

Compte de participation ouvert combiné de la Canada Vie – Avoirs en placements privés

Excluant les anciens blocs d'affaires de la New York Life et de CrownVie

Précisions sur les placements au 30 juin 2021

Volume du portefeuille : 3 793,8 millions \$

Proportion du total des actifs couvrant les passifs dans le compte de participation de la Canada Vie^{MC} : 8,6 %

Lignes directrices de placement

Une équipe spécialisée de Toronto gère un portefeuille diversifié de placements privés. Les placements privés sont des placements en obligations effectués aux termes d'ententes de gré à gré avec divers emprunteurs.

Placements selon la durée

Années jusqu'à l'échéance	Valeurs des actifs (en millions de dollars)	Pourcentage des actifs en placements privés
Zéro à cinq ans	602,9 \$	15,9 %
Plus de cinq ans	3 190,9 \$	84,1 %
Total des actifs en placements privés	3 793,8 \$	100,0 %

Placements selon la qualité

Surprime	Pourcentage
AAA	0,0 %
AA	3,8 %
A	31,8 %
BBB	63,8 %
BB ou moins	0,6 %

Placements selon le secteur

Secteur	Pourcentage
Production électrique	40,4 %
Matériaux de base	7,2 %
Transport	6,6 %
Partenariats public-privé	6,2 %
Services publics	6,1 %
Tous les autres secteurs	33,5 %

À noter :

- Les placements privés sont cotés à l'interne.
- Il est possible que, dans le présent rapport, les totaux ne correspondent pas à 100 % étant donné que les chiffres sont arrondis.
- Les actifs couvrant les passifs du bloc ouvert de la Canada Vie sont mis en commun avec les actifs couvrant les passifs du bloc fermé (toutes les polices de la Canada Vie établies avant la démutualisation de la Canada Vie le 5 novembre 1999). Les valeurs des actifs indiquées correspondent à des répartitions approximatives et sont fournies à titre de référence seulement. Elles sont fondées sur les actifs investis couvrant les passifs uniquement et elles n'incluent pas les actifs couvrant l'excédent.

Moyenne historique des rendements sur un an	31 décembre 2020
Obligations émises dans le public et placements privés	3,3 %
Certificats de placement garanti (CPG) de 5 ans	1,3 %
Obligations du gouvernement du Canada de 5 à 10 ans	0,7 %

Tous les rendements annuels moyens historiques sont des moyennes géométriques.

À noter :

- Les données relatives au rendement sont fournies à titre indicatif seulement et font état du rendement passé, lequel n'est pas nécessairement une indication du rendement futur.
- Le rendement des obligations du compte de participation reflète le rendement des actifs en obligations couvrant les passifs et l'excédent, après déduction des frais de placement. À l'exception des gains et des pertes non réalisés au titre des obligations, qui sont exclus parce que les obligations détenues dans le compte de participation sont généralement conservées jusqu'à l'échéance, le rendement des obligations du compte de participation est calculé conformément aux Normes internationales d'information financière (IFRS) établies par le Conseil des normes comptables internationales (IASB), en vigueur depuis le 1^{er} janvier 2011.
- Le rendement des obligations contribue aux résultats globaux du compte total de participation au chapitre des placements.
- Le rendement des CPG de cinq ans correspond au rendement nominal jusqu'à l'échéance. Source : Statistique Canada, CANSIM tableau 176-0043, série V122526 (site Web de Statistique Canada), 19 février 2021. Pour chaque année civile, la moyenne des taux mensuels des CPG a été utilisée.
- Rendements des obligations du gouvernement du Canada de cinq à dix ans. Source : Statistique Canada, CANSIM tableau 176-0043, série V122486 (site Web de Statistique Canada), 19 février 2021. Pour chaque année civile, la moyenne des valeurs mensuelles a été utilisée.