

## Compte de participation des anciennes polices de la New York Life

Renseignements sur le compte au 31 décembre 2021

Taille du compte : 1 565,5 millions de dollars

### Objectifs de placement du compte :

- Objectif principal : Procurer une croissance stable à long terme
- Objectif secondaire : Offrir un rendement qui soit partiellement réactif aux conditions économiques variables

### Lignes directrices de placement

La division des placements de la compagnie est responsable des actifs du compte de participation, notamment en surveillant et en gérant la répartition globale de l'actif, les risques de placement et les activités de placement dans le respect des paramètres des lignes directrices de placement.

Les lignes directrices de placement doivent être officiellement approuvées et tiennent compte des objectifs commerciaux, des caractéristiques du passif, des besoins de liquidités et de la tolérance à divers risques, dont le risque de taux d'intérêt.

Les actifs du bloc fermé du compte de participation sont investis dans des actifs à revenu fixe à court et à long terme. Cette approche permet de disposer de liquidités pour satisfaire aux obligations à court terme tout en garantissant qu'une partie des actifs sera disponible au fil du temps pour nous permettre de réinvestir en fonction de l'évolution des taux d'intérêt du marché.

Le rendement des actifs couvrant les passifs du compte de participation est utilisé pour calculer la composante placement des participations des propriétaires de police.

| Composition de l'actif                                | Valeur des actifs<br>(en millions de dollars) | % du total des actifs<br>couvrant les passifs |
|---|---|---|
| <b>Actifs à court terme</b>                           |   |   |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie               | 64,5 \$                                       | 4,1 %   |
| <b>Total des actifs à court terme</b>                 | <b>64,5 \$</b>                                | <b>4,1 %</b>                                  |
| <b>Titres à revenu fixe</b>                           |   |   |
| Obligations émises dans le public                     |   |   |
| Obligations d'État                                    | 220,9 \$                                      | 14,1 %  |
| Obligations de sociétés                               | 723,5 \$                                      | 46,2 %  |
| Placements privés                                     | 270,2 \$                                      | 17,3 %  |
| Prêts hypothécaires                                   |   |   |
| Résidentiels  | 0,0 \$  | 0,0 %   |
| Commerciaux   | 136,5 \$                                      | 8,7 %   |
| <b>Total des titres à revenu fixe</b>                 | <b>1 351,2 \$</b>                             | <b>86,3 %</b>                                 |
| <b>Total des actifs investis couvrant les passifs</b> | <b>1 415,7 \$</b>                             | <b>90,4 %</b>                                 |
| Avances sur polices                                   | 121,6 \$                                      | 7,8 %   |
| Autres actifs <sup>1</sup>                            | 28,2 \$                                       | 1,8 %   |
| <b>Total des actifs couvrant les passifs</b>          | <b>1 565,5 \$</b>                             | <b>100,0 %</b>                                |
| <b>Total des actifs du compte de participation</b>    | <b>1 565,5 \$</b>                             | <b>S. O.</b>                                  |

À noter :

- La valeur des actifs est fondée sur les Normes internationales d'information financière (IFRS) établies par le Conseil des normes comptables internationales (CNCI), en vigueur depuis le 1<sup>er</sup> janvier 2011.
- Il est possible que, dans le présent rapport, les totaux ne correspondent pas à 100 % étant donné que les chiffres sont arrondis.

<sup>1</sup> Comprend des actifs tels que les revenus de placements à recevoir et déjà comptabilisés, les primes à recevoir, les impôts futurs et les actifs de réassurance.