)
Contrats à terme standardisés sur l'indice MSCI Singapore, octobre 2025	(18)	30 octobre 2025	446,75 SGD	(869)	–	(1)
Contrats à terme standardisés sur l'indice Tokyo TOPIX, décembre 2025	8	11 décembre 2025	3 125,50 JPY	2 365	12	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice S&P/TSX 60, décembre 2025	(2)	18 décembre 2025	1 731,14 CAD	(709)	–	(17)
Contrats à terme standardisés sur l'indice SPI 200, décembre 2025	(26)	18 décembre 2025	8 895,06 AUD	(5 310)	22	–
Contrats à terme standardisés E-Mini sur l'indice Standard & Poor's 500 (CME), décembre 2025	14	19 décembre 2025	6 715,40 USD	6 564	48	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice FTSE 100, décembre 2025	(3)	19 décembre 2025	9 279,50 GBP	(528)	–	(7)
Contrats à terme standardisés sur l'indice Bolsa Mexicana, décembre 2025	49	19 décembre 2025	62 401,40 MXN	2 360	38	–
Contrats à terme standardisés Mini sur l'indice DAX, décembre 2025	(2)	19 décembre 2025	23 656,00 EUR	(392)	–	(6)
Contrats à terme standardisés sur l'indice POLAND WIG 20, décembre 2025	164	19 décembre 2025	2 837,15 PLN	3 588	27	–
Contrats à terme standardisés sur l'indice Swiss Market, décembre 2025	(13)	19 décembre 2025	12 073,29 CHF	(2 751)	–	(9)
Total des contrats à terme standardisés				5 199	180	(89)

* La valeur notionnelle représente l'exposition aux instruments sous-jacents au 30 septembre 2025.

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	2 790 CAD	(2 032) USD	20 novembre 2025	(2 797)	(2 829)	–	(32)
A	6 753 CAD	(4 919) USD	20 novembre 2025	(6 768)	(6 845)	–	(77)
A	22 220 CAD	(16 186) USD	20 novembre 2025	(22 269)	(22 525)	–	(256)
A	1 325 CAD	(966) USD	20 novembre 2025	(1 328)	(1 345)	–	(17)
A	662 CAD	(483) USD	20 novembre 2025	(664)	(672)	–	(8)
A	1 325 CAD	(966) USD	20 novembre 2025	(1 327)	(1 344)	–	(17)
A	2 240 CAD	(1 626) USD	20 novembre 2025	(2 245)	(2 263)	–	(18)
A	1 920 CAD	(1 394) USD	20 novembre 2025	(1 924)	(1 940)	–	(16)
A	2 240 CAD	(1 626) USD	20 novembre 2025	(2 245)	(2 263)	–	(18)
A	1 374 CAD	(997) USD	20 novembre 2025	(1 377)	(1 387)	–	(10)
A	1 374 CAD	(997) USD	20 novembre 2025	(1 377)	(1 387)	–	(10)
A	1 178 CAD	(854) USD	20 novembre 2025	(1 181)	(1 190)	–	(9)
A	1 383 USD	(1 895) CAD	20 novembre 2025	1 365	1 390	25	–
A	1 844 USD	(2 527) CAD	20 novembre 2025	1 820	1 853	33	–
A	1 383 USD	(1 895) CAD	20 novembre 2025	1 365	1 390	25	–
A	2 394 USD	(3 302) CAD	20 novembre 2025	2 378	2 400	22	–
A	2 394 USD	(3 302) CAD	20 novembre 2025	2 378	2 400	22	–
A	2 185 USD	(1 755) CHF	20 novembre 2025	(3 041)	(3 086)	–	(45)
A	114 CHF	(142) USD	20 novembre 2025	198	200	2	–

PORTEFEUILLE PRUDENT SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2025

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

Au 30 septembre 2025

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	63 CHF	(79) USD	20 novembre 2025	110	111	1	–
A	82 CHF	(103) USD	20 novembre 2025	144	144	–	–
A	206 CHF	(264) USD	20 novembre 2025	367	363	–	(4)
A	162 CHF	(206) USD	20 novembre 2025	286	285	–	(1)
A	6 812 EUR	(7 949) USD	20 novembre 2025	11 062	11 161	99	–
A	4 442 EUR	(5 183) USD	20 novembre 2025	7 213	7 278	65	–
A	11 830 EUR	(13 804) USD	20 novembre 2025	19 210	19 382	172	–
A	8 885 USD	(7 613) EUR	20 novembre 2025	(12 364)	(12 475)	–	(111)
A	653 EUR	(765) USD	20 novembre 2025	1 065	1 069	4	–
A	942 EUR	(1 103) USD	20 novembre 2025	1 535	1 543	8	–
A	947 EUR	(1 116) USD	20 novembre 2025	1 553	1 551	–	(2)
A	857 EUR	(1 019) USD	20 novembre 2025	1 418	1 403	–	(15)
A	600 EUR	(714) USD	20 novembre 2025	993	983	–	(10)
A	257 EUR	(305) USD	20 novembre 2025	425	421	–	(4)
A	797 EUR	(943) USD	20 novembre 2025	1 312	1 305	–	(7)
A	797 EUR	(943) USD	20 novembre 2025	1 312	1 305	–	(7)
A	10 732 USD	(7 998) GBP	20 novembre 2025	(14 934)	(14 969)	–	(35)
A	1 302 GBP	(1 758) USD	20 novembre 2025	2 446	2 437	–	(9)
A	640 USD	(474) GBP	20 novembre 2025	(890)	(888)	2	–
A	4 494 USD	(3 323) GBP	20 novembre 2025	(6 254)	(6 219)	35	–
A	699 GBP	(954) USD	20 novembre 2025	1 328	1 308	–	(20)
A	489 GBP	(661) USD	20 novembre 2025	920	915	–	(5)
A	2 590 582 JPY	(17 683) USD	20 novembre 2025	24 608	24 506	–	(102)
A	1 775 265 JPY	(12 118) USD	20 novembre 2025	16 864	16 794	–	(70)
A	701 USD	(102 792) JPY	20 novembre 2025	(976)	(973)	3	–
A	701 USD	(102 792) JPY	20 novembre 2025	(976)	(973)	3	–
A	575 USD	(84 089) JPY	20 novembre 2025	(800)	(795)	5	–
A	116 034 JPY	(795) USD	20 novembre 2025	1 106	1 097	–	(9)
A	116 034 JPY	(795) USD	20 novembre 2025	1 106	1 097	–	(9)
A	124 048 JPY	(852) USD	20 novembre 2025	1 186	1 174	–	(12)
A	151 614 JPY	(1 041) USD	20 novembre 2025	1 449	1 434	–	(15)
A	115 721 JPY	(788) USD	20 novembre 2025	1 096	1 095	–	(1)
A	115 721 JPY	(788) USD	20 novembre 2025	1 096	1 094	–	(2)
Total des contrats de change à terme de gré à gré						526	(983)
Total des actifs dérivés							706
Total des passifs dérivés							(1 072)

PORTEFEUILLE PRUDENT SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2025

NOTES ANNEXES

1. Périodes comptables et renseignements généraux

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.

L'information fournie dans les présents états financiers et dans les notes annexes se rapporte aux semestres clos les 30 septembre 2025 et 2024, ou est présentée à ces dates. Pour l'exercice au cours duquel un fonds ou une série est établi(e) ou rétabli(e), l'information fournie se rapporte à la période commençant à la date d'établissement ou de rétablissement. Lorsqu'une série d'un fonds a été dissoute au cours de l'une ou l'autre des périodes, l'information concernant la série est fournie jusqu'à la fermeture des bureaux à la date de dissolution. Se reporter à la note 10 a) pour la date de constitution du Fonds et la date d'établissement de chacune des séries.

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 ») est une filiale indirecte à part entière de La Compagnie d'Assurance du Canada sur la Vie (« Canada Vie »), elle-même une filiale de Power Corporation du Canada. Les placements du Fonds dans des sociétés du groupe de sociétés Power sont identifiés dans le tableau des placements.

2. Base d'établissement et mode de présentation

Les présents états financiers intermédiaires non audités (les « états financiers ») ont été établis conformément aux Normes IFRS de comptabilité (« IFRS »), y compris la Norme comptable internationale 34 (« IAS »), *Information financière intermédiaire*, telles qu'elles ont été publiées par l'International Accounting Standards Board (l'« IASB »). Ces états financiers ont été établis selon les mêmes méthodes comptables, les mêmes jugements comptables critiques et les mêmes estimations que ceux qui ont été utilisés pour établir les états financiers annuels audités les plus récents du Fonds, soit ceux de l'exercice clos le 31 mars 2025. La note 3 présente un résumé des méthodes comptables significatives du Fonds en vertu des IFRS.

Sauf indication contraire, tous les montants présentés dans ces états financiers sont en dollars canadiens, soit la monnaie fonctionnelle et la monnaie de présentation du Fonds, et sont arrondis au millier près. Les états financiers ont été établis sur la base de la continuité d'exploitation au moyen de la méthode du coût historique, sauf dans le cas des instruments financiers qui ont été évalués à la juste valeur.

Les présents états financiers ont été approuvés aux fins de publication par le conseil d'administration de Mackenzie le 13 novembre 2025.

3. Méthodes comptables significatives

a) Instruments financiers

Les instruments financiers comprennent des actifs financiers et des passifs financiers tels que des titres de créance, des titres de capitaux propres, des fonds d'investissement et des dérivés. Le Fonds classe et évalue ses instruments financiers conformément à l'IFRS 9, *Instruments financiers* (« IFRS 9 »). Au moment de la comptabilisation initiale, les instruments financiers sont classés comme étant à la juste valeur par le biais du résultat net (la « JVRN »). Tous les instruments financiers sont comptabilisés dans l'état de la situation financière lorsque le Fonds devient partie aux exigences contractuelles de l'instrument. Les actifs financiers sont décomptabilisés lorsque le droit de percevoir les flux de trésorerie liés aux instruments est échu ou que le Fonds a transféré la quasi-totalité des risques et avantages inhérents à la propriété de ceux-ci. Les passifs financiers sont décomptabilisés lorsque l'obligation est acquittée, est annulée ou expire. Les opérations d'achat et de vente de placements sont comptabilisées à la date de l'opération.

Les instruments financiers sont par la suite évalués à la juste valeur par le biais du résultat net, et les variations de la juste valeur sont comptabilisées à l'état du résultat global au poste Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets – Profit (perte) net(te) latent(e).

Le coût des placements est calculé en fonction d'un coût moyen pondéré.

Les profits et les pertes réalisé(e)s et latent(e)s sur les placements sont calculé(e)s en fonction du coût moyen pondéré des placements, mais excluent les commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille, qui sont présentés de manière distincte dans l'état du résultat global au poste Commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille.

Les profits et les pertes découlant de la variation de la juste valeur des placements sont pris en compte dans l'état du résultat global de la période au cours de laquelle ils surviennent.

Le Fonds comptabilise ses placements dans des fonds de placement à capital variable non cotés, des fonds privés (« Fonds sous-jacents ») et des fonds négociés en bourse (« FNB »), le cas échéant, à la juste valeur par le biais du résultat net. Pour les fonds privés, Mackenzie aura recours aux évaluations fournies par les gestionnaires des fonds privés, ce qui représente la quote-part du Fonds de l'actif net de ces fonds privés. Les placements du Fonds dans des Fonds sous-jacents et des FNB, le cas échéant, sont présentés dans le tableau des placements à la juste valeur, ce qui représente l'exposition maximale du Fonds en lien avec ces placements.

Les titres rachetables du Fonds comportent de multiples obligations contractuelles différentes et confèrent aux porteurs de titres le droit de faire racheter leur participation dans le Fonds contre un montant de trésorerie égal à leur part proportionnelle de la valeur liquidative du Fonds, faisant en sorte qu'ils respectent le critère de classification à titre de passifs financiers, conformément à l'IAS 32, *Instruments financiers : Présentation*. L'obligation du Fonds à l'égard de l'actif net attribuable aux porteurs de titres est présentée au prix de rachat.

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

PORTEFEUILLE PRUDENT SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2025

NOTES ANNEXES

3. Méthodes comptables significatives (suite)

b) Évaluation de la juste valeur

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

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

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

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

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

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

La fluctuation quotidienne de la valeur des contrats à terme standardisés ou des swaps, de même que les règlements au comptant effectués tous les jours par le Fonds, le cas échéant, représentent la variation des profits ou des pertes latent(e)s, mieux établi(e)s au prix de règlement. Ces profits ou pertes latent(e)s sont inscrit(e)s et comptabilisé(e)s de cette manière jusqu'à ce que le Fonds dénoue le contrat ou que le contrat arrive à échéance. La marge versée ou reçue au titre des contrats à terme standardisés ou des swaps figure en tant que créance dans l'état de la situation financière au poste Marge sur instruments dérivés. Toute modification de l'exigence en matière de marge est rajustée quotidiennement.

Les primes payées pour l'achat d'options sont comptabilisées dans l'état de la situation financière au poste Placements à la juste valeur.

Les primes reçues à la souscription d'options sont incluses dans l'état de la situation financière à titre de passif et sont par la suite ajustées quotidiennement à leur juste valeur. Si une option souscrite vient à échéance sans avoir été exercée, la prime reçue est inscrite à titre de profit réalisé. Lorsqu'une option d'achat souscrite est exercée, l'écart entre le produit de la vente plus la valeur de la prime et le coût du titre est inscrit à titre de profit ou de perte réalisé(e). Lorsqu'une option de vente souscrite est exercée, le coût du titre acquis correspond au prix d'exercice de l'option moins la prime reçue.

Se reporter au tableau des instruments dérivés et au tableau des options achetées/vendues, le cas échéant, compris dans le tableau des placements pour la liste des instruments dérivés et des options au 30 septembre 2025.

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.

PORTEFEUILLE PRUDENT SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2025

NOTES ANNEXES

3. Méthodes comptables significatives (suite)

b) Évaluation de la juste valeur (suite)

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 d'entrée qui ne sont pas fondées sur des données de marché observables.

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

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

c) Comptabilisation des produits

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

PORTEFEUILLE PRUDENT SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2025

NOTES ANNEXES

3. Méthodes comptables significatives (suite)

i) Valeur liquidative par titre

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

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

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

k) Fusions

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

l) Modifications comptables futures

i) Classement et évaluation des instruments financiers (modifications aux normes IFRS 9 et IFRS 7)

En mai 2024, l'International Accounting Standards Board (l'« IASB ») a publié des modifications aux normes IFRS 9, *Instruments financiers*, et IFRS 7, *Instruments financiers : Informations à fournir* (« IFRS 7 »). Ces modifications portent sur le classement des actifs financiers et sur la comptabilisation des éléments réglés au moyen de paiements électroniques selon les exigences en matière de classement et d'évaluation de l'IFRS 9. Les possibles répercussions incluent notamment la modification des délais de comptabilisation et de décomptabilisation des instruments financiers dans certaines situations où les règlements prennent plus d'un jour. Ces modifications présentent également la méthode comptable choisie pour la décomptabilisation d'un passif financier réglé au moyen d'un système de paiement électronique avant la date de règlement. Ces modifications s'appliquent aux périodes d'un an à compter du 1^{er} janvier 2026, mais son application anticipée est permise.

ii) IFRS 18, *États financiers : Présentation et informations à fournir* (« IFRS 18 »)

En avril 2024, l'IASB a publié l'IFRS 18. L'IFRS 18, qui remplace la norme IAS 1, *Présentation des états financiers*, comporte de nouvelles exigences de présentation applicables à certaines catégories et aux sous-totaux dans l'état du résultat global, de nouvelles exigences concernant les informations à fournir sur les indicateurs de performance définis par la direction et d'autres exigences visant les informations trop résumées ou trop détaillées. La norme s'applique aux périodes d'un an à compter du 1^{er} janvier 2027, mais son application anticipée est permise.

Mackenzie évalue actuellement l'incidence de l'adoption des normes décrites ci-dessus. Aucune autre nouvelle norme, modification ou interprétation ne devrait avoir d'incidence importante sur les états financiers du Fonds.

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;

PORTEFEUILLE PRUDENT SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2025

NOTES ANNEXES

4. Estimations et jugements comptables critiques (suite)

- II. les activités des Fonds sous-jacents sont assujetties à des restrictions aux termes de leurs documents de placement;
- III. les Fonds sous-jacents ont des objectifs de placement précis et bien définis visant à offrir des occasions de placement aux investisseurs tout en leur transférant les risques et avantages connexes.

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

5. Impôts sur le résultat

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

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

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

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 2025 et 2024 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

a) 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. L'exposition du Fonds aux risques financiers est concentrée dans ses placements, lesquels sont présentés dans le tableau des placements au 30 septembre 2025, 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.

PORTEFEUILLE PRUDENT SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2025

NOTES ANNEXES

8. Risques découlant des instruments financiers (suite)

b) 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).

c) Risque de change

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

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

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

d) Risque de taux d'intérêt

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

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

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

e) Autre risque de prix

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

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

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

f) 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.

PORTEFEUILLE PRUDENT SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2025

NOTES ANNEXES

8. Risques découlant des instruments financiers (suite)

f) Risque de crédit (suite)

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.

g) Fonds sous-jacents

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

9. Autres informations

Abréviations

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

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

PORTEFEUILLE PRUDENT SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2025

NOTES ANNEXES

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

a) Constitution du Fonds et renseignements sur les séries

Date de constitution : 19 novembre 2008

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

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

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

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

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

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

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

Les titres de série FR sont offerts aux particuliers qui détiennent un régime enregistré d'épargne-invalidité offert par Mackenzie par l'entremise du Bureau du tuteur et curateur public du gouvernement de l'Ontario ou de programmes semblables.

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

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

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

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

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

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

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

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

Les titres de série J ne sont plus offerts à la vente.

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

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

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

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

Les titres de série LM ne sont plus offerts à la vente, sauf aux investisseurs qui participaient aux programmes de prélèvements automatiques en vigueur en date du 25 novembre 2015.

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

PORTEFEUILLE PRUDENT SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2025

NOTES ANNEXES

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

c) Prêt de titres

	30 septembre 2025		31 mars 2025	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
Valeur des titres prêtés	–		–	
Valeur des biens reçus en garantie	–		–	

	30 septembre 2025		30 septembre 2024	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
Revenus de prêts de titres bruts	1	100,0	38	100,0
Impôt retenu à la source	–	–	(9)	(23,7)
	1	100,0	29	76,3
Paiements à l'agent de prêt de titres	–	–	(5)	(13,2)
Revenu tiré du prêt de titres	1	100,0	24	63,1

d) Commissions

Pour les périodes closes les 30 septembre 2025 et 2024, les commissions versées par le Fonds n'ont pas généré de services de tiers fournis ou payés par les courtiers.

e) Risques découlant des instruments financiers

i. Exposition au risque et gestion du risque

Le Fonds vise un revenu et une certaine croissance du capital à long terme en investissant principalement dans d'autres fonds communs de placement qui investissent dans des actions, des titres à revenu fixe et d'autres catégories d'actifs canadiens et étrangers, mais il peut aussi investir directement dans des titres. La répartition de l'actif du Fonds se situera généralement dans les fourchettes suivantes : 25 % à 45 % en actions et 45 % à 75 % en titres à revenu fixe. En plus d'avoir une exposition aux titres à revenu fixe et aux actions, le Fonds peut également investir dans d'autres catégories d'actif. Le Fonds est diversifié en termes d'exposition géographique, d'exposition sectorielle, d'exposition factorielle, de capitalisation boursière, de style de placement du gestionnaire de portefeuille, de qualité du crédit et de durée.

ii. Risque de change

Le Fonds est exposé au risque de change en raison de ses placements dans des fonds/billets négociés en bourse, des instruments dérivés et des fonds communs de placement. Tous les fonds sous-jacents sont libellés en dollars canadiens. Toutefois, le Fonds est indirectement exposé au risque que la valeur des instruments financiers libellés en devises détenus par les fonds sous-jacents fluctue en raison de variations des taux de change. Le Fonds et les fonds sous-jacents peuvent couvrir une partie ou la totalité de leur exposition au risque de change.

Au 30 septembre 2025, si les taux de change des monnaies étrangères avaient connu une hausse de 5 % par rapport au dollar canadien, toute autre variable demeurant constante, l'actif net aurait diminué d'environ 11 972 \$ ou 1,2 % du total de l'actif net (13 461 \$ ou 1,3 % au 31 mars 2025). De même, si les taux de change des monnaies étrangères avaient connu une baisse de 5 % par rapport au dollar canadien, toute autre variable demeurant constante, l'actif net aurait augmenté d'environ 11 977 \$ ou 1,2 % du total de l'actif net (13 461 \$ ou 1,3 % au 31 mars 2025). En pratique, les résultats réels de négociation peuvent différer et l'écart pourrait être significatif.

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 2025	Obligations (\$)	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
			Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
			(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	–	–				
1 an à 5 ans	–	–				
5 ans à 10 ans	–	–				
Plus de 10 ans	–	–				
Total	–	–				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt			(40 225)	(3,9)	40 262	3,9

PORTEFEUILLE PRUDENT SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2025

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 2025	Obligations (\$)	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
			Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
			(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	–	2 559				
1 an à 5 ans	–	–				
5 ans à 10 ans	–	–				
Plus de 10 ans	–	–				
Total	–	2 559				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt			(42 805)	(4,2)	42 805	4,2

Le Fonds est exposé indirectement au risque que la valeur des instruments financiers portant intérêt détenus dans les fonds sous-jacents fluctue selon les variations des taux d'intérêt du marché en vigueur.

iv. Autre risque de prix

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

Incidence sur l'actif net	Augmentation de 10 %		Diminution de 10 %	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
30 septembre 2025	45 420	4,4	(45 377)	(4,4)
31 mars 2025	41 224	4,0	(41 151)	(4,0)

v. Risque de crédit

La plus forte concentration indirecte du risque de crédit pour ce Fonds se trouve dans les titres de créance, tels que les obligations, détenus par les fonds sous-jacents. La juste valeur des titres de créance tient compte de la solvabilité de l'émetteur de ces titres. Pour de plus amples renseignements au sujet du risque de crédit des fonds sous-jacents, veuillez vous reporter aux états financiers des fonds sous-jacents, disponibles sur le site Web de SEDAR+ à l'adresse www.sedarplus.ca ou à l'adresse www.placementsmackenzie.com.

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 2025				31 mars 2025			
	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Fonds/billets négociés en bourse	135 519	–	–	135 519	136 248	–	–	136 248
Fonds communs de placement	892 473	–	–	892 473	884 834	–	–	884 834
Fonds privés	–	–	1 158	1 158	–	–	–	–
Actifs dérivés	180	526	–	706	129	3 825	–	3 954
Passifs dérivés	(89)	(983)	–	(1 072)	(26)	(4 413)	–	(4 439)
Placements à court terme	–	3 517	–	3 517	–	–	–	–
Total	1 028 083	3 060	1 158	1 032 301	1 021 185	(588)	–	1 020 597

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

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

Le tableau ci-après présente un rapprochement des instruments financiers évalués à la juste valeur à l'aide de données non observables (niveau 3) pour les périodes closes le 30 septembre 2025 et le 31 mars 2025 :

PORTEFEUILLE PRUDENT SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2025

NOTES ANNEXES

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

f) Classement de la juste valeur (suite)

	30 septembre 2025	31 mars 2025
	Fonds privés (\$)	Fonds privés (\$)
Solde, à l'ouverture	–	–
Achats	1 156	–
Ventes	–	–
Transferts entrants	–	–
Transferts sortants	–	–
Profits (pertes) au cours de la période :		
Réalisé(e)s	–	–
Latent(e)s	2	–
Solde, à la clôture	1 158	–
Variation des profits (pertes) latent(e)s au cours de la période attribuables aux titres détenus à la clôture de la période	2	–

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

g) Placements détenus par le gestionnaire et des sociétés affiliées

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

	30 septembre 2025	31 mars 2025
	(\$)	(\$)
Gestionnaire	–	–
Autres fonds gérés par le gestionnaire	–	–
Fonds gérés par des sociétés affiliées au gestionnaire	3 991	3 901

h) Compensation d'actifs financiers et de passifs financiers

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

	30 septembre 2025			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	673	(309)	–	364
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(660)	309	2 768	2 417
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	13	–	2 768	2 781

	31 mars 2025			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	3 537	(2 491)	–	1 046
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(2 658)	2 491	814	647
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	879	–	814	1 693

PORTEFEUILLE PRUDENT SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2025

NOTES ANNEXES

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

i) Intérêts dans des entités structurées non consolidées

Les détails des placements du Fonds dans des fonds sous-jacents au 30 septembre 2025 et au 31 mars 2025 sont les suivants :

30 septembre 2025	% de l'actif net du Fonds sous-jacent	Juste valeur des placements du Fonds (\$)
Mandat d'obligations canadiennes Mack, série R	18,2	249 852
Mandat d'actions canadiennes Mack, série R	6,5	108 057
Mandat élargi d'actions Mack, série R	5,7	42 987
Mandat d'actions EAEO Mack, série R	7,4	60 593
Mandat d'obligations mondiales Mack, série R	13,7	12 222
Mandat d'actions américaines Mack, série R	5,1	101 139
Fonds de perception de primes de risque diversifiées Mackenzie, série R	7,1	32 789
FNB de revenu fixe canadien stratégique Mackenzie	3,0	26 916
FINB Obligations de marchés émergents Mackenzie (couvert en \$ CA)	3,7	9 620
Fonds de grandes capitalisations des marchés émergents Mackenzie, série R	9,0	9 148
Fonds de petites capitalisations des marchés émergents Mackenzie, série R	14,8	3 218
Fonds de primes de risque améliorées sur actions Mackenzie, série R	6,2	13 033
Fonds de primes de risque améliorées sur titres à revenu fixe Mackenzie, série R	11,9	30 306
Fonds mondial de dividendes Mackenzie, série R	0,2	17 074
Fonds mondial lié à l'inflation Mackenzie, série R	1,1	805
Fonds mondial macro Mackenzie, série R	4,0	31 022
Fonds quantitatif international de grandes capitalisations Mackenzie, série R	4,6	7 423
Fonds d'obligations de sociétés nord-américaines Mackenzie, série R	7,3	77 663
Fonds d'obligations souveraines Mackenzie, série R	7,9	90 454
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	18,6	98 983
Fonds quantitatif américain de grandes capitalisations Mackenzie, série R	7,0	1 870
Fonds quantitatif américain de petites capitalisations Mackenzie, série R	5,3	2 818
Northleaf Global Private Markets Investors-B LP	s.o.*	1 158

* Financement le 25 septembre 2025; les données sur l'actif net des fonds sous-jacents n'étaient pas disponibles au 30 septembre 2025 aux fins du calcul de la participation du Fonds.

PORTEFEUILLE PRUDENT SYMÉTRIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2025

NOTES ANNEXES

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

i) Intérêts dans des entités structurées non consolidées (suite)

31 mars 2025	% de l'actif net du Fonds sous-jacent	Juste valeur des placements du Fonds (\$)
Mandat d'obligations canadiennes Mack, série R	18,6	259 011
Mandat d'actions canadiennes Mack, série R	6,9	108 601
Mandat élargi d'actions Mack, série R	6,9	42 234
Mandat d'actions EAEO Mack, série R	8,5	65 308
Mandat d'obligations mondiales Mack, série R	13,5	11 898
Mandat d'actions américaines Mack, série R	5,2	94 653
Fonds de perception de primes de risque diversifiées Mackenzie, série R	7,2	29 202
FNB de revenu fixe canadien de base plus Mackenzie	3,3	26 936
FINB Obligations de marchés émergents Mackenzie (couvert en \$ CA)	3,6	9 393
Fonds de grandes capitalisations des marchés émergents Mackenzie, série R	8,9	8 645
Fonds de petites capitalisations des marchés émergents Mackenzie, série R	12,8	3 123
Fonds de primes de risque améliorées sur actions Mackenzie, série R	6,8	9 397
Fonds de primes de risque améliorées sur titres à revenu fixe Mackenzie, série R	11,7	29 133
Fonds mondial de dividendes Mackenzie, série R	0,2	16 460
Fonds mondial lié à l'inflation Mackenzie, série R	1,5	1 095
Fonds mondial macro Mackenzie, série R	4,0	31 559
Fonds quantitatif international de grandes capitalisations Mackenzie, série R	4,8	7 083
Fonds d'obligations de sociétés nord-américaines Mackenzie, série R	7,7	75 675
Fonds d'obligations souveraines Mackenzie, série R	7,8	88 443
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	19,3	99 919
Fonds quantitatif américain de grandes capitalisations Mackenzie, série R	6,0	1 469
Fonds quantitatif américain de petites capitalisations Mackenzie, série R	4,4	1 845

j) Engagement

	30 septembre 2025		31 mars 2025	
	Montant appelé (\$ US)	Engagement d'investissement total (\$ US)	Montant appelé (\$ US)	Engagement d'investissement total (\$ US)
Northleaf Global Private Markets Investors-B LP ¹⁾	832	7 923	–	–

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

k) Chiffres correspondants

Dans les états financiers, un chiffre correspondant de la période précédente, soit 43 \$, qui était comptabilisé au poste « Impôts étrangers payés (recouvrés) » a été reclassé au poste « Dividendes reçus déduction faite des retenues d'impôt » pour que sa présentation rende fidèlement compte de la nature des impôts étrangers retenus à la source sous forme de charges hors trésorerie et soit conforme à la présentation adoptée pour la période considérée.