

États financiers intermédiaires non audités

Pour la période de six mois close le 30 septembre 2022

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 composant le 1-888-532-3322, en écrivant à l'adresse 255, avenue Dufferin, London (Ontario) N6A 4K1, en visitant notre site Web à www.placementscanadavie.com ou celui de SEDAR à www.sedar.com. 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

Gestion de placements Canada Vie limitée, le gestionnaire du Fonds de revenu stratégique Canada Vie (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.



Gestion
de placements

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

au (en milliers de \$, sauf les montants par part) (note 10)

	30 sept. 2022	31 mars 2022 (Audité)
	\$	\$
ACTIF		
Actifs courants		
Placements à la juste valeur	1 898 697	696 990
Trésorerie et équivalents de trésorerie	49 052	101 006
Intérêts courus à recevoir	8 484	1 301
Dividendes à recevoir	1 630	481
Sommes à recevoir pour placements vendus	1 377	3 911
Sommes à recevoir pour titres émis	36	352
Sommes à recevoir du gestionnaire	63	31
Actifs dérivés	7 612	3 293
Impôt à recouvrer	24	24
Total de l'actif	1 966 975	807 389
PASSIF		
Passifs courants		
Sommes à payer pour placements achetés	5 340	67 644
Sommes à payer pour titres rachetés	1 946	615
Sommes à payer au gestionnaire	19	21
Obligation pour options vendues	46	14
Marge sur instruments dérivés	27	–
Passifs dérivés	26 504	–
Total du passif	33 882	68 294
Actif net attribuable aux porteurs de titres	1 933 093	739 095

	Actif net attribuable aux porteurs de titres (note 3)			
	par titre		par série	
	30 sept. 2022	31 mars 2022 (Audité)	30 sept. 2022	31 mars 2022 (Audité)
Série A	11,34	12,66	196 111	227 091
Série F	11,18	12,49	16 302	9 250
Série F5	13,04	14,83	468	276
Série F8	11,78	13,62	182	1
Série FW	–	10,80	–	8 742
Série FW5	–	14,73	–	285
Série FW8	–	13,77	–	222
Série N	11,44	12,78	52 087	54 948
Série N5	14,22	16,11	1 298	2 425
Série N8	12,12	13,97	385	165
Série QF	10,53	11,77	9 465	10 241
Série QF5	13,23	15,06	63	70
Série QFW	9,67	10,81	4 330	4 759
Série QFW5	12,97	14,74	31	34
Série R	9,18	–	113 185	–
Série S	9,63	10,76	1 445 513	315 962
Série T5	12,30	14,06	2 563	3 002
Série T8	11,38	13,24	1 096	1 364
Série W	11,38	12,72	84 305	94 989
Série W5	12,91	14,73	5 270	4 824
Série W8	11,50	13,36	439	445
			1 933 093	739 095

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

Pour les périodes closes les 30 septembre
(en milliers de \$, sauf les montants par titre) (note 10)

	2022 \$	2021 \$
Revenus		
Dividendes	13 125	4 414
Revenu d'intérêts	17 501	4 477
Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets		
Profit (perte) net(te) réalisé(e)	(9 444)	86 282
Profit (perte) net(te) latent(e)	(170 088)	(67 618)
Revenu tiré du prêt de titres	37	3
Revenu provenant des rabais sur les frais	274	135
Total des revenus (pertes)	(148 595)	27 693
Charges (note 6)		
Frais de gestion	3 163	3 328
Rabais sur les frais de gestion	(59)	(58)
Frais d'administration	521	403
Intérêts débiteurs	14	5
Commissions et autres coûts de transaction liés au portefeuille	474	133
Frais du comité d'examen indépendant	5	–
Charges avant les montants absorbés par le gestionnaire	4 118	3 811
Charges absorbées par le gestionnaire	–	–
Charges nettes	4 118	3 811
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, avant impôt	(152 713)	23 882
Charge (économie) d'impôt étranger retenu à la source	600	177
Charge d'impôt (recouvrée)	–	57
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation	(153 313)	23 648

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation (note 3)			
	par titre		par série	
	2022	2021	2022	2021
Série A	(1,26)	0,48	(22 185)	8 533
Série F	(1,47)	0,55	(1 099)	434
Série F5	(2,19)	0,68	(29)	8
Série F8	(3,75)	0,61	(8)	3
Série FW	(0,65)	0,46	(580)	300
Série FW5	(0,84)	0,68	(19)	13
Série FW8	(0,89)	–	(13)	–
Série N	(1,13)	0,62	(5 039)	2 269
Série N5	(1,66)	0,81	(199)	67
Série N8	(1,62)	0,75	(23)	9
Série QF	(1,10)	0,52	(966)	460
Série QF5	(1,40)	0,66	(7)	12
Série QFW	(0,99)	0,48	(437)	189
Série QFW5	(1,35)	–	(3)	–
Série R	(0,68)	–	(8 697)	–
Série S	(0,93)	0,53	(103 887)	7 700
Série T5	(1,37)	0,53	(285)	72
Série T8	(1,32)	0,57	(131)	61
Série W	(1,24)	0,50	(9 156)	3 309
Série W5	(1,35)	0,59	(507)	166
Série W8	(1,19)	0,56	(43)	43
			(153 313)	23 648

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE LA SITUATION FINANCIÈRE

Pour les périodes closes les 30 septembre
(en milliers de \$, sauf les montants par titre) (note 10)

	Total		Série A		Série F		Série F5		Série F8	
	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	739 095	536 236	227 091	220 944	9 250	9 104	276	152	1	72
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(153 313)	23 648	(22 185)	8 533	(1 099)	434	(29)	8	(8)	3
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(23 126)	(6 968)	(1 245)	(1 920)	(168)	(120)	(4)	(3)	(1)	(1)
Gains en capital	–	(19 076)	–	(7 247)	–	(353)	–	(7)	–	(2)
Remboursement de capital	(292)	(247)	–	–	–	–	(4)	(3)	(1)	(2)
Rabais sur les frais de gestion	(59)	(58)	(51)	(50)	(4)	(4)	–	–	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	(23 477)	(26 349)	(1 296)	(9 217)	(172)	(477)	(8)	(13)	(2)	(5)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	1 481 974	82 700	11 940	31 975	10 375	2 812	445	50	256	–
Réinvestissement des distributions	21 520	26 195	1 294	9 217	172	477	2	9	–	3
Paiements au rachat de titres	(132 706)	(47 449)	(20 733)	(25 863)	(2 224)	(2 018)	(218)	–	(65)	(1)
Total des opérations sur les titres	1 370 788	61 446	(7 499)	15 329	8 323	1 271	229	59	191	2
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	1 193 998	58 745	(30 980)	14 645	7 052	1 228	192	54	181	–
À la clôture	1 933 093	594 981	196 111	235 589	16 302	10 332	468	206	182	72
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :										
Titres en circulation, à l'ouverture			17 932	17 278	741	723	19	10	–	5
Émis			988	2 617	891	238	33	4	20	–
Réinvestissement des distributions			110	719	15	23	–	–	–	–
Rachetés			(1 730)	(2 136)	(189)	(161)	(16)	–	(5)	–
Titres en circulation, à la clôture			17 300	18 478	1 458	823	36	14	15	5

	Série FW		Série FW5		Série FW8		Série N		Série N5	
	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	8 742	6 619	285	292	222	1	54 948	44 119	2 425	1 366
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(580)	300	(19)	13	(13)	–	(5 039)	2 269	(199)	67
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(52)	(91)	(3)	(5)	(2)	–	(941)	(706)	(31)	(26)
Gains en capital	–	(252)	–	(10)	–	–	–	(1 733)	–	(49)
Remboursement de capital	–	–	(5)	(4)	(6)	–	–	–	(28)	(16)
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	(52)	(343)	(8)	(19)	(8)	–	(941)	(2 439)	(59)	(91)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	1 478	1 726	189	–	15	–	6 728	7 801	–	(4)
Réinvestissement des distributions	52	343	1	12	1	–	940	2 439	24	72
Paiements au rachat de titres	(9 640)	(346)	(448)	(3)	(217)	–	(4 549)	(2 288)	(893)	(12)
Total des opérations sur les titres	(8 110)	1 723	(258)	9	(201)	–	3 119	7 952	(869)	56
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	(8 742)	1 680	(285)	3	(222)	–	(2 861)	7 782	(1 127)	32
À la clôture	–	8 299	–	295	–	1	52 087	51 901	1 298	1 398
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :										
Titres en circulation, à l'ouverture	809	608	19	19	16	–	4 298	3 430	150	82
Émis	144	200	14	1	1	–	551	676	–	–
Réinvestissement des distributions	6	17	–	–	–	–	79	125	2	3
Rachetés	(959)	(60)	(33)	–	(17)	–	(376)	(187)	(61)	–
Titres en circulation, à la clôture	–	765	–	20	–	–	4 552	4 044	91	85

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

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

Pour les périodes closes les 30 septembre
(en milliers de \$, sauf les montants par titre) (note 10)

	Série N8		Série QF		Série QF5		Série QFW		Série QFW5	
	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	165	205	10 241	10 138	70	353	4 759	3 945	34	2
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(23)	9	(966)	460	(7)	12	(437)	189	(3)	–
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(4)	(3)	(114)	(125)	(1)	(4)	(60)	(55)	–	–
Gains en capital	–	(6)	–	(364)	–	(9)	–	(153)	–	(1)
Remboursement de capital	(6)	(5)	–	–	(1)	(4)	–	–	(1)	–
Rabais sur les frais de gestion	–	–	(3)	(3)	–	–	–	–	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	(10)	(14)	(117)	(492)	(2)	(17)	(60)	(208)	(1)	(1)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	253	–	1 099	1 657	–	1	319	860	–	27
Réinvestissement des distributions	1	8	117	492	2	17	60	207	1	1
Paiements au rachat de titres	(1)	(39)	(909)	(1 774)	–	(101)	(311)	(363)	–	–
Total des opérations sur les titres	253	(31)	307	375	2	(83)	68	704	1	28
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	220	(36)	(776)	343	(7)	(88)	(429)	685	(3)	27
À la clôture	385	169	9 465	10 481	63	265	4 330	4 630	31	29
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :	Titres		Titres		Titres		Titres		Titres	
Titres en circulation, à l'ouverture	12	14	870	854	5	22	440	363	2	–
Émis	20	1	100	164	–	–	33	144	–	2
Réinvestissement des distributions	–	–	11	23	–	1	6	10	–	–
Rachetés	–	(3)	(82)	(155)	–	(6)	(31)	(91)	–	–
Titres en circulation, à la clôture	32	12	899	886	5	17	448	426	2	2

	Série R		Série S		Série T5		Série T8		Série W	
	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES										
À l'ouverture	–	–	315 962	150 789	3 002	1 755	1 364	1 619	94 989	79 289
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(8 697)	–	(103 887)	7 700	(285)	72	(131)	61	(9 156)	3 309
Distributions aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(1 741)	–	(18 004)	(2 988)	(18)	(21)	(8)	(15)	(682)	(823)
Gains en capital	–	–	–	(5 720)	–	(63)	–	(48)	–	(2 888)
Remboursement de capital	–	–	–	–	(62)	(40)	(49)	(54)	–	–
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	(1)	–	–	(1)	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	(1 741)	–	(18 004)	(8 708)	(81)	(124)	(57)	(118)	(682)	(3 711)
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	133 191	–	1 306 360	19 074	79	497	8	210	7 970	15 097
Réinvestissement des distributions	–	–	18 004	8 707	57	109	31	88	681	3 711
Paiements au rachat de titres	(9 568)	–	(72 922)	(8 660)	(209)	(72)	(119)	(368)	(9 497)	(5 060)
Total des opérations sur les titres	123 623	–	1 251 442	19 121	(73)	534	(80)	(70)	(846)	13 748
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	113 185	–	1 129 551	18 113	(439)	482	(268)	(127)	(10 684)	13 346
À la clôture	113 185	–	1 445 513	168 902	2 563	2 237	1 096	1 492	84 305	92 635
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :	Titres		Titres		Titres		Titres		Titres	
Titres en circulation, à l'ouverture	–	–	29 360	13 887	213	119	103	112	7 470	6 183
Émis	13 329	–	126 143	1 734	6	37	–	15	665	1 378
Réinvestissement des distributions	–	–	1 800	798	4	4	3	6	61	129
Rachetés	(994)	–	(7 261)	(786)	(15)	(5)	(10)	(25)	(791)	(448)
Titres en circulation, à la clôture	12 335	–	150 042	15 633	208	155	96	108	7 405	7 242

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

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

Pour les périodes closes les 30 septembre
(en milliers de \$, sauf les montants par titre) (note 10)

	Série W5		Série W8	
	2022	2021	2022	2021
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES				
À l'ouverture	4 824	4 394	445	1 078
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(507)	166	(43)	43
Distributions aux porteurs de titres :				
Revenu de placement	(43)	(50)	(4)	(12)
Gains en capital	–	(135)	–	(36)
Remboursement de capital	(112)	(82)	(17)	(37)
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	(155)	(267)	(21)	(85)
Opérations sur les titres :				
Produit de l'émission de titres	1 179	917	90	–
Réinvestissement des distributions	71	207	9	76
Paievements au rachat de titres	(142)	(475)	(41)	(6)
Total des opérations sur les titres	1 108	649	58	70
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres	446	548	(6)	28
À la clôture	5 270	4 942	439	1 106
Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :	Titres		Titres	
Titres en circulation, à l'ouverture	327	284	33	74
Émis	86	67	7	–
Réinvestissement des distributions	5	6	1	5
Rachetés	(10)	(30)	(3)	–
Titres en circulation, à la clôture	408	327	38	79

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

Pour les périodes closes les 30 septembre (en milliers de \$) (note 10)

	2022	2021
	\$	\$
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	(153 313)	23 648
Ajustements pour :		
Perte (profit) net(te) réalisé(e) sur les placements	16 243	(86 282)
Variation de la perte (du profit) net(te) latent(e) sur les placements	170 088	67 618
Achat de placements	(1 661 672)	(236 101)
Produit de la vente et de l'échéance de placements	235 510	186 948
(Augmentation) diminution des sommes à recevoir et autres actifs	(8 364)	2 464
Augmentation (diminution) des sommes à payer et autres passifs	25	(4)
Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités d'exploitation	(1 401 483)	(41 709)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de titres	1 468 283	82 439
Paiements au rachat de titres	(117 368)	(47 471)
Distributions versées, déduction faite des réinvestissements	(1 957)	(154)
Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités de financement	1 348 958	34 814
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie	(52 525)	(6 895)
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à l'ouverture	101 006	12 748
Incidence des fluctuations des taux de change sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie	571	(1)
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture	49 052	5 852
Trésorerie	20 304	–
Équivalents de trésorerie	28 748	6 616
Dettes bancaires	–	(764)
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture	49 052	5 852
Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :		
Dividendes reçus	11 976	4 274
Impôts payés	600	234
Intérêts reçus	10 318	6 161
Intérêts versés	14	5

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

TABLEAU DES PLACEMENTS

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS					
407 International Inc. 4,22 % 14-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	328 000	328	319
407 International Inc. 4,19 % 25-04-2042, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	52 000	50	47
407 International Inc. 3,67 % 08-03-2049, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	203 000	177	168
Acuris Finance US Inc. 5,00 % 01-05-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	420 000 USD	489	484
Adient Global Holdings Ltd. 4,88 % 15-08-2026, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	125 000 USD	153	152
Aéroports de Montréal 3,92 % 12-06-2045, rachetables 2044	Canada	Sociétés – Non convertibles	52 000	48	45
AES Panama Generation Holdings SRL 4,38 % 31-05-2030, rachetables 2030	Panama	Sociétés – Non convertibles	900 000 USD	1 049	982
AG Group Holdings Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 29-12-2028	États-Unis	Prêts à terme	109 450 USD	136	148
Agile Group Holdings Ltd. 5,75 % 02-01-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	3 500 000 USD	2 262	1 510
AIMCo Realty Investors LP 2,20 % 04-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	69 000	69	63
AIMCo Realty Investors LP 3,04 % 01-06-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	94 000	89	87
AIMCo Realty Investors LP 2,71 % 01-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 020 000	1 826	1 792
Albertsons Cos. Inc. 3,25 % 15-03-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 518 000 USD	1 728	1 853
Albertsons Cos. Inc. 4,63 % 15-01-2027, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 150 000 USD	1 413	1 436
Albion Acquisitions Ltd., prêt à terme de premier rang, taux variable 31-07-2026	Royaume-Uni	Prêts à terme	286 833 USD	350	378
Albion Financing Ltd. 2 SARL 8,75 % 15-04-2027 144A	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	505 000 USD	618	586
Algonquin Power & Utilities Corp. 2,85 % 15-07-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	750 000	646	626
Algonquin Power & Utilities Corp., taux variable 18-01-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 910 000	3 520	3 238
Alimentation Couche-Tard inc. 2,95 % 25-01-2030, rachetables 2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	750 000 USD	862	848
Allied Universal Holdco LLC 3,63 % 01-06-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 200 000 EUR	1 362	1 217
Alphabet Inc. 1,90 % 15-08-2040	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 918 000 USD	3 767	3 483
Alphabet Inc. 2,05 % 15-08-2050, rachetables 2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	6 163 000 USD	5 541	5 097
Alphabet Inc. 2,25 % 15-08-2060	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	316 000 USD	282	249
AltaGas Ltd., taux variable 11-01-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 700 000	2 441	2 233
AltaGas Ltd., taux variable 17-08-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 260 000	1 260	1 236
Alice Financing SA 5,75 % 15-08-2029 144A	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	1 000 000 USD	1 164	1 058
Alice France SA 2,13 % 15-02-2025, rachetables 2022	France	Sociétés – Non convertibles	500 000 EUR	631	596
Alice France SA 5,13 % 15-07-2029	France	Sociétés – Non convertibles	3 500 000 USD	3 823	3 622
Amazon.com Inc. 3,60 % 13-04-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 222 000 USD	1 552	1 533
Amazon.com Inc. 4,80 % 05-12-2034	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 083 000 USD	1 515	1 477
Anglian Water Services Financing PLC 4,53 % 26-08-2032	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	227 000	227	216
ANI Technologies Private Ltd., prêt à terme de premier rang, taux variable 03-12-2026	Inde	Prêts à terme	217 045 USD	273	289
Apple Inc. 1,70 % 05-08-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 055 000 USD	2 260	2 230
Apple Inc. 2,65 % 11-05-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	5 815 000 USD	5 766	5 267
Apple Inc. 2,40 % 20-08-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	250 000 USD	240	215
Apple Inc. 2,65 % 08-02-2051	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	6 038 000 USD	5 946	5 492
ARC Falcon I Inc., prêt à terme de second rang, taux variable 22-09-2029	États-Unis	Prêts à terme	64 000 USD	81	84
ARC Resources Ltd. 2,35 % 10-03-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	300 000	283	274
ARC Resources Ltd. 3,47 % 10-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000	223	217
Arcos Dorados BV 6,13 % 27-05-2029	Brésil	Sociétés – Non convertibles	1 250 000 USD	1 565	1 577
ARD Finance SA 6,50 % 30-06-2027, rachetables 2022 144A	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	220	191
Ardagh Metal Packaging 4,00 % 01-09-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	950 000 USD	1 057	967
Ardagh Packaging Finance PLC 5,25 % 15-08-2027, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 190 000 USD	1 215	1 039
Artis Real Estate Investment Trust 5,60 % 29-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 700 000	2 697	2 629
Ashtead US Holdings Inc. 4,25 % 01-11-2029	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	950 000 USD	1 151	1 142
Ashton Woods USA LLC 4,63 % 01-08-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 150 000 USD	1 256	1 164
Astra Acquisition Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 22-10-2028	États-Unis	Prêts à terme	140 262 USD	167	166
AT&T Inc. 5,10 % 25-11-2048, rachetables 2048	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	30 000	29	27
Athene Global Funding, taux variable 09-04-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 950 000	1 925	1 929
Athene Global Funding 3,13 % 10-03-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	466 000	455	440
Atlantica Sustainable Infrastructure PLC 4,13 % 15-06-2028 144A	Espagne	Sociétés – Non convertibles	2 896 000 USD	3 348	3 403
AutoCanada Inc. 5,75 % 07-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	675 000	654	589
Avis Budget Car Rental LLC 5,75 % 15-07-2027, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 408 000 USD	2 948	2 928

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Bakelite US Holdco Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 02-02-2029	États-Unis	Prêts à terme	59 850 USD	75	78
Ball Corp. 3,13 % 15-09-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 000 000 USD	1 107	1 046
Bank of America Corp., taux variable 16-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	183 000	181	171
Banque de Montréal 4,31 % 01-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	332 000	325	323
Banque de Montréal 3,19 % 01-03-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 000 000	970	932
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	6 350 000	6 007	5 851
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 500 000	2 500	2 491
La Banque de Nouvelle-Écosse 1,95 % 10-01-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	358 000	346	335
La Banque de Nouvelle-Écosse 1,40 % 01-11-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	836 000	718	703
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 03-05-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	95 000	95	88
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 27-07-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	7 100 000	6 013	5 663
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 27-07-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 164 000	1 164	1 155
Bausch Health Cos. Inc. 9,00 % 15-12-2025, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	500 000 USD	482	435
BCE Inc. 2,20 % 29-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	44 000	43	38
BCI QuadReal Realty 2,55 % 24-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	212 000	198	196
bclMC Realty Corp. 1,75 % 24-07-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	807 000	667	649
BCPE Cycle Merger Sub II Inc. 10,63 % 15-07-2027, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	639 000 USD	644	406
Becle SAB de CV 2,50 % 14-10-2031	Mexique	Sociétés – Non convertibles	1 361 000 USD	1 548	1 472
Bell Canada Inc. 3,60 % 29-09-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 095 000	1 075	1 025
BlueLinx Holdings Inc. 6,00 % 15-11-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	310 000 USD	373	338
Broadcast Media Partners Holdings Inc. 4,50 % 01-05-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 150 000 USD	1 347	1 306
Brookfield Infrastructure Finance ULC 4,20 % 11-09-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 500 000	1 470	1 421
Brookfield Infrastructure Finance ULC 3,41 % 09-10-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 000 000	910	892
Brookfield Infrastructure Finance ULC 2,86 % 01-09-2032, rachetables 2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	90 000	74	72
Brookfield Renewable Partners ULC 4,25 % 15-01-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 550 000	1 541	1 487
Brookfield Renewable Partners ULC 4,29 % 05-11-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000	223	212
Brookfield Residential Properties Inc. 5,13 % 15-06-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000	237	202
BWAY Holding Co. 7,25 % 15-04-2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 100 000 USD	1 351	1 338
California Resources Corp. 7,13 % 01-02-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 360 000 USD	1 773	1 774
Calpine Corp. 3,75 % 01-03-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 750 000 USD	1 933	1 912
Canadian Core Real Estate LP 3,30 % 02-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	75 000	75	69
Banque Canadienne Impériale de Commerce 4,95 % 29-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	461 000	460	459
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 21-04-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 050 000	2 771	2 691
Banque Canadienne Impériale de Commerce 4,38 % 28-10-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 150 000	1 094	1 062
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 28-07-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 782 000	4 776	4 752
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada 3,00 % 08-02-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	950 000	895	868
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 2,54 % 28-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 132 000	1 053	1 008
Banque canadienne de l'Ouest 5,15 % 02-09-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	268 000	268	266
Banque canadienne de l'Ouest, taux variable 31-07-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 080 000	4 537	4 339
CANPACK SA/CANPACK US LLC 3,88 % 15-11-2029 144A	Pologne	Sociétés – Non convertibles	744 000 USD	808	808
Capital Power Corp. 3,15 % 01-10-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000	210	202
Capital Power Corp., taux variable 09-09-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 330 000	3 330	3 319
Carnival Corp. 9,88 % 01-08-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	175 000 USD	243	239
Carriage Purchaser Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 23-09-2028	États-Unis	Prêts à terme	44 550 USD	56	57
Carriage Purchaser Inc. 7,88 % 15-10-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 200 000 USD	1 292	1 266
Cascades inc. 5,13 % 15-01-2025, rachetables 2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	360 000	356	348
Cascades inc. 5,13 % 15-01-2026, rachetables 2023 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 722 000 USD	3 332	3 451
CCL Industries Inc. 3,86 % 13-04-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000	243	234
CCO Holdings LLC 5,38 % 01-06-2029, rachetables 2024 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 200 000 USD	2 677	2 669
CCO Holdings LLC 6,38 % 01-09-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 890 000 USD	3 718	3 671
CCO Holdings LLC 4,75 % 01-03-2030, rachetables 2024 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	700 000 USD	829	785
Genovus Energy Inc. 3,75 % 15-02-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 959 000 USD	4 082	3 714
Centene Corp. 4,63 % 15-12-2029, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 100 000 USD	1 392	1 366
Centene Corp. 3,38 % 15-02-2030, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 030 000 USD	2 349	2 297

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Centennial Resource Production LLC 5,38 % 15-01-2026, rachetables 2021 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	596 000 USD	736	753
CenturyLink Inc. 4,00 % 15-02-2027, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	450 000 USD	526	526
Charter Communications Operating LLC 4,50 % 01-02-2024, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	950 000 USD	1 228	1 299
Charter Communications Operating LLC 5,05 % 30-03-2029, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 750 000 USD	2 207	2 233
Chevron Corp. 2,24 % 11-05-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 255 000 USD	2 611	2 597
Chevron U.S.A. Inc. 2,34 % 12-08-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 418 000 USD	3 179	2 902
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 3,53 % 11-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000	96	90
Clearway Energy Group LLC 3,75 % 15-02-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 150 000 USD	1 291	1 265
Clearway Energy LLC 3,75 % 15-01-2032 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	660 000 USD	736	709
Clydesdale Acquisition Holdings Inc. 8,75 % 15-04-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	858 000 USD	990	985
Cogent Communications Group Inc. 3,50 % 01-05-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	450 000 USD	545	554
Cogent Communications Group Inc. 7,00 % 15-06-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	5 121 000 USD	6 424	6 714
Cologix Data Centers Issuer LLC 4,94 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	570 000	570	528
Cologix Data Centers Issuer LLC 5,68 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	450 000	450	418
Columbia Care Inc. 9,50 % 03-02-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	400 000 USD	504	551
CommScope Inc. 4,75 % 01-09-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 350 000 USD	1 510	1 527
CommScope Technologies Finance LLC 8,25 % 01-03-2027, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	630 000 USD	710	722
Condor Merger Sub Inc. 7,38 % 15-02-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 640 000 USD	4 133	4 094
Connect Finco SARL 6,75 % 01-10-2026	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	1 650 000 USD	2 026	1 996
ConnectWise LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 24-09-2028	États-Unis	Prêts à terme	74 438 USD	92	96
CONSOL Energy Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 28-09-2024	États-Unis	Prêts à terme	25 887 USD	32	35
Continental Resources Inc. 5,75 % 15-01-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	600 000 USD	791	754
Corus Entertainment Inc. 5,00 % 11-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 250 000	1 149	1 019
Costco Wholesale Corp. 1,38 % 20-06-2027, rachetables 2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	500 000 USD	577	596
Covert Mergerco Inc. 4,88 % 01-12-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	665 000 USD	753	744
Covis Finco SARL, prêt à terme B de premier rang, taux variable 14-02-2027	Luxembourg	Prêts à terme	266 625 USD	305	294
CPPIB Capital Inc. 1,95 % 30-09-2029	Canada	Gouvernement fédéral	850 000	775	750
Cros Inc. 4,13 % 15-08-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	600 000 USD	609	640
Crown Americas LLC 5,25 % 01-04-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 580 000 USD	2 013	1 971
CrownRock LP/CrownRock Finance Inc. 5,63 % 15-10-2025, rachetables 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	900 000 USD	1 151	1 196
CSC Holdings LLC 5,75 % 15-01-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 400 000 USD	1 456	1 401
CTC Holdings LP, prêt à terme B de premier rang, taux variable 15-02-2029	États-Unis	Prêts à terme	109 450 USD	137	145
Curaleaf Holdings Inc. 8,00 % 15-12-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	880 000 USD	1 128	1 086
Dana Inc. 4,25 % 01-09-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	99 000 USD	113	102
Dana Inc. 4,50 % 15-02-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	4 050 000 USD	4 458	4 063
Darling Ingredients Inc. 6,00 % 15-06-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	550 000 USD	696	726
DaVita Inc. 3,75 % 15-02-2031, rachetables 2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 500 000 USD	1 549	1 480
République fédérale d'Allemagne, obligations indexées sur l'inflation, 0,10 % 15-04-2046	Allemagne	Gouvernements étrangers	2 950 000 EUR	6 275	4 956
Devon Energy Corp. 4,50 % 15-01-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 000 000 USD	1 250	1 265
Diamondback Energy Inc. 3,50 % 01-12-2029, rachetables 2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 750 000 USD	2 099	2 089
Digi International Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-11-2028	États-Unis	Prêts à terme	188 964 USD	235	255
Dispatch Terra Acquisition LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 25-03-2028	États-Unis	Prêts à terme	380 000 USD	470	433
Domtar Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-10-2028	États-Unis	Prêts à terme	460 627 USD	572	609
Domtar Corp. 6,75 % 01-10-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 416 000 USD	3 020	2 574
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,54 % 07-12-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	52 000	52	46
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,06 % 17-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000	91	86
DS Parent Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 10-12-2028	États-Unis	Prêts à terme	130 000 USD	159	173
Fiducie cartes de crédit Eagle 4,78 % 17-07-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	182 000	182	180

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
East West Manufacturing LLC, prêt à terme à prélèvement différé de premier rang, taux variable 05-01-2029	États-Unis	Prêts à terme	27 937 USD	35	37
East West Manufacturing LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 05-01-2029	États-Unis	Prêts à terme	191 103 USD	241	251
Easy Tactic Ltd. 6,50 % 11-07-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	167 634 USD	56	47
Easy Tactic Ltd. 6,50 % 11-07-2027	Chine	Sociétés – Non convertibles	795 684 USD	224	165
Ecopetrol SA 6,88 % 29-04-2030, rachetables 2030	Colombie	Sociétés – Non convertibles	500 000 USD	629	584
Electronic Arts Inc. 2,95 % 15-02-2051	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 970 000 USD	3 782	3 642
Embecta Corp. 5,00 % 15-02-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 366 000 USD	1 592	1 624
Empresas CMPC SA 3,00 % 06-04-2031	Chili	Sociétés – Non convertibles	950 000 USD	1 027	979
Enbridge Gas Inc. 2,37 % 09-08-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000	93	87
Enbridge Gas Inc. 3,20 % 15-09-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000	29	22
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 500 000	10 070	9 637
Enbridge Inc., taux variable 12-04-2078, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 000 000	2 012	1 941
Énergir S.E.C. 4,67 % 27-09-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	209 000	209	207
Ensign Drilling Inc. 9,25 % 15-04-2024 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 900 000 USD	2 367	2 323
EPCOR Utilities Inc. 3,55 % 27-11-2047, rachetables 2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000	95	81
EPCOR Utilities Inc. 3,11 % 08-07-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 250 000	981	923
EPCOR Utilities Inc. 4,73 % 02-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	289 000	289	283
Evergreen AcqCo 1 LP, prêt à terme de premier rang, taux variable 26-03-2028	États-Unis	Prêts à terme	148 500 USD	188	198
Exxon Mobil Corp. 2,61 % 15-10-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	250 000 USD	297	295
Exxon Mobil Corp. 3,10 % 16-08-2049	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	4 418 000 USD	4 577	4 282
Fair Isaac Corp. 4,00 % 15-06-2028, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 380 000 USD	4 032	4 016
Fairfax Financial Holdings Ltd. 8,30 % 15-04-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000 USD	365	372
Fairfax Financial Holdings Ltd. 3,95 % 03-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 000 000	1 799	1 722
Fédération des caisses Desjardins du Québec 4,41 % 19-05-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	143 000	143	139
Fédération des caisses Desjardins, taux variable 23-08-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	610 000	610	593
Foley Products Co. LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 11-02-2029	États-Unis	Prêts à terme	199 500 USD	251	263
Foot Locker Inc. 4,00 % 01-10-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	400 000 USD	418	432
Compagnie Crédit Ford du Canada 2,96 % 16-09-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	750 000	675	643
Ford Motor Co. 3,25 % 12-02-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	4 752 000 USD	4 990	4 738
Fortified Trust 2,34 % 23-01-2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 250 000	1 246	1 242
Fortified Trust 3,76 % 23-06-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	123 000	123	119
Fortified Trust 1,96 % 23-10-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	407 000	388	362
Fortis Inc. 4,43 % 31-05-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	144 000	144	140
FXI Holdings Inc. 7,88 % 01-11-2024, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	450 000 USD	566	492
Corporation de Sécurité Garda World, prêt à terme B de premier rang, taux variable 10-02-2029	Canada	Prêts à terme	220 000 USD	278	284
Corporation de Sécurité Garda World 6,00 % 01-06-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 850 000 USD	3 024	2 907
Gartner Inc. 3,63 % 15-06-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 942 000 USD	3 453	3 413
General Motors Co. 6,80 % 01-10-2027, rachetables 2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 000 000 USD	1 380	1 409
GFL Environmental Inc. 3,75 % 01-08-2025, rachetables 2022 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	123	128
GFL Environmental Inc. 5,13 % 15-12-2026, rachetables 2022 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 200 000 USD	1 519	1 550
GFL Environmental Inc. 3,50 % 01-09-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	850 000 USD	973	990
Gibson Energy Inc. 2,85 % 14-07-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 200 000	2 020	1 975
Gibson Energy Inc., taux variable 22-12-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 500 000	2 260	2 156
GoDaddy Operating Co. LLC 3,50 % 01-03-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 170 000 USD	2 509	2 456
GOL Linhas aéreas inteligentes SA 8,00 % 30-06-2026 144A	Brésil	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	255	170
The Goldman Sachs Group Inc. 3,31 %, taux variable 31-10-2025, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	200 000	197	192
The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 30-11-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	157 000	157	141
The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 28-02-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 500 000	1 305	1 268
Gouvernement de l'Australie 1,75 % 21-06-2051	Australie	Gouvernements étrangers	5 700 000 AUD	3 079	3 079
Gouvernement des Bahamas 6,00 % 21-11-2028, rachetables 2028	Bahamas	Gouvernements étrangers	200 000 USD	192	168
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2029	Brésil	Gouvernements étrangers	1 950 000 BRL	4 661	4 608
Gouvernement du Canada 0,75 % 01-10-2024	Canada	Gouvernement fédéral	144 000	141	136
Gouvernement du Canada 2,25 % 01-12-2029	Canada	Gouvernement fédéral	480 000	478	452
Gouvernement du Canada 1,50 % 01-06-2031	Canada	Gouvernement fédéral	22 370 000	20 627	19 502
Gouvernement du Canada 1,50 % 01-12-2031	Canada	Gouvernement fédéral	183 000	160	159
Gouvernement du Canada 0,50 % 01-12-2050, rendement réel	Canada	Gouvernement fédéral	5 662 000	6 575	5 262

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Gouvernement du Canada 1,75 % 01-12-2053	Canada	Gouvernement fédéral	39 706 000	31 475	29 150
Gouvernement de l'Allemagne 0 % 15-08-2052	Allemagne	Gouvernements étrangers	5 680 000 EUR	5 578	4 153
Gouvernement du Mexique 5,75 % 05-03-2026	Mexique	Gouvernements étrangers	117 500 000 MXN	6 809	7 088
Gouvernement du Mexique 7,75 % 29-05-2031	Mexique	Gouvernements étrangers	32 000 000 MXN	1 947	1 954
Gray Television Inc. 5,38 % 15-11-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	4 188 000 USD	4 933	4 544
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 3,15 % 05-10-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	85 000	69	64
Guala Closures SPA 3,25 % 15-06-2028	Italie	Sociétés – Non convertibles	600 000 EUR	713	647
Gulfport Energy Corp. 8,00 % 17-05-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	250 000 USD	328	345
Fonds de placement immobilier H&R 4,07 % 16-06-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000	201	192
Fonds de placement immobilier H&R 2,63 % 19-02-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 700 000	1 549	1 508
Hadrian Merger Sub Inc. 8,50 % 01-05-2026, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 000 000 USD	1 239	1 276
HCA Healthcare Inc. 3,50 % 01-09-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 967 000 USD	4 599	4 562
Heathrow Funding Ltd. 3,79 % 04-09-2030, rachetables 2030	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	950 000	888	844
Heathrow Funding Ltd. 3,73 % 13-04-2033	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	53 000	55	44
The Hertz Corp. 4,63 % 01-12-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 610 000 USD	1 917	1 821
Compagnie Home Trust 5,32 % 13-06-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	119 000	119	118
Honda Canada Finance Inc. 1,65 % 25-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	600 000	523	507
Horizon Therapeutics PLC 5,50 % 01-08-2027, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	500 000 USD	635	649
Hunter Douglas Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 09-02-2029	Pays-Bas	Prêts à terme	520 000 USD	656	595
IAMGOLD Corp. 5,75 % 15-10-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	226	132
INEOS Quattro Finance PLC 2,50 % 15-01-2026	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	100 000 EUR	131	112
INEOS Quattro Finance PLC 3,75 % 15-07-2026	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	638 000 EUR	733	669
Innovative Industrial Properties Inc. 5,50 % 25-05-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 150 000 USD	1 409	1 412
Intact Corporation financière 5,46 % 22-09-2032 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	198 000 USD	262	267
Intact Corporation financière, taux variable 31-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	500 000	451	439
Inter Pipeline Ltd. 3,48 % 16-12-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	140 000	130	129
Inter Pipeline Ltd. 5,85 % 18-05-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	128 000	128	126
Inter Pipeline Ltd., taux variable 26-03-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 200 000	4 116	3 979
Inter Pipeline Ltd., taux variable 19-11-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 400 000	1 339	1 296
Banque internationale pour la reconstruction et le développement 0 % 31-03-2027	Supranationales	s.o.	100 000 USD	120	124
International Game Technology PLC 2,38 % 15-04-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	466 000 EUR	624	501
Iris Escrow Issuer Corp. 10,00 % 15-12-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 540 000 USD	1 628	1 773
Iris Merger Sub 2019 Inc. 9,38 % 15-02-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	600 000 USD	791	799
Iron Mountain Inc. 5,00 % 15-07-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	250 000 USD	306	299
Iron Mountain Inc. 5,25 % 15-07-2030, rachetables 2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 750 000 USD	2 128	2 020
Jazz Pharmaceuticals PLC 4,38 % 15-01-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 950 000 USD	2 366	2 330
Kaisa Group Holdings Ltd. 8,50 % 30-06-2022	Chine	Sociétés – Non convertibles	400 000 USD	159	59
Kaisa Group Holdings Ltd. 8,65 % 22-07-2022	Chine	Sociétés – Non convertibles	300 000 USD	136	44
Kaisa Group Holdings Ltd. 10,50 % 07-09-2022	Chine	Sociétés – Non convertibles	850 000 USD	575	126
Keyera Corp., taux variable 13-06-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 656 000	4 625	4 472
Keyera Corp., taux variable 10-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 138 000	1 940	1 873
Knight Health Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 17-12-2028	États-Unis	Prêts à terme	328 350 USD	392	333
Produits Kruger S.E.C. 6,00 % 24-04-2025, rachetables 2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	507 000	504	478
Produits Kruger S.E.C. 5,38 % 09-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 132 000	1 985	1 791
LABL Escrow Issuer LLC 10,50 % 15-07-2027, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	880 000 USD	1 079	1 045
LABL Inc. 8,25 % 01-11-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 298 000 USD	1 433	1 313
Lamar Media Corp. 4,00 % 15-02-2030, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	650 000 USD	757	753
Lamb Weston Holdings Inc. 4,38 % 31-01-2032 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 519 000 USD	1 747	1 745
Banque Laurentienne du Canada, taux variable 15-06-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000	237	214
Level 3 Financing Inc. 3,75 % 15-07-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	218	203
Lions Gate Entertainment Inc. 5,50 % 15-04-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	850 000 USD	947	881
Live Nation Entertainment Inc. 3,75 % 15-01-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 000 000 USD	2 323	2 360
Les Compagnies Loblaw Itée 4,49 % 11-12-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 000 000	1 012	978
Les Compagnies Loblaw Itée 2,28 % 07-05-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	600 000	515	498
Les Compagnies Loblaw Itée 5,01 % 13-09-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	256 000	256	253
Les Compagnies Loblaw Itée 5,34 % 13-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	189 000	189	188
Logan Group Co. Ltd. 4,70 % 06-07-2026	Chine	Sociétés – Non convertibles	5 226 000 USD	2 299	1 207
Lower Mattagami Energy LP 2,43 % 14-05-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000	92	85

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
LRS Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 13-08-2028	États-Unis	Prêts à terme	101 235 USD	125	133
Luxembourg Investment Co. 428 SARL, prêt à terme B de premier rang, taux variable 22-10-2028	Luxembourg	Prêts à terme	260 000 USD	315	300
Manchester Acquisition Sub LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 16-11-2026	États-Unis	Prêts à terme	287 825 USD	342	346
Société Financière Manuvie, taux variable 09-05-2028, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	850 000	848	840
Société Financière Manuvie 3,38 % 19-06-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	7 200 000	6 113	5 800
Société Financière Manuvie, taux variable 19-03-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	935 000	818	755
Société Financière Manuvie, taux variable 19-06-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 119 000	1 114	1 115
MARB BondCo PLC 3,95 % 29-01-2031	Brésil	Sociétés – Non convertibles	270 000 USD	278	270
Mattamy Group Corp. 4,63 % 01-03-2030, rachetables 2025 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	600 000 USD	640	635
Mattel Inc. 3,38 % 01-04-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 220 000 USD	1 501	1 519
Mav Acquisition Corp. 5,75 % 01-08-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 400 000 USD	2 773	2 785
McDonald's Corp. 3,13 % 04-03-2025, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	650 000	643	627
MEDNAX Inc. 5,38 % 15-02-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	476 000 USD	531	550
MEG Energy Corp. 5,88 % 01-02-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 800 000 USD	3 525	3 482
Mercer International Inc., taux variable 01-02-2029	Allemagne	Sociétés – Non convertibles	600 000 USD	708	666
Merck & Co. Inc. 5,13 % 30-04-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	497 000 USD	576	566
MeridianLink Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 28-10-2028	États-Unis	Prêts à terme	89 550 USD	110	119
Mexico Remittances Funding Fiduciary Estate Management SARL 4,88 % 15-01-2028	Mexique	Sociétés – Non convertibles	500 000 USD	531	576
Microsoft Corp. 3,45 % 08-08-2036	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 305 000 USD	2 877	2 791
Microsoft Corp. 2,53 % 01-06-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 331 000 USD	10 141	9 330
Microsoft Corp. 2,68 % 01-06-2060	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	34 000 USD	33	29
MicroStrategy Inc. 6,13 % 15-06-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 570 000 USD	2 955	2 936
Minerva Merger Sub Inc. 6,50 % 15-02-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	5 830 000 USD	6 943	6 385
Minerva SA 4,38 % 18-03-2031	Brésil	Sociétés – Non convertibles	180 000 USD	194	189
Molina Healthcare Inc. 3,88 % 15-05-2032 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	500 000 USD	582	569
Morgan Stanley 3,00 % 07-02-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 750 000	1 723	1 701
Mozart Debt Merger Sub Inc. 3,88 % 01-04-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 747 000 USD	3 172	3 053
Mozart Debt Merger Sub Inc. 5,25 % 01-10-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 573 000 USD	3 001	2 694
MSCI Inc. 3,25 % 15-08-2033 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 718 000 USD	2 996	2 899
Murphy Oil USA Inc. 3,75 % 15-02-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 070 000 USD	1 224	1 193
Nabors Industries Ltd. 7,25 % 15-01-2026, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 400 000 USD	1 726	1 692
Banque Nationale du Canada 2,58 % 03-02-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	500 000	483	473
Banque Nationale du Canada, taux variable 16-08-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	601 000	601	595
Banque Nationale du Canada, taux variable 15-08-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 200 000	1 064	979
Natural Resource Partners LP 9,13 % 30-06-2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	300 000 USD	383	424
Nestlé Holdings Inc. 2,19 % 26-01-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	82 000	82	71
New Red Finance Inc. 4,00 % 15-10-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 100 000 USD	2 333	2 289
NextEra Energy Capital Holdings Inc. 2,25 % 01-06-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	114	111
Nine Energy Service Inc. 8,75 % 01-11-2023, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	167	214
Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc. 4,11 % 31-03-2042	Canada	Sociétés – Non convertibles	99 865	97	86
NuVista Energy Ltd. 7,88 % 23-07-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 500 000	1 546	1 500
NVIDIA Corp. 3,50 % 01-04-2050, rachetables 2049	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 459 000 USD	2 779	2 494
OMERS Finance Trust 1,55 % 21-04-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 500 000	2 284	2 253
Ontario Power Generation Inc. 3,32 % 04-10-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000	195	189
Open Text Corp. 3,88 % 01-12-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 466 000 USD	1 707	1 565
Open Text Holdings Inc. 4,13 % 01-12-2031 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	103 000 USD	120	108
Owens & Minor Inc. 6,63 % 01-04-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	370 000 USD	468	450
Panther BF Aggregator 2 LP 8,50 % 15-05-2027, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	649 000 USD	823	857
Corporation Parkland du Canada 3,88 % 16-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 300 000	3 047	2 987
Corporation Parkland du Canada 4,50 % 01-10-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 600 000 USD	2 984	2 924
Corporation Parkland 4,38 % 26-03-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 146 000	1 872	1 818
Corporation Pétroles Parkland 6,00 % 23-06-2028, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 534 000	3 443	3 340
Pembina Pipeline Corp. 4,54 % 03-04-2049, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	16
Pembina Pipeline Corp., taux variable 25-01-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 200 000	3 649	3 469

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Perrigo Co. PLC 3,15 % 15-06-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	476 000 USD	541	545
Petrobras Global Finance BV 5,60 % 03-01-2031, rachetables 2030	Brésil	Sociétés – Non convertibles	500 000 USD	625	627
Petróleos Mexicanos 6,70 % 16-02-2032 144A	Mexique	Sociétés – Non convertibles	250 000 USD	298	244
Petróleos Mexicanos 6,70 % 16-02-2032	Mexique	Sociétés – Non convertibles	2 319 000 USD	2 626	2 261
Pioneer Natural Resources Co. 2,15 % 15-01-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 459 000 USD	2 676	2 629
Prime Structured Mortgage Trust 1,86 % 15-11-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	279 000	271	261
Province de l'Alberta 3,10 % 01-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	2 820 000	2 586	2 353
Province de l'Alberta 2,95 % 01-06-2052	Canada	Gouvernements provinciaux	190 000	152	154
Province de la Colombie-Britannique 2,95 % 18-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	900 000	791	730
Province du Manitoba 2,05 % 05-09-2052	Canada	Gouvernements provinciaux	190 000	118	121
Province du Manitoba 3,80 % 05-09-2053	Canada	Gouvernements provinciaux	1 900 000	1 775	1 775
Province de l'Ontario 3,75 % 02-12-2053	Canada	Gouvernements provinciaux	26 000	24	25
Province de Québec 3,65 % 20-05-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	985 000	996	968
Province de la Saskatchewan 3,10 % 02-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	250 000	221	207
Province de la Saskatchewan 2,80 % 02-12-2052	Canada	Gouvernements provinciaux	1 750 000	1 459	1 355
Quasar Intermediate Holdings Ltd., prêt à terme B de premier rang, taux variable 20-01-2029	États-Unis	Prêts à terme	260 000 USD	322	268
Rackspace Technology Global Inc. 3,50 % 15-02-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 854 000 USD	2 053	1 696
Range Resources Corp. 4,75 % 15-02-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	124	120
Reliance LP 2,67 % 01-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	500 000	448	429
Fonds de placement immobilier RioCan 2,83 % 08-11-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	517 000	455	442
Rogers Communications Inc. 3,75 % 15-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	946 000	908	874
Rogers Communications Inc. 5,25 % 15-04-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	37 000	37	34
Rogers Communications Inc., taux variable 17-12-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 678 000	2 570	2 414
Rogers Communications Inc., taux variable 15-03-2082 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 750 000 USD	5 711	5 761
Banque Royale du Canada 4,61 % 26-07-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	746 000	743	734
Banque Royale du Canada 1,83 % 31-07-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 200 000	1 044	1 010
Banque Royale du Canada, taux variable 03-11-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	133 000	133	116
Banque Royale du Canada, taux variable 24-11-2080, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 350 000	1 300	1 253
Banque Royale du Canada, taux variable 24-02-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000	238	225
Banque Royale du Canada, taux variable 24-11-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	7 224 000	6 111	5 759
Métaux Russel Inc. 6,00 % 16-03-2026, rachetables 2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000	102	98
Sable International Finance Ltd. 5,75 % 07-09-2027, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	242	242
Scientific Games Holdings LP, prêt à terme B de premier rang, taux variable 04-02-2029	États-Unis	Prêts à terme	150 000 USD	191	193
Scripps Escrow Inc. 5,88 % 15-07-2027, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	250 000 USD	301	301
Sealed Air Corp. 5,00 % 15-04-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 110 000 USD	2 656	2 620
Seaspan Corp. 5,50 % 01-08-2029 144A	Hong Kong	Sociétés – Non convertibles	650 000 USD	749	699
Secure Acquisition Inc., prêt à terme à prélèvement différé de premier rang, taux variable 15-12-2028	États-Unis	Prêts à terme	28 448 USD	36	39
Secure Acquisition Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 15-12-2028	États-Unis	Prêts à terme	190 594 USD	242	248
Secure Acquisition Inc., prêt à terme de second rang, taux variable 15-12-2029	États-Unis	Prêts à terme	100 000 USD	125	133
Secure Energy Services Inc. 7,25 % 30-12-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 247 000	3 223	3 095
Silgan Holdings Inc. 4,13 % 01-02-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 200 000 USD	1 453	1 476
Sinclair Television Group Inc., prêt à terme B4 de premier rang, taux variable 13-04-2029	États-Unis	Prêts à terme	389 025 USD	474	510
Sinclair Television Group Inc. 5,13 % 15-02-2027, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	228	231
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 5,95 % 04-02-2027	Chine	Sociétés – Non convertibles	405 000 USD	207	151
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 4,75 % 05-08-2029	Chine	Sociétés – Non convertibles	1 450 000 USD	751	499
SmartCentres Real Estate Investment Trust 3,19 % 11-06-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000	188	181
Source energy Services 10,50 % 15-03-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	485 584	318	289
Southwestern Energy Co. 5,38 % 15-03-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 150 000 USD	1 478	1 429
Southwestern Energy Co. 4,75 % 01-02-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 250 000 USD	1 532	1 454
Spa Holdings 3 Oy 4,88 % 04-02-2028 144A	Finlande	Sociétés – Non convertibles	1 200 000 USD	1 352	1 330
Spanish Broadcasting System Inc. 9,75 % 01-03-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	75 000 USD	89	67
Sprint Capital Corp. 6,88 % 15-11-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 650 000 USD	2 356	2 347

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Square Inc. 2,75 % 01-06-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 080 000 USD	2 448	2 481
Summit Industrial Income Real Estate Investment Trust 2,44 % 14-07-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	13 000	11	11
Financière Sun Life inc., taux variable 21-11-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 808 000	1 644	1 569
Financière Sun Life inc., taux variable 10-08-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	329 000	329	318
Financière Sun Life inc., taux variable 30-06-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 600 000	4 725	4 565
Suncor Énergie Inc. 3,10 % 24-05-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000	228	231
Suncor Énergie Inc. 3,75 % 04-03-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	959 000 USD	1 011	935
Suncor Énergie Inc. 3,95 % 04-03-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	550 000	425	418
Supérieur Plus S.E.C. 4,25 % 18-05-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 620 000	3 283	3 147
Supérieur Plus S.E.C. 4,50 % 15-03-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 400 000 USD	1 648	1 598
Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd. 3,63 % 28-04-2026, rachetables 2026 144A	Australie	Sociétés – Non convertibles	250 000 USD	307	319
Tamarack Valley Energy Ltd. 7,25 % 10-05-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 150 000	2 154	2 020
Tamarack Valley Energy Ltd. 7,25 % 10-05-2027 (SEP)	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 640 000	1 542	1 541
TELUS Corp. 3,30 % 02-05-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 170 000	1 078	1 050
TELUS Corp. 3,15 % 19-02-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	300 000	274	262
Tencent Holdings Ltd. 2,39 % 03-06-2030, rachetables 2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	110	109
Tenet Healthcare Corp. 4,88 % 01-01-2026, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	250 000 USD	317	322
Tenet Healthcare Corp. 6,13 % 01-10-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 717 000 USD	3 374	3 332
Tenet Healthcare Corp. 4,25 % 01-06-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 067 000 USD	2 445	2 381
Tenet Healthcare Corp. 4,38 % 15-01-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 620 000 USD	1 936	1 871
Teranet Holdings LP 3,72 % 23-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	419 000	405	380
TerraForm Power Operating LLC 5,00 % 31-01-2028, rachetables 2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 300 000 USD	2 798	2 822
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 6,75 % 01-03-2028, rachetables 2027	Israël	Sociétés – Non convertibles	1 500 000 USD	1 937	1 906
Teva Pharmaceutical Industries Ltd. 2,80 % 21-07-2023	Israël	Sociétés – Non convertibles	500 000 USD	636	669
Thevelia (US) LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 10-02-2029	États-Unis	Prêts à terme	220 000 USD	275	290
Tianqi Finco Co. Ltd. 3,75 % 28-11-2022	Chine	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	229	274
TIBCO Software Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 03-2029	États-Unis	Prêts à terme	1 400 000 USD	1 703	1 741
Timber Servicios Empresariales SA, prêt à terme B de premier rang, taux variable 17-02-2029	Espagne	Prêts à terme	165 000 EUR	232	183
T-Mobile USA Inc. 3,75 % 15-04-2027, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 400 000 USD	3 008	3 067
T-Mobile USA Inc. 2,55 % 15-02-2031, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 000 000 USD	1 111	1 095
T-Mobile USA Inc. 5,20 % 15-01-2033	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	300 000 USD	387	397
Groupe TMX Ltée 3,78 % 05-06-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	500 000	484	475
TopBuild Corp. 4,13 % 15-02-2032 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	700 000 USD	800	747
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-01-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	115 000	115	114
La Banque Toronto-Dominion 1,94 % 13-03-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	750 000	708	699
La Banque Toronto-Dominion 4,34 % 27-01-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	551 000	551	541
La Banque Toronto-Dominion 2,26 % 07-01-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	307 000	292	275
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 22-04-2030, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 666 000	1 617	1 571
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-10-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	6 200 000	5 281	4 963
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-10-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 800 000	1 800	1 795
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-10-2170	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 800 000	1 773	1 630
Tourmaline Oil Corp. 2,53 % 12-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000	44	43
TransCanada PipeLines Ltd. 4,18 % 03-07-2048, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000	30	23
TransCanada PipeLines Ltd. 4,20 % 04-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000	217	203
TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	6 000 000	5 622	5 406
Transurban Finance Co. Pty. Ltd. 4,56 % 14-11-2028, rachetables 2028	Australie	Sociétés – Non convertibles	1 400 000	1 392	1 344
TRC Cos. Inc., prêt à terme de second rang, taux variable 19-11-2029	États-Unis	Prêts à terme	150 000 USD	188	195
Trulieve Cannabis Corp. 8,00 % 06-10-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	300 000 USD	371	380
Uber Technologies Inc. 8,00 % 01-11-2026, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	500 000 USD	656	694
Uber Technologies Inc. 4,50 % 15-08-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	650 000 USD	750	759
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2032	États-Unis	Gouvernements étrangers	7 300 000 USD	9 996	9 319
Obligations du Trésor des États-Unis 1,88 % 15-02-2032	États-Unis	Gouvernements étrangers	3 800 000 USD	4 446	4 450
Obligations du Trésor des États-Unis 2,75 % 15-08-2032	États-Unis	Gouvernements étrangers	871 000 USD	1 085	1 100

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Obligations du Trésor des États-Unis 2,38 % 15-02-2042	États-Unis	Gouvernements étrangers	1 839 000 USD	2 069	1 949
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2051	États-Unis	Gouvernements étrangers	14 420 000 USD	18 766	14 177
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052	États-Unis	Gouvernements étrangers	2 100 000 USD	2 505	1 945
Obligations du Trésor des États-Unis 2,25 % 15-02-2052	États-Unis	Gouvernements étrangers	3 492 000 USD	3 800	3 508
Obligations du Trésor des États-Unis 3,00 % 15-08-2052	États-Unis	Gouvernements étrangers	409 000 USD	490	488
Univision Communications Inc. 6,63 % 01-06-2027, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 200 000 USD	1 535	1 574
Univision Communications Inc. 7,38 % 30-06-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	590 000 USD	743	778
UPC Broadband Finco BV 4,88 % 15-07-2031 144A	Pays-Bas	Sociétés – Non convertibles	1 400 000 USD	1 641	1 499
US Radiology Specialists Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 15-12-2027	États-Unis	Prêts à terme	141 928 USD	179	174
U.S. Renal Care Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 14-06-2026	États-Unis	Prêts à terme	710 000 USD	648	713
US Silica Holdings Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	223 660 USD	281	298
Vector WP Holdco LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 08-10-2028	États-Unis	Prêts à terme	258 700 USD	318	346
Ventas Canada Finance Ltd. 2,45 % 04-01-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	658 000	613	584
Ventas Canada Finance Ltd. 3,30 % 01-12-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	76 000	76	63
Verizon Communications Inc. 2,38 % 22-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	280 000	255	246
Verizon Communications Inc. 2,50 % 16-05-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	603 000	529	504
Verizon Communications Inc. 1,75 % 20-01-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 000 000 USD	2 122	2 074
Vermilion Energy Inc. 6,88 % 01-05-2030 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 825 000 USD	2 269	2 327
Vesta Energy Corp. 10 % 15-10-2025 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	750 000	750	728
Viasat Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 24-02-2029	États-Unis	Prêts à terme	59 850 USD	75	74
Viasat Inc. 6,50 % 15-07-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	700 000 USD	779	654
Vidéotron Itée 3,63 % 15-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 009 000	3 518	3 401
Vidéotron Itée 4,50 % 15-01-2030, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 680 000	1 475	1 436
Vidéotron Itée 3,13 % 15-01-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 760 000	3 711	3 593
Vidéotron Itée 5,63 % 15-06-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 000 000	4 026	3 960
Virgin Media Secured Finance PLC 4,50 % 15-08-2030, rachetables 2025 144A	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	300 000 USD	350	327
Visa Inc. 2,00 % 15-08-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 918 000 USD	3 373	3 134
VistaJet Malta Finance PLC 6,38 % 01-02-2030 144A	Suisse	Sociétés – Non convertibles	860 000 USD	987	962
VMED O2 UK Financing I PLC 4,25 % 31-01-2031	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	2 800 000 USD	3 156	2 932
Walmart Inc. 1,80 % 22-09-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 305 000 USD	3 656	3 642
Waste Management of Canada Corp. 2,60 % 23-09-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	600 000	570	549
Weatherford International Ltd. 8,63 % 30-04-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 300 000 USD	4 025	3 987
Wells Fargo & Co. 2,57 % 01-05-2026, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 200 000	2 100	2 053
Wells Fargo & Co. 2,49 % 18-02-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000	92	89
Welltower Inc. 4,13 % 15-03-2029, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	850 000 USD	1 080	1 067
WeWork Inc. 5,00 % 10-07-2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 554 000 USD	1 599	1 283
WireCo WorldGroup Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 29-10-2028	États-Unis	Prêts à terme	183 139 USD	224	245
Ziggo Bond Co. BV 5,13 % 28-02-2030, rachetables 2025 144A	Pays-Bas	Sociétés – Non convertibles	250 000 USD	278	253
Ziggo BV 4,88 % 15-01-2030, rachetables 2024 144A	Pays-Bas	Sociétés – Non convertibles	2 200 000 USD	2 608	2 413
Total des obligations				718 951	682 707

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
ACTIONS					
AbbVie Inc.	États-Unis	Soins de santé	48 356	8 592	8 971
Mines Agnico Eagle Ltée	Canada	Matériaux	138 424	9 494	8 078
AIA Group Ltd.	Hong Kong	Services financiers	375 202	5 025	4 306
Air Liquide SA	France	Matériaux	34 762	6 995	5 471
Alibaba Group Holding Ltd., CAAE	Chine	Consommation discrétionnaire	20 256	2 905	2 240
Alimentation Couche-Tard inc.	Canada	Consommation de base	147 437	8 027	8 199
Fonds de placement immobilier Allied	Canada	Biens immobiliers	20 971	829	574
Alphabet Inc., cat. A	États-Unis	Services de communication	108 606	16 727	14 360
Altria Group Inc.	États-Unis	Consommation de base	92 311	6 209	5 153
Amadeus IT Group SA	Espagne	Technologie de l'information	77 075	6 170	4 931
Amazon.com Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	74 153	12 868	11 583
American Tower Corp., cat. A	États-Unis	Biens immobiliers	20 405	6 723	6 056
Aon PLC	Irlande	Services financiers	23 175	8 411	8 581
Apple Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	54 641	10 359	10 439
ARC Resources Ltd.	Canada	Énergie	517 765	8 341	8 590
Atlas Copco AB, A	Suède	Produits industriels	237 059	3 895	3 035
Banque de Montréal	Canada	Services financiers	190 346	25 529	23 045
La Banque de Nouvelle-Écosse	Canada	Services financiers	190 447	15 897	12 512
Société aurifère Barrick	Canada	Matériaux	318 921	8 181	6 828
Becton, Dickinson and Co.	États-Unis	Soins de santé	36 292	11 865	11 179
The Blackstone Group Inc., cat. A	États-Unis	Services financiers	47 733	7 465	5 523
Boralex inc., cat. A	Canada	Services publics	49 428	1 978	2 168
Broadcom Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	16 486	11 643	10 119
Brookfield Asset Management Inc., cat. A (\$ CA)	Canada	Services financiers	263 944	17 159	14 915
Brookfield Asset Management Reinsurance Partners Ltd.	Canada	Services financiers	451	32	25
Brookfield Infrastructure Partners L.P.	Canada	Services publics	102 458	5 251	5 077
Brookfield Renewable Energy Partners L.P.	Canada	Services publics	54 800	2 610	2 365
Brookfield Renewable Partners L.P.	États-Unis	Services publics	4 950	217	223
CAE Inc.	Canada	Produits industriels	355 097	11 570	7 525
Calfrac Well Services Ltd.	Canada	Énergie	6 770	23	36
Fonds de placement immobilier d'immeubles résidentiels canadien	Canada	Biens immobiliers	20 577	881	866
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	Canada	Produits industriels	117 443	17 490	17 520
Canadian Natural Resources Ltd.	Canada	Énergie	191 566	13 224	12 318
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée	Canada	Produits industriels	231 546	20 987	21 351
Cargojet Inc.	Canada	Produits industriels	25 185	3 983	2 811
CCL Industries Inc., cat. B, sans droit de vote	Canada	Matériaux	223 140	13 738	14 941
Groupe CGI inc.	Canada	Technologie de l'information	133 362	14 218	13 868
The Charles Schwab Corp.	États-Unis	Services financiers	56 344	5 017	5 598
Chevron Corp.	États-Unis	Énergie	65 596	12 986	13 027
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix	Canada	Biens immobiliers	193 398	2 905	2 435
CME Group Inc.	États-Unis	Services financiers	29 844	7 658	7 307
Cogeco Communications inc.	Canada	Services de communication	77 700	8 153	5 603
Corteva Inc.	États-Unis	Matériaux	122 806	8 883	9 702
DBS Group Holdings Ltd.	Singapour	Services financiers	152 100	4 310	4 861
Deutsche Börse AG	Allemagne	Services financiers	44 436	9 690	10 112
Diageo PLC	Royaume-Uni	Consommation de base	97 432	5 828	5 642
Dollarama inc.	Canada	Consommation discrétionnaire	32 313	2 137	2 562
Domino's Pizza Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	5 855	2 731	2 511
Emera Inc.	Canada	Services publics	46 580	2 870	2 603
Emerson Electric Co.	États-Unis	Produits industriels	62 096	7 213	6 285
Enbridge Inc.	Canada	Énergie	276 525	15 567	14 164
Equifax Inc.	États-Unis	Produits industriels	12 422	3 526	2 944
Eurofins Scientific	France	Soins de santé	40 804	5 797	3 344
Finning International Inc.	Canada	Produits industriels	99 100	3 245	2 406
Fonds de placement immobilier First Capital	Canada	Biens immobiliers	141 329	2 344	2 137
Fortis Inc.	Canada	Services publics	45 148	2 787	2 369
HDFC Bank Ltd., CAAE	Inde	Services financiers	49 621	3 632	4 007
Heineken Holding NV, A	Pays-Bas	Consommation de base	47 153	4 841	4 450
Honeywell International Inc.	États-Unis	Produits industriels	33 904	8 652	7 825
Hoya Corp.	Japon	Soins de santé	27 500	3 660	3 654
Intact Corporation financière	Canada	Services financiers	99 645	17 847	19 480
Japan Exchange Group Inc.	Japon	Services financiers	219 210	5 270	4 095

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
ACTIONS (suite)					
Johnson & Johnson	États-Unis	Soins de santé	50 434	11 252	11 389
JPMorgan Chase & Co.	États-Unis	Services financiers	82 566	14 449	11 927
Keyence Corp.	Japon	Technologie de l'information	9 308	5 567	4 270
Koninklijke Philips NV	Pays-Bas	Soins de santé	103 145	4 002	2 202
Kweichow Moutai Co. Ltd., cat. A	Chine	Consommation de base	10 910	3 686	3 953
Lam Research Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	7 249	4 823	3 668
Linde PLC	Irlande	Matériaux	12 077	4 921	4 501
Les Compagnies Loblaw Ltée	Canada	Consommation de base	27 581	2 951	3 017
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	France	Consommation discrétionnaire	5 080	4 368	4 127
Magna International Inc.	Canada	Consommation discrétionnaire	93 269	7 761	6 112
Société Financière Manuvie	Canada	Services financiers	693 654	16 570	15 038
McDonald's Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	17 275	5 431	5 510
Medtronic PLC	États-Unis	Soins de santé	51 288	6 961	5 725
Meta Platforms Inc.	États-Unis	Services de communication	18 247	5 518	3 422
Microsoft Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	59 950	21 473	19 301
Moody's Corp.	États-Unis	Services financiers	9 170	3 828	3 082
Motorola Solutions Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	25 101	7 212	7 771
Nestlé SA, nom.	Suisse	Consommation de base	68 638	10 727	10 265
Nike Inc., cat. B	États-Unis	Consommation discrétionnaire	24 443	3 985	2 809
Northland Power Inc.	Canada	Services publics	120 278	4 732	4 865
Novo Nordisk AS, B	Danemark	Soins de santé	62 197	8 448	8 568
Nutrien Ltd.	Canada	Matériaux	118 336	12 819	13 632
Open Text Corp.	Canada	Technologie de l'information	335 218	18 332	12 239
Pembina Pipeline Corp.	Canada	Énergie	179 199	8 664	7 519
PepsiCo Inc.	États-Unis	Consommation de base	29 025	6 113	6 550
¹ Pernod Ricard SA	France	Consommation de base	15 731	4 051	3 974
Philip Morris International Inc.	États-Unis	Consommation de base	92 890	12 379	10 659
¹ Power Corporation du Canada, à droit de vote subalterne	Canada	Services financiers	182 344	7 048	5 676
Restaurant Brands International Inc.	Canada	Consommation discrétionnaire	116 333	8 209	8 548
Roche Holding AG Genussscheine	Suisse	Soins de santé	23 427	10 563	10 551
Rogers Communications Inc., cat. B, sans droit de vote	Canada	Services de communication	31 762	2 019	1 690
Banque Royale du Canada	Canada	Services financiers	358 514	46 755	44 588
S&P Global Inc.	États-Unis	Services financiers	16 370	7 852	6 910
Safran SA	France	Produits industriels	41 238	5 902	5 183
SAP AG	Allemagne	Technologie de l'information	48 089	6 927	5 479
Schlumberger Ltd.	États-Unis	Énergie	223 760	11 830	11 104
Shell PLC (actions en livres sterling)	Pays-Bas	Énergie	138 514	5 104	4 761
The Sherwin-Williams Co.	États-Unis	Matériaux	13 148	4 687	3 721
Shiseido Co. Ltd.	Japon	Consommation de base	45 465	2 902	2 199
Sika AG	Suisse	Matériaux	9 385	3 667	2 596
Sony Corp.	Japon	Consommation discrétionnaire	82 889	10 193	7 372
Source Energy Services Ltd.	Canada	Énergie	37 838	55	45
Starbucks Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	53 767	5 922	6 263
Financière Sun Life inc.	Canada	Services financiers	378 793	24 275	20 807
Suncor Énergie Inc.	Canada	Énergie	362 807	15 288	14 113
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	Taiwan	Technologie de l'information	428 570	10 231	7 768
Corporation TC Énergie	Canada	Énergie	269 831	18 637	15 013
Ressources Teck Ltée, cat. B	Canada	Matériaux	58 041	2 650	2 438
TELUS Corp.	Canada	Services de communication	464 550	13 882	12 743
TELUS International (Cda) Inc.	Canada	Technologie de l'information	157 542	5 627	5 697
Tencent Holdings Ltd.	Chine	Services de communication	88 207	5 438	4 118
Texas Instruments Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	30 529	7 114	6 532
Thomson Reuters Corp.	Canada	Produits industriels	43 788	5 563	6 209
The TJX Companies Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	65 736	5 466	5 645
La Banque Toronto-Dominion	Canada	Services financiers	319 972	28 944	27 108
U.S. Bancorp	États-Unis	Services financiers	121 864	8 315	6 792
Union Pacific Corp.	États-Unis	Produits industriels	25 105	7 167	6 761
UnitedHealth Group Inc.	États-Unis	Soins de santé	5 407	3 754	3 775
Visa Inc., cat. A	États-Unis	Technologie de l'information	34 731	9 512	8 529
The Walt Disney Co.	États-Unis	Services de communication	19 944	3 262	2 601

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
ACTIONS (suite)					
The Williams Companies Inc.	États-Unis	Énergie	89 704	3 699	3 550
Wolters Kluwer NV	Pays-Bas	Produits industriels	59 737	7 853	8 039
Total des actions				1 030 395	935 924
OPTIONS					
Options achetées (se reporter au tableau des options achetées)				83	121
Total des options				83	121
FONDS/BILLETS NÉGOCIÉS EN BOURSE					
iShares S&P/TSX 60 Index ETF	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	75 900	2 200	2 146
iShares S&P/TSX Global Gold Index ETF	États-Unis	Fonds/billets négociés en bourse	276 242	5 128	4 215
² FINB Obligations toutes sociétés canadiennes Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	260 900	23 844	23 344
² FINB Obligations de marchés émergents Mackenzie (couvert en \$ CA)	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	75 976	6 496	5 435
² FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	149 935	12 021	10 986
² FNB de revenu à taux variable Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	2 158 000	39 441	37 808
² FNB de revenu fixe à rendement élevé mondial Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	2 420 060	48 069	40 161
² FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	298 226	26 660	25 023
Total des fonds/billets négociés en bourse				163 859	149 118
FONDS COMMUNS DE PLACEMENT					
³ SEC Mackenzie CL Revenu stratégique (Revenu fixe), série R	Canada	Fonds communs de placement	10 834 394	115 283	98 060
⁴ Fonds à rendement absolu de titres de créance Mackenzie, série CL	Canada	Fonds communs de placement	1 969 703	18 044	16 259
⁴ Fonds d'obligations tactique mondial Mackenzie, série CL	Canada	Fonds communs de placement	1 336 993	11 522	10 528
⁴ Fonds international de dividendes Mackenzie, série CL	Canada	Fonds communs de placement	94 986	1 548	1 105
⁴ Fonds d'obligations de sociétés nord-américaines Mackenzie, série CL	Canada	Fonds communs de placement	548 420	5 417	4 875
Total des fonds communs de placement				151 814	130 827
Coûts de transaction				(328)	–
Total des placements				2 064 774	1 898 697
Instruments dérivés					(18 892)
(se reporter au tableau des instruments dérivés)					(46)
Obligation pour options vendues (se reporter au tableau des options vendues)					49 025
Trésorerie et équivalents de trésorerie					4 308
Autres éléments d'actif moins le passif					1 933 092

¹ L'émetteur de ce titre est lié à GPCV. Voir note 1.

² Ce fonds négocié en bourse est géré par une société affiliée à GPCV.

³ Ce fonds est géré par GPCV.

⁴ Ce fonds est géré par une société affiliée à GPCV.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

TABLEAU DES PLACEMENTS – SEC MACKENZIE CL REVENU STRATÉGIQUE (REVENU FIXE) LP

Au 30 septembre 2022

(indique la quote-part (25,2 %) détenue par le Fonds de revenu stratégique Canada Vie)

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS					
ADS Tactical Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 04-03-2028	États-Unis	Prêts à terme	254 371 USD	324	325
Advantage Sales & Marketing Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 28-10-2027	États-Unis	Prêts à terme	165 575 USD	211	206
AES Panama Generation Holdings SRL 4,38 % 31-05-2030, rachetables 2030	Panama	Sociétés – Non convertibles	252 289 USD	337	275
Al Aqua Merger Sub Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 30-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	31 116 USD	37	40
AIMCo Realty Investors LP 3,04 % 01-06-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	77 957	84	72
AIMCo Realty Investors LP 2,71 % 01-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	295 178	309	262
Albertsons Cos. Inc. 4,63 % 15-01-2027, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	283 825 USD	382	354
Alcami Carolinas Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 06-07-2025	États-Unis	Prêts à terme	343 921 USD	388	434
Alchemy US Holdco LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-10-2025	États-Unis	Prêts à terme	238 205 USD	301	314
Alcoa Nederland Holding BV 5,50 % 15-12-2027, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	252 289 USD	345	331
Algonquin Power & Utilities Corp. 4,09 % 17-02-2027, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	269 949	300	259
Alimentation Couche-Tard inc. 2,95 % 25-01-2030, rachetables 2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	126 145 USD	168	143
Allied Universal Holdco LLC 3,63 % 01-06-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	353 205 EUR	523	358
Alice Financing SA 5,75 % 15-08-2029 144A	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	555 036 USD	719	588
Alice France SA 2,13 % 15-02-2025, rachetables 2022	France	Sociétés – Non convertibles	327 976 EUR	479	391
Alice France SA 5,13 % 15-07-2029	France	Sociétés – Non convertibles	504 578 USD	642	522
American Teleconferencing Services Ltd., prêt à terme de premier rang, taux variable 08-06-2023	États-Unis	Prêts à terme	585 018 USD	283	45
AP Core Holdings II LLC, prêt à terme B2 de premier rang, taux variable 21-07-2027	États-Unis	Prêts à terme	363 296 USD	454	467
ARC Resources Ltd. 2,35 % 10-03-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	113 026	115	103
ARC Resources Ltd. 3,47 % 10-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	113 530	118	99
Arcos Dorados Holdings Inc. 5,88 % 04-04-2027, rachetables 2022	Uruguay	Sociétés – Non convertibles	145 571 USD	194	193
ARD Finance SA 6,50 % 30-06-2027, rachetables 2022 144A	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	168 610 USD	227	161
Ardagh Metal Packaging 4,00 % 01-09-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	267 427 USD	347	272
Aroundtown SA 4,63 % 18-09-2025, rachetables 2025	Allemagne	Sociétés – Non convertibles	189 217	205	181
Vins Arterra Canada Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 18-11-2027	Canada	Prêts à terme	118 980	118	115
Ascend Wellness Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 27-08-2025	États-Unis	Prêts à terme	257 335 USD	323	321
Ashtead US Holdings Inc. 4,00 % 01-05-2028	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	204 354 USD	275	248
Ashton Woods USA LLC 4,63 % 01-08-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	414 259 USD	535	419
Asurion LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 18-12-2026	États-Unis	Prêts à terme	138 809 USD	173	163
Athene Global Funding, taux variable 09-04-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	239 675	240	237
Athene Global Funding 2,10 % 24-09-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	141 282	144	128
Atlantica Sustainable Infrastructure PLC 4,13 % 15-06-2028 144A	Espagne	Sociétés – Non convertibles	247 243 USD	329	290
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	579 004	610	534
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 27-07-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	169 034	169	135
Bausch Health Cos. Inc. 6,25 %, 15-02-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	175 089 USD	220	93
bclMC Realty Corp. 1,06 % 12-03-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	61 054	61	58
bclMC Realty Corp. 1,07 % 04-02-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	93 347	92	83
bclMC Realty Corp. 1,75 % 24-07-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	85 778	84	69
BCPE Cycle Merger Sub II Inc. 10,63 % 15-07-2027, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	63 072 USD	85	40
Broadcast Media Partners Holdings Inc. 4,50 % 01-05-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	479 349 USD	619	544
Brookfield Infrastructure Finance ULC 4,20 % 11-09-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	438 983	490	416
Brookfield Infrastructure Finance ULC 3,41 % 09-10-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	340 590	363	304
Brookfield Infrastructure Finance ULC 2,86 % 01-09-2032, rachetables 2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	47 935	48	38
Brookfield Renewable Partners ULC 4, 25 % 15-01-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	327 976	375	315
Brookfield Renewable Partners ULC 4,29 % 05-11-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	151 373	172	128

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

TABLEAU DES PLACEMENTS – SEC MACKENZIE CL REVENU STRATÉGIQUE (REVENU FIXE) LP (suite)

Au 30 septembre 2022

(indique la quote-part (25,2 %) détenue par le Fonds de revenu stratégique Canada Vie)

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Brookfield Residential Properties Inc. 5,13 % 15-06-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	466 230	473	377
BWAY Holding Co. 7,25 % 15-04-2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	328 228 USD	416	399
C&D Technologies Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 13-12-2025	États-Unis	Prêts à terme	283 926 USD	356	360
California Resources Corp. 7,13 % 01-02-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	476 826 USD	645	622
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 21-04-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	722 304	726	637
Banque Canadienne Impériale de Commerce 4,38 % 28-10-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	138 759	146	128
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada 3,00 % 08-02-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	247 243	265	226
Banque canadienne de l'Ouest, taux variable 31-07-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	127 406	130	109
Capital Power Corp. 3,15 % 01-10-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	141 282	141	114
Carnival Corp. 9,88 % 01-08-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	188 460 USD	275	258
Cascades inc. 5,13 % 15-01-2025, rachetables 2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	292 655	304	283
Cascades inc. 5,13 % 15-01-2026, rachetables 2023 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	502 055 USD	676	637
CCL Industries Inc. 3,86 % 13-04-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	184 171	202	172
CCO Holdings LLC 5,38 % 01-06-2029, rachetables 2024 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	229 583 USD	318	279
CCO Holdings LLC 4,25 % 01-02-2031, rachetables 2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	27 752 USD	36	30
CCS-CMGC Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 25-09-2025	États-Unis	Prêts à terme	231 286 USD	288	297
Centene Corp. 4,63 % 15-12-2029, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	88 301 USD	123	110
Centene Corp. 3,38 % 15-02-2030, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	191 740 USD	254	217
CenturyLink Inc. 4,00 % 15-02-2027, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	136 236 USD	177	159
Charter Communications Operating LLC 4,50 % 01-02-2024, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	199 308 USD	274	272
Charter Communications Operating LLC 5,05 % 30-03-2029, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	340 590 USD	511	435
Charter Communications Operating LLC 2,80 % 01-04-2031, rachetables 2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	90 824 USD	118	95
Charter Communications Operating LLC 2,30 % 01-02-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	105 961 USD	130	105
Charter Communications Operating LLC 3,50 % 01-06-2041	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	52 981 USD	68	47
Chemtrade Logistics Income Fund 4,75 % 31-05-2024, conv., rachetables 2022	Canada	Sociétés – Convertibles	426 369	412	414
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 4,18 % 08-03-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	244 468	273	231
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 3,53 % 11-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	254 812	274	229
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 2,98 % 04-03-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	141 282	146	120
The Clorox Co. 1,80 % 15-05-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	111 007 USD	139	118
Columbia Care Inc. 6,00 % 29-06-2025, conv.	Canada	Sociétés – Convertibles	459 166 USD	582	635
CommScope Inc. 4,75 % 01-09-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	224 537 USD	289	254
Connect Finco SARL 6,75 % 01-10-2026	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	388 525 USD	521	470
Constellation SE 3,75 % 15-04-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	85 778 USD	108	87
Continental Resources Inc. 5,75 % 15-01-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	181 648 USD	281	228
Cook & Boardman Group LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 12-10-2025	États-Unis	Prêts à terme	155 359 USD	194	202
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	129 427	144	120
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-09-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	132 008	146	123
Corus Entertainment Inc. 5,00 % 11-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	706 410	714	576
Costco Wholesale Corp. 1,38 % 20-06-2027, rachetables 2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	179 125 USD	229	214
CPPIB Capital Inc. 1,95 % 30-09-2029	Canada	Gouvernement fédéral	264 904	272	234
Crew Energy Inc. 6,50 % 14-03-2024, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	161 970	156	161
Crocs Inc. 4,13 % 15-08-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	68 118 USD	88	73
Fonds de placement immobilier Crombie 3,13 % 12-08-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	37 843	38	31
CrownRock LP/CrownRock Finance Inc. 5,63 % 15-10-2025, rachetables 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	282 564 USD	370	375
CSC Holdings LLC 5,75 % 15-01-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	146 328 USD	196	146
Dana Inc. 3,00 % 15-07-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	176 602 EUR	273	174
DaVita Inc. 3,75 % 15-02-2031, rachetables 2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	153 896 USD	192	152
Devon Energy Corp. 4,50 % 15-01-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	132 200 USD	183	167
Diamond Sports Group LLC 5,38 % 15-08-2026, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	320 407 USD	270	88

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

TABLEAU DES PLACEMENTS – SEC MACKENZIE CL REVENU STRATÉGIQUE (REVENU FIXE) LP (suite)

Au 30 septembre 2022

(indique la quote-part (25,2 %) détenue par le Fonds de revenu stratégique Canada Vie)

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Diamond Sports Group LLC 6,63 % 15-08-2027, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	280 041 USD	152	28
Diamondback Energy Inc. 3,50 % 01-12-2029, rachetables 2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	262 381 USD	358	313
DIRECTV Financing LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 22-07-2027	États-Unis	Prêts à terme	334 473 USD	420	432
Dollarama inc. 1,51 % 20-09-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	47 935	47	41
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 1,66 % 22-12-2025 (A)	Canada	Sociétés – Non convertibles	99 150	99	88
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,06 % 17-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	59 288	60	51
Electrical Components International Inc., prêt à terme de second rang, taux variable 22-06-2026	États-Unis	Prêts à terme	75 687 USD	91	86
Empire Communities Corp. 7,38 % 15-12-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	454 120	477	400
L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie 3,63 % 17-04-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	15 137	15	13
Empresas CMPC SA 3,00 % 06-04-2031	Chili	Sociétés – Non convertibles	340 590 USD	440	351
Enbridge Gas Inc. 2,37 % 09-08-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	90 824	94	79
Enbridge Gas Inc. 3,01 % 09-08-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	83 255	81	60
Enbridge Gas Inc. 3,65 % 01-04-2050, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	27 752	30	22
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	3653,147	3 911	3 353
Enbridge Inc., taux variable 12-04-2078, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	905 718	1 042	879
Ensign Drilling Inc. 9,25 % 15-04-2024 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	301 990 USD	352	369
EPCOR Utilities Inc. 3,55 % 27-11-2047, rachetables 2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	216 969	233	176
EPCOR Utilities Inc. 3,11 % 08-07-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	239 675	239	177
The Estée Lauder Cos. Inc. 1,95 % 15-03-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	83 255 USD	107	92
Exxon Mobil Corp. 2,61 % 15-10-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	116 053 USD	156	137
FAGE International SA 5,63 % 15-08-2026, rachetables 2022 144A	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	50 458 USD	66	62
Fairfax Financial Holdings Ltd. 8,30 % 15-04-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	338 067 USD	538	503
Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,23 % 14-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	90 824	99	83
Fairfax Financial Holdings Ltd. 3,95 % 03-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	431 414	457	371
Fairfax India Holdings Corp. 5,00 % 26-02-2028 144A	Inde	Sociétés – Non convertibles	653 429 USD	826	836
Flynn America LP, prêt à terme B de premier rang, taux variable 23-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	341 631 USD	419	423
Fortified Trust 2,34 % 23-01-2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	257 335	263	256
Foxtrot Escrow Issuer LLC 12,25 % 15-11-2026, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	384 236 USD	556	422
Frontera Generation Holdings LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 28-07-2026	États-Unis	Prêts à terme	33 204 USD	42	11
Frontera Generation Holdings LLC, prêt à terme de second rang, taux variable 26-04-2028	États-Unis	Prêts à terme	32 228 USD	23	1
FXI Holdings Inc. 7,88 % 01-11-2024, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	356 485 USD	464	390
General Motors Co. 6,80 % 01-10-2027, rachetables 2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	138 759 USD	222	196
GFL Environmental Inc. 3,75 % 01-08-2025, rachetables 2022 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	196 786 USD	258	252
GFL Environmental Inc. 5,13 % 15-12-2026, rachetables 2022 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	206 877 USD	276	267
GFL Environmental Inc. 3,50 % 01-09-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	175 089 USD	223	204
Gibson Energy Inc. 2,85 % 14-07-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	671 089	696	602
Gibson Energy Inc., taux variable 22-12-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	756 867	770	653
GoDaddy Operating Co. LLC 3,50 % 01-03-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	340 590 USD	434	385
GOL Linhas aéreas inteligentes SA 8,00 % 30-06-2026	Brésil	Sociétés – Non convertibles	45 917 USD	58	39
The Goldman Sachs Group Inc. 3,31 %, taux variable 31-10-2025, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	249 766	265	240
Gouvernement des Bahamas 6,00 % 21-11-2028, rachetables 2028	Bahamas	Gouvernements étrangers	338 067 USD	422	284
Gouvernement des Bahamas 6,95 % 20-11-2029	Bahamas	Gouvernements étrangers	5 046 USD	7	4
Gouvernement du Mexique 5,75 % 05-03-2026	Mexique	Gouvernements étrangers	45 285 903 MXN	2 796	2 732
Gouvernement du Mexique 7,75 % 29-05-2031	Mexique	Gouvernements étrangers	11 226 867 MXN	755	685
Fiducie de placement immobilier Granite 2,19 % 30-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	87 544	88	74
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 2,73 % 03-04-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	128 667	136	116
Greenhill & Co. Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 05-04-2024	États-Unis	Prêts à terme	115 233 USD	146	156
Gulfport Energy Corp. 8,00 % 17-05-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	143 805 USD	197	198
Fonds de placement immobilier H&R 3,42 % 23-01-2023, rachetables 2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	181 648	187	181
Fonds de placement immobilier H&R 4,07 % 16-06-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	290 637	312	279

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

TABLEAU DES PLACEMENTS – SEC MACKENZIE CL REVENU STRATÉGIQUE (REVENU FIXE) LP (suite)

Au 30 septembre 2022

(indique la quote-part (25,2 %) détenue par le Fonds de revenu stratégique Canada Vie)

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Fonds de placement immobilier H&R 2,63 % 19-02-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	138 759	140	123
Hadrian Merger Sub Inc. 8,50 % 01-05-2026, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	316 875 USD	417	404
Heathrow Funding Ltd. 2,69 % 13-10-2027	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	148 851	153	132
Heathrow Funding Ltd. 3,79 % 04-09-2030, rachetables 2030	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	254 812	276	226
Honda Canada Finance Inc. 1,65 % 25-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	143 805	142	121
Hydro One Ltd. 1,41 % 15-10-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 916	99	87
Hyster-Yale Group Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 21-05-2028	États-Unis	Prêts à terme	214 207 USD	271	275
IAMGOLD Corp. 5,75 % 15-10-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	269 949 USD	343	178
Indy US Bidco LLC, prêt à terme B3 de premier rang, taux variable 05-03-2028	États-Unis	Prêts à terme	233 456 USD	296	291
INEOS Enterprises Holdings US Finco LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 03-09-2026	États-Unis	Prêts à terme	130 598 USD	166	172
Innovative Industrial Properties Inc. 5,50 % 25-05-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	285 087 USD	381	350
Integro Ltd., prêt à terme B1 de premier rang, taux variable 10-11-2022	États-Unis	Prêts à terme	5 595 USD	7	8
Integro Ltd. (États-Unis), prêt à terme B1 de premier rang, taux variable 31-10-2022	États-Unis	Prêts à terme	119 707 USD	149	151
Inter Pipeline Ltd., taux variable 26-03-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 372 453	1 525	1 300
Inter Pipeline Ltd., taux variable 19-11-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	406 186	445	376
Iris Merger Sub 2019 Inc. 9,38 % 15-02-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	174 080 USD	239	232
Iron Mountain Inc. 5,00 % 15-07-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	201 831 USD	270	241
Iron Mountain Inc. 5,25 % 15-07-2030, rachetables 2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	327 976 USD	446	378
Ivanhoe Cambridge II Inc. 2,91 % 27-06-2023, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	136 236	141	134
Ivanhoe Cambridge II Inc. 2,30 % 12-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	15 137	16	14
Jadex Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 12-02-2028	États-Unis	Prêts à terme	498 575 USD	627	638
Jazz Pharmaceuticals PLC 4,38 % 15-01-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	479 349 USD	632	573
Journey Personal Care Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 19-02-2028	États-Unis	Prêts à terme	88 793 USD	113	80
Jump Financial LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 04-08-2028	États-Unis	Prêts à terme	289 729 USD	363	373
Kaisa Group Holdings Ltd. 9,38 % 30-06-2024	Chine	Sociétés – Non convertibles	55 504 USD	61	9
Kaisa Group Holdings Ltd. 11,70 % 11-11-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	100 916 USD	117	15
Keane Group Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 18-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	489 334 USD	606	658
Keyera Corp. 3,96 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	116 053	126	104
Keyera Corp., taux variable 13-06-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 175 667	1 315	1 129
Keyera Corp., taux variable 10-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	620 631	654	544
Produits Kruger S.E.C. 6,00 % 24-04-2025, rachetables 2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	482 125	503	455
Produits Kruger S.E.C. 5,38 % 09-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	343 113	351	288
LABL Escrow Issuer LLC 6,75 % 15-07-2026, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	317 380 USD	424	399
LABL Escrow Issuer LLC 10,50 % 15-07-2027, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	258 092 USD	356	306
Lamar Media Corp. 4,00 % 15-02-2030, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	300 224 USD	395	348
Lancet Merger Sub Inc., prêt à terme à prélèvement différé de premier rang, taux variable 09-08-2028	États-Unis	Prêts à terme	16 537 USD	21	21
Lancet Merger Sub Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 09-08-2028	États-Unis	Prêts à terme	184 644 USD	234	239
Banque Laurentienne du Canada, taux variable 15-06-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	363 296	366	311
LBM Acquisition LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 08-12-2027	États-Unis	Prêts à terme	22 986 USD	29	28
Level 3 Financing Inc. 3,75 % 15-07-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	98 393 USD	123	100
Liberty Utilities (Canada) LP 3,32 % 14-02-2050, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	73 164	71	53
LifeMiles Ltd., prêt à terme B de premier rang, taux variable 16-08-2026	Colombie	Prêts à terme	172 683 USD	217	230
LifeScan Global Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 19-06-2024	États-Unis	Prêts à terme	152 278 USD	192	171
LifeScan Global Corp., prêt à terme de second rang, taux variable 19-06-2025	États-Unis	Prêts à terme	189 217 USD	228	206
Lions Gate Entertainment Inc. 5,50 % 15-04-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	209 400 USD	272	217
Les Compagnies Loblaw Itée 4,49 % 11-12-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	73 164	85	72
Les Compagnies Loblaw Itée 2,28 % 07-05-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	158 942	158	132
LogMeln Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 14-08-2027	États-Unis	Prêts à terme	223 087 USD	283	215

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

TABLEAU DES PLACEMENTS – SEC MACKENZIE CL REVENU STRATÉGIQUE (REVENU FIXE) LP (suite)

Au 30 septembre 2022

(indique la quote-part (25,2 %) détenue par le Fonds de revenu stratégique Canada Vie)

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Lower Mattagami Energy LP 2,43 % 14-05-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	75 182	78	64
LRS Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 13-08-2028	États-Unis	Prêts à terme	255 405 USD	324	335
Magenta Buyer LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 03-05-2028	États-Unis	Prêts à terme	42 361 USD	53	53
Magenta Buyer LLC, prêt à terme de second rang, taux variable 03-05-2029	États-Unis	Prêts à terme	121 099 USD	154	155
Société Financière Manuvie, taux variable 09-05-2028, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	146 328	152	145
Société Financière Manuvie, taux variable 12-05-2030, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	85 778	88	79
Société Financière Manuvie 3,38 % 19-06-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	239 675	241	193
Mar Bidco SARL, prêt à terme B de premier rang, taux variable 21-04-2028	Luxembourg	Prêts à terme	332 USD	1	1
Mastercard Inc. 1,90 % 15-03-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	47 935 USD	62	53
Mattel Inc. 3,15 % 15-03-2023, rachetables 2022	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	196 786 USD	255	269
Mattel Inc. 3,38 % 01-04-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	295 178 USD	390	368
Mav Acquisition Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 21-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	100 544 USD	126	128
Mav Acquisition Corp. 5,75 % 01-08-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	575 219 USD	725	668
McDonald's Corp. 3,13 % 04-03-2025, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	391 048	415	377
MEG Energy Corp. 7,13 % 01-02-2027, rachetables 2023 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	393 571 USD	527	554
MEG Energy Corp. 5,88 % 01-02-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	391 048 USD	511	486
Mercer International Inc., taux variable 01-02-2029	Allemagne	Sociétés – Non convertibles	151 373 USD	195	168
Mexico Remittances Funding Fiduciary Estate Management SARL 4,88 % 15-01-2028	Mexique	Sociétés – Non convertibles	378 434 USD	475	436
Morgan Stanley 3,00 % 07-02-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	557 559	583	542
Nabors Industries Ltd. 7,25 % 15-01-2026, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	171 557 USD	208	207
Banque Nationale du Canada, taux variable 15-08-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	370 865	372	302
National Grid Electricity Transmission PLC 2,30 % 22-06-2029	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	125 135	126	106
NAV CANADA 2,06 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	70 641	71	60
New Red Finance Inc. 4,00 % 15-10-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	222 014 USD	282	242
New Trojan Parent Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 22-01-2029	États-Unis	Prêts à terme	55 504 USD	70	69
NextEra Energy Capital Holdings Inc. 2,25 % 01-06-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	179 125 USD	231	198
Nine Energy Service Inc. 8,75 % 01-11-2023, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	236 647 USD	149	253
North Battleford Power LP 4,96 % 31-12-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	370 755	430	371
North West Redwater Partnership 2,80 % 01-06-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	168 025	171	143
Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc. 4,11 % 31-03-2042	Canada	Sociétés – Non convertibles	191 480	213	166
Nova Scotia Power Inc. 3,57 % 05-04-2049, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	118 576	125	94
NuVista Energy Ltd. 7,88 % 23-07-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	408 708	411	409
OMERS Finance Trust 1,55 % 21-04-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	643 337	648	580
OMERS Realty Corp. 3,63 % 05-06-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	49 196	55	46
Ontario Power Generation Inc. 3,32 % 04-10-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	194 263	212	183
Osmosis Debt Merger Sub Inc., prêt à terme à prélèvement différé de premier rang, taux variable 17-06-2028	États-Unis	Prêts à terme	280 041 USD	348	369
Panther BF Aggregator 2 LP 8,50 % 15-05-2027, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	207 634 USD	282	274
Corporation Parkland du Canada 3,88 % 16-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	567 651	576	514
Corporation Parkland du Canada 4,50 % 01-10-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	824 986 USD	1 076	928
Corporation Parkland 4,38 % 26-03-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	986 451	1 004	836
Corporation Pétroles Parkland 5,88 % 15-07-2027, rachetables 2022 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	36 077 USD	49	46
Corporation Pétroles Parkland 6,00 % 23-06-2028, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	587 834	634	556
Pattern Energy Operations LP 4,50 % 15-08-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	118 576 USD	159	143
Pembina Pipeline Corp., taux variable 25-01-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 218 557	1 222	1 007
Petróleos de Venezuela SA 6,00 % 16-05-2024	Venezuela	Sociétés – Non convertibles	562 605 USD	34	18
Petróleos Mexicanos 6,70 % 16-02-2032	Mexique	Sociétés – Non convertibles	314 352 USD	404	307
PharmaCann LLC 12,00 % 30-06-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	301 990 USD	392	412
Plaze Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 03-08-2026	États-Unis	Prêts à terme	175 997 USD	223	224

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

TABLEAU DES PLACEMENTS – SEC MACKENZIE CL REVENU STRATÉGIQUE (REVENU FIXE) LP (suite)

Au 30 septembre 2022

(indique la quote-part (25,2 %) détenue par le Fonds de revenu stratégique Canada Vie)

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Pluto Acquisition I Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 20-06-2026	États-Unis	Prêts à terme	113 345 USD	144	137
Province de la Colombie-Britannique 2,95 % 18-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	567 651	615	460
Province de Québec 3,50 % 01-12-2048	Canada	Gouvernements provinciaux	78 210	93	70
Province de la Saskatchewan 3,10 % 02-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	300 224	327	249
Province de la Saskatchewan 2,80 % 02-12-2052	Canada	Gouvernements provinciaux	429 396	441	333
QVC Inc. 4,38 % 01-09-2028, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	226 303 USD	301	216
Rackspace Technology Global Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 09-02-2028	États-Unis	Prêts à terme	158 USD	–	–
Rackspace Technology Global Inc. 3,50 % 15-02-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	315 361 USD	385	288
Real Hero Merger Sub 2 Inc. 6,25 % 01-02-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	151 373 USD	200	153
Resolute Investment Managers Inc., prêt à terme de second rang, taux variable 30-04-2025	États-Unis	Prêts à terme	119 645 USD	152	151
Resolute Investment Managers Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 30-04-2024	États-Unis	Prêts à terme	243 066 USD	306	300
Banque Royale du Canada 1,83 % 31-07-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	189 217	189	159
Banque Royale du Canada, taux variable 24-11-2080, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	520 977	554	484
Banque Royale du Canada, taux variable 24-02-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	265 660	276	240
Métaux Russel Inc. 6,00 % 16-03-2026, rachetables 2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	310 316	325	304
Sagen MI Canada Inc. 3,26 % 05-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	88 301	91	73
Sagen MI Canada Inc., taux variable 24-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	65 595	67	55
Saputo inc. 2,88 % 19-11-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	80 733	85	77
Saputo inc. 2,24 % 16-06-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	92 842	94	82
Saputo inc. 2,30 % 22-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	14 380	15	12
Schweitzer-Mauduit International Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 23-02-2028	États-Unis	Prêts à terme	286 506 USD	364	371
Seaspan Corp. 5,50 % 01-08-2029 144A	Hong Kong	Sociétés – Non convertibles	193 506 USD	255	208
Secure Energy Services Inc. 7,25 % 30-12-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	229 583	232	219
Shaw Communications Inc. 2,90 % 09-12-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	95 618	96	79
Sienna Senior Living Inc. 3,11 % 04-11-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	60 549	63	58
Sienna Senior Living Inc. 3,45 % 27-02-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	55 504	59	52
Sigma Bidco BV, prêt à terme B de premier rang, taux variable 07-03-2025	Pays-Bas	Prêts à terme	404 420 EUR	591	443
Signify Health LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 16-06-2028	États-Unis	Prêts à terme	46 784 USD	59	64
Silgan Holdings Inc. 4,13 % 01-02-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	267 427 USD	352	329
Sinclair Television Group Inc. 5,13 % 15-02-2027, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	249 766 USD	308	288
Sinclair Television Group Inc. 5,50 % 01-03-2030, rachetables 2024 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	274 995 USD	338	274
SmartCentres Real Estate Investment Trust 3,19 % 11-06-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	63 072	66	57
Sorenson Communications LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 12-03-2026	États-Unis	Prêts à terme	128 429 USD	164	171
Source energy Services 10,50 % 15-03-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	731 208	212	435
South Coast British Columbia Transportation Authority 1,60 % 03-07-2030	Canada	Administrations municipales	148 851	146	126
Southwestern Energy Co. 5,38 % 15-03-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	229 583 USD	310	285
Spa Holdings 3 Oy 4,88 % 04-02-2028 144A	Finlande	Sociétés – Non convertibles	277 518 USD	355	308
Spa US HoldCo Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 12-03-2028	États-Unis	Prêts à terme	261 609 USD	333	336
Specialty Pharma III Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 24-02-2028	États-Unis	Prêts à terme	212 301 USD	269	274
Sprint Capital Corp. 6,88 % 15-11-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	103 439 USD	171	147
Stitch Acquisition Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 27-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	487 USD	1	1
Summit Industrial Income Real Estate Investment Trust 2,44 % 14-07-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 871	41	35
Financière Sun Life inc., taux variable 13-08-2029, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	153 896	159	146
Financière Sun Life inc., taux variable 01-10-2035	Canada	Sociétés – Non convertibles	141 282	138	111
Financière Sun Life inc., taux variable 30-06-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	93 852	95	76
Suncor Énergie Inc. 3,10 % 24-05-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	194 263	204	179

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

TABLEAU DES PLACEMENTS – SEC MACKENZIE CL REVENU STRATÉGIQUE (REVENU FIXE) LP (suite)

Au 30 septembre 2022

(indique la quote-part (25,2 %) détenue par le Fonds de revenu stratégique Canada Vie)

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Suncor Énergie Inc. 3,95 % 04-03-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	22 706	23	17
Supérieur Plus S.E.C. 4,25 % 18-05-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	971 313	999	844
Supérieur Plus S.E.C. 4,50 % 15-03-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	315 361 USD	413	360
Tacora Resources Inc. 8,25 % 15-05-2026 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	128 667 USD	171	152
Target Corp. 2,25 % 15-04-2025, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	75 687 USD	101	99
TELUS Corp. 2,35 % 27-01-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	103 439	105	90
TELUS Corp. 3,30 % 02-05-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	134 975	144	121
TELUS Corp. 3,15 % 19-02-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	391 048	413	342
TELUS Corp. 2,05 % 07-10-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	121 099	116	96
Tencent Holdings Ltd. 2,39 % 03-06-2030, rachetables 2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	73 164 USD	92	79
Tencent Music Entertainment Group 1,38 % 03-09-2025, rachetables 2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	50 458 USD	63	62
Tenet Healthcare Corp. 4,88 % 01-01-2026, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	151 121 USD	199	195
Tenet Healthcare Corp. 6,13 % 01-10-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	534 853 USD	718	656
TerraForm Power Operating LLC 5,00 % 31-01-2028, rachetables 2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	494 487 USD	679	607
TerraForm Power Operating LLC 4,75 % 15-01-2030, rachetables 2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	85 778 USD	115	101
Tianqi Finco Co. Ltd. 3,75 % 28-11-2022	Chine	Sociétés – Non convertibles	50 458 USD	58	69
T-Mobile USA Inc. 3,75 % 15-04-2027, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	335 545 USD	472	429
T-Mobile USA Inc. 2,55 % 15-02-2031, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	65 595 USD	85	72
Groupe TMX Ltée 2,30 % 11-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	169 034	178	162
Groupe TMX Ltée 3,78 % 05-06-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	126 145	141	120
Groupe TMX Ltée 2,02 % 12-02-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	58 027	57	46
La Banque Toronto-Dominion 1,94 % 13-03-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	292 655	299	272
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 22-04-2030, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	214 193	226	202
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-10-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	278 780	275	223
Tourmaline Oil Corp. 2,53 % 12-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	43 898	44	38
Toyota Motor Corp. 1,34 % 25-03-2026	Japon	Sociétés – Non convertibles	58 027 USD	74	71
TransCanada Pipelines Ltd. 4,18 % 03-07-2048, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	12 362	13	10
TransCanada Pipelines Ltd. 4,20 % 04-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	245 225	245	199
TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 612 128	1 691	1 451
Transurban Finance Co. Pty. Ltd. 4,56 % 14-11-2028, rachetables 2028	Australie	Sociétés – Non convertibles	428 892	477	412
Trulieve Cannabis Corp. 9,75 % 18-06-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	663 520 USD	903	877
Uber Technologies Inc. 4,50 % 15-08-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	141 282 USD	179	165
UPC Broadband Finco BV 4,88 % 15-07-2031 144A	Pays-Bas	Sociétés – Non convertibles	262 381 USD	345	281
US Radiology Specialists Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 15-12-2027	États-Unis	Prêts à terme	106 356 USD	135	130
US Silica Holdings Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-05-2025	États-Unis	Prêts à terme	57 856 USD	71	77
Ventas Inc. 2,80 % 12-04-2024, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	138 759	144	133
Veregy, prêt à terme de premier rang, taux variable 03-11-2027	États-Unis	Prêts à terme	203 257 USD	259	268
Verizon Communications Inc. 2,38 % 22-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	216 969	221	190
Verizon Communications Inc. 2,50 % 16-05-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	115 548	117	97
Verizon Communications Inc. 1,75 % 20-01-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	189 217 USD	232	196
Verizon Communications Inc. 2,55 % 21-03-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	98 393 USD	129	109
Vesta Energy Corp. 10 % 15-10-2025 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	290 133	241	282
Viad Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 27-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	169 759 USD	214	224
Viasat Inc. 6,50 % 15-07-2028, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	166 511 USD	224	155
Vidéotron Itée 5,75 % 15-01-2026, rachetables 2022	Canada	Sociétés – Non convertibles	227 060	233	222
Vidéotron Itée 3,63 % 15-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	595 402	600	505
Vidéotron Itée 4,50 % 15-01-2030, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	227 060	238	194
Vidéotron Itée 3,13 % 15-01-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	749 299	709	566
Vidéotron Itée 5,63 % 15-06-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 596 233	1 761	1 579
Virgin Media Secured Finance PLC 4,50 % 15-08-2030, rachetables 2025 144A	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	133 713 USD	175	146
VMED O2 UK Financing I PLC 4,25 % 31-01-2031	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	698 841 USD	892	732
VZ Vendor Financing BV 2,88 % 15-01-2029	Pays-Bas	Sociétés – Non convertibles	151 373 EUR	224	147
Walmart Inc. 2,38 % 24-09-2029, rachetables 2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	23 211 USD	32	27

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

TABLEAU DES PLACEMENTS – SEC MACKENZIE CL REVENU STRATÉGIQUE (REVENU FIXE) LP (suite)

Au 30 septembre 2022

(indique la quote-part (25,2 %) détenue par le Fonds de revenu stratégique Canada Vie)

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
OBLIGATIONS (suite)					
Waste Management of Canada Corp. 2,60 % 23-09-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	272 472	286	249
WDB Holding PA Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 18-12-2024	États-Unis	Prêts à terme	181 648 USD	226	239
Wells Fargo & Co. 2,57 % 01-05-2026, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	264 904	275	247
Wells Fargo & Co. 2,98 % 19-05-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	106 971	113	99
Wells Fargo & Co. 2,49 % 18-02-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	190 983	197	170
Wells Fargo & Co., taux variable 15-03-2169	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	23 715 USD	31	28
Welltower Inc. 4,25 % 15-04-2028, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	169 034 USD	246	218
Welltower Inc. 4,13 % 15-03-2029, rachetables 2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	163 988 USD	237	206
Whole Earth Brands Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 02-02-2026	États-Unis	Prêts à terme	288 266 USD	365	375
WildBrain Ltd. 5,88 % 30-09-2024, conv.	Canada	Sociétés – Convertibles	146 328	143	139
Women's Care Holdings Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 15-01-2028	États-Unis	Prêts à terme	151 594 USD	192	197
Ziggo BV 4,88 % 15-01-2030, rachetables 2024 144A	Pays-Bas	Sociétés – Non convertibles	214 446 USD	281	235
Total des obligations				106 933	94 575
ACTIONS					
American Addiction Centers Holdings Inc.	États-Unis	Soins de santé	14 291	181	198
BCE Inc., priv., série AA	Canada	Services de communication	4 072	75	69
BCE Inc., priv., série AI	Canada	Services de communication	5 244	99	77
BCE Inc., priv., série AL	Canada	Services de communication	12 559	218	211
BCE Inc. 4,54 %, à div. cumulatif, rachetables, priv. de premier rang, série R, rachetables	Canada	Services de communication	5 185	95	75
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 46	Canada	Biens immobiliers	14 871	381	335
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 48	Canada	Biens immobiliers	5 980	155	139
Brookfield Renewable Partners L.P., priv., série 13	Canada	Services publics	1 860	48	40
Cenovus Energy Inc., priv., série 3	Canada	Énergie	4 672	103	95
Cenovus Energy Inc., priv., série 7	Canada	Énergie	5 677	128	115
Cenovus Energy Inc. 4,45 % 31-12-2049, priv., série 1	Canada	Énergie	3 556	56	50
Columbia Care Inc., bons de souscription éch. 14-05-2023	Canada	Soins de santé	23 614	15	–
Emera Inc., priv., série J	Canada	Services publics	17 363	462	408
Fairfax Financial Holdings Ltd., priv., série E	Canada	Services financiers	5 904	101	85
Fairfax Financial Holdings Ltd., priv., série F	Canada	Services financiers	4 130	68	67
Fannie Mae, priv., série S	États-Unis	Services financiers	6 143	13	31
Frontera Generation Holdings LLC	États-Unis	Énergie	2 359	6	6
Intelsat Jackson Holdings SA, A, bons de souscription éch. 05-12-2025	Luxembourg	Services de communication	74	1	1
Intelsat Jackson Holdings SA, B, bons de souscription éch. 05-12-2025	Luxembourg	Services de communication	74	–	–
Intelsat Jackson Holdings SA	Luxembourg	Services de communication	707	30	33
iQor US Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	1 268	22	21
Les Compagnies Loblaw Itée 5,30 %, à div. cumulatif, rachetables, priv. de second rang, série B	Canada	Consommation de base	8 583	228	186
Société Financière Manuvie, priv., série 13	Canada	Services financiers	8 779	211	160
TransAlta Corp., priv., série A	Canada	Services publics	34 452	496	467
TransAlta Corp. 4,60 %, perpétuelles, priv., rachetables 2022, série C	Canada	Services publics	10 140	190	198
Total des actions				3 381	3 067
Coûts de transaction				–	–
Total des placements				110 314	97 642
Instruments dérivés (se reporter au tableau des instruments dérivés)					–
Trésorerie et équivalents de trésorerie					(3 163)
Autres éléments d'actif moins le passif					1 054
Actif net attribuable aux commanditaires					2 527
					98 060

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

APERÇU DU PORTEFEUILLE

30 SEPTEMBRE 2022

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Actions	49,1
Obligations	49,0
Obligations	48,6
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)	0,4
Options achetées	–
Options vendues	–
Trésorerie et placements à court terme	3,0
Autres éléments d'actif (de passif)	(1,1)

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	44,3
États-Unis	38,2
Autre	3,8
Trésorerie et placements à court terme	3,0
Pays-Bas	1,5
France	1,4
Allemagne	1,4
Suisse	1,3
Japon	1,1
Mexique	1,1
Royaume-Uni	1,0
Chine	0,9
Irlande	0,7
Brésil	0,5
Espagne	0,5
Danemark	0,4
Autres éléments d'actif (de passif)	(1,1)

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	37,6
Services financiers	14,1
Technologie de l'information	6,3
Énergie	5,4
Produits industriels	5,1
Obligations d'État étrangères	4,4
Matériaux	3,9
Soins de santé	3,6
Consommation discrétionnaire	3,4
Consommation de base	3,3
Prêts à terme	3,2
Trésorerie et placements à court terme	3,0
Obligations fédérales	2,9
Services de communication	2,3
Autre	1,6
Services publics	1,0
Autres éléments d'actif (de passif)	(1,1)

31 MARS 2022

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Actions	49,7
Obligations	42,4
Obligations	42,0
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)	0,4
Options achetées	0,0
Options vendues	(0,0)
Trésorerie et placements à court terme	14,7
Options sur devises achetées	0,0
Autres éléments d'actif (de passif)	(6,8)

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	40,5
États-Unis	35,6
Trésorerie et placements à court terme	14,7
Autre	3,5
France	1,8
Suisse	1,5
Pays-Bas	1,5
Japon	1,2
Royaume-Uni	1,1
Allemagne	1,0
Mexique	1,0
Chine	1,0
Irlande	0,7
Luxembourg	0,7
Danemark	0,5
Espagne	0,5
Autres éléments d'actif (de passif)	(6,8)

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	28,2
Trésorerie et placements à court terme	14,7
Services financiers	14,2
Technologie de l'information	6,6
Produits industriels	5,7
Obligations d'État étrangères	5,6
Prêts à terme	5,6
Énergie	4,9
Matériaux	4,2
Consommation discrétionnaire	3,6
Soins de santé	3,2
Consommation de base	3,0
Services de communication	2,4
Obligations fédérales	2,0
Autre	1,7
Services publics	1,2
Autres éléments d'actif (de passif)	(6,8)

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

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

TABLEAU DES OPTIONS ACHETÉES

au 30 septembre 2022

Élément sous-jacent	Nombre de contrats	Type d'option	Date d'échéance	Prix d'exercice \$		Prime payée (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF	600	Vente	21 octobre 2022	70,00	USD	34	67
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF	575	Vente	18 novembre 2022	68,00	USD	49	54
Total des options						83	121

TABLEAU DES OPTIONS VENDUES

au 30 septembre 2022

Élément sous-jacent	Nombre de contrats	Type d'option	Date d'échéance	Prix d'exercice \$		Prime reçue (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF	(600)	Option de vente vendue	21 octobre 2022	67,00	USD	(10)	(25)
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF	(575)	Option de vente vendue	18 novembre 2022	64,00	USD	(19)	(21)
Total des options						(29)	(46)

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS

au 30 septembre 2022

Tableau des contrats à terme standardisés

Type de contrat	Nombre de contrats	Date d'échéance	Prix moyen des contrats (\$)	Montant notionnel* (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
Contrats à terme standardisés sur obligations Euro-Bobl, décembre 2022	(612)	8 décembre 2022	122,59 EUR	(99 275)	2 358	–
Contrats à terme standardisés sur euro-obligations à long terme du gouvernement italien (BTP), décembre 2022	(74)	8 décembre 2022	117,33 EUR	(11 225)	536	–
Contrats à terme standardisés sur obligations Euro-Schatz, décembre 2022	(268)	8 décembre 2022	108,05 EUR	(38 905)	321	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans, décembre 2022	(127)	13 décembre 2022	148,40 JPY	(179 822)	68	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor américain à 2 ans, décembre 2022	(96)	30 décembre 2022	104,27 USD	(27 256)	419	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor américain à 5 ans, décembre 2022	(734)	30 décembre 2022	111,23 USD	(109 082)	3 774	–
Total des contrats à terme standardisés				(465 565)	7 476	–

* Le montant notionnel représente l'exposition aux instruments sous-jacents au 30 septembre 2022.

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	9 774 CAD	(7 370) EUR	21 octobre 2022	(9 774)	(9 997)	–	(223)
A	106 CAD	(80) EUR	21 octobre 2022	(106)	(109)	–	(3)
A	570 EUR	(745) CAD	21 octobre 2022	745	774	29	–
A	448 EUR	(590) CAD	21 octobre 2022	590	607	17	–
A	275 EUR	(362) CAD	21 octobre 2022	362	373	11	–
A	1 863 CAD	(29 930) MXN	21 octobre 2022	(1 863)	(2 044)	–	(181)
A	6 376 CAD	(102 430) MXN	21 octobre 2022	(6 376)	(6 997)	–	(621)
A	276 CAD	(4 425) MXN	21 octobre 2022	(276)	(302)	–	(26)
A	3 125 MXN	(214) CAD	21 octobre 2022	214	214	–	–
A	110 317 CAD	(84 920) USD	21 octobre 2022	(110 317)	(117 289)	–	(6 972)
AA	1 169 CAD	(900) USD	21 octobre 2022	(1 169)	(1 243)	–	(74)
A	4 633 CAD	(3 596) USD	21 octobre 2022	(4 633)	(4 966)	–	(333)
A	6 421 CAD	(5 000) USD	21 octobre 2022	(6 421)	(6 906)	–	(485)
A	5 746 CAD	(4 500) USD	21 octobre 2022	(5 746)	(6 216)	–	(470)
A	5 480 USD	(7 538) CAD	21 octobre 2022	7 538	7 568	30	–
A	3 520 USD	(4 842) CAD	21 octobre 2022	4 842	4 862	20	–
A	102 061 CAD	(78 950) USD	28 octobre 2022	(102 061)	(109 014)	–	(6 953)
AA	9 789 CAD	(7 572) USD	28 octobre 2022	(9 789)	(10 455)	–	(666)
A	1 178 CAD	(900) EUR	4 novembre 2022	(1 178)	(1 221)	–	(43)
A	184 CAD	(140) EUR	4 novembre 2022	(184)	(190)	–	(6)
A	265 CAD	(200) EUR	4 novembre 2022	(265)	(272)	–	(7)
AA	6 565 CAD	(5 080) USD	4 novembre 2022	(6 565)	(7 013)	–	(448)
AA	7 854 CAD	(6 070) USD	4 novembre 2022	(7 854)	(8 381)	–	(527)
A	3 158 CAD	(3 560) AUD	9 novembre 2022	(3 158)	(3 147)	11	–
AA	4 089 CAD	(3 090) EUR	18 novembre 2022	(4 089)	(4 199)	–	(110)
AA	390 EUR	(515) CAD	18 novembre 2022	515	530	15	–
AA	570 EUR	(772) CAD	18 novembre 2022	772	775	3	–
A	100 816 CAD	(78 460) USD	18 novembre 2022	(100 816)	(108 321)	–	(7 505)

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2022

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 \$)
AA	2 655 CAD	(2 022) USD	13 janvier 2023	(2 655)	(2 788)	–	(133)
AA	14 834 CAD	(11 274) USD	13 janvier 2023	(14 834)	(15 552)	–	(718)
Total des contrats de change à terme de gré à gré						136	(26 504)
Total des actifs dérivés							7 612
Total des passifs dérivés							(26 504)

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

NOTES ANNEXES

1. Périodes comptables et renseignements généraux

L'information fournie dans les présents états financiers et dans les notes annexes se rapporte aux 30 septembre 2022 et 2021 ou aux semestres clos à ces dates, à l'exception des données comparatives présentées dans les états de la situation financière et les notes annexes, qui se rapportent au 31 mars 2022, selon le cas. Pour l'exercice au cours duquel un fonds ou une série est établi(e) ou rétabli(e), l'information fournie se rapporte à la période commençant à la date d'établissement ou de rétablissement. Lorsqu'une série d'un fonds a été dissoute au cours de l'une ou l'autre des périodes, l'information concernant la série est fournie jusqu'à la fermeture des bureaux à la date de dissolution. Se reporter à la note 10 pour la date de constitution du Fonds et la date d'établissement de chacune des séries.

Le Fonds a été constitué en fiducie de fonds commun de placement à capital variable en vertu des lois de la province de l'Ontario aux termes d'une déclaration de fiducie qui a été modifiée et mise à jour de temps à autre. Le siège social du Fonds est situé au 255, avenue Dufferin, London (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 distribution avec dispense de prospectus.

Gestion de placements Canada Vie limitée (« GPCV ») est le gestionnaire du Fonds et appartient à cent pour cent à La Compagnie d'Assurance du Canada sur la Vie (« Canada Vie »), filiale de Power Corporation du Canada. GPCV a conclu une convention d'administration de fonds avec Corporation Financière Mackenzie (« Mackenzie »), 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 préparés conformément aux Normes internationales d'information financière (« IFRS »), y compris la Norme comptable internationale 34 (« IAS »), *Information financière intermédiaire*, telles qu'elles ont été publiées par l'International Accounting Standards Board (l'« IASB »). Ces états financiers ont été préparés selon les mêmes méthodes comptables, les mêmes jugements comptables critiques et les mêmes estimations que ceux qui ont été utilisés pour la préparation des états financiers annuels audités les plus récents du Fonds, soit ceux de l'exercice clos le 31 mars 2022. La note 3 présente un résumé des principales méthodes comptables du Fonds en vertu des IFRS.

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

Les présents états financiers ont été approuvés pour publication par le conseil d'administration de GPCV le 10 novembre 2022.

3. Principales méthodes comptables

a) Instruments financiers

Les instruments financiers comprennent des actifs et des passifs financiers tels que des titres de créance, des titres de capitaux propres, des fonds de placement à capital variable et des dérivés. Le Fonds classe et évalue ses instruments financiers conformément à IFRS 9, *Instruments financiers*. Au moment de la comptabilisation initiale, les instruments financiers sont classés comme étant à la juste valeur par le biais du résultat net. 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 exécutée, est annulée ou expire. Par conséquent, les opérations d'achat et de vente de placements sont comptabilisées à la date de la transaction.

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 réalisés et latents sur les placements sont calculés en fonction du coût moyen pondéré des placements, mais excluent les commissions et autres coûts de transaction liés au portefeuille, qui sont présentés de manière distincte dans l'état du résultat global au poste Commissions et autres coûts de transaction liés au portefeuille.

Les profits et les pertes découlant des variations de la juste valeur des placements sont inclus 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 et des fonds négociés en bourse, le cas échéant, à la juste valeur par le biais du résultat net. GPCV a conclu qu'aucun des fonds de placement à capital variable non cotés et fonds négociés en bourse dans lesquels le Fonds investit ne respecte la définition d'une entité structurée ni la définition d'une entreprise associée.

Les titres rachetables du Fonds confèrent aux porteurs le droit de faire racheter leur participation dans le Fonds contre un montant de trésorerie égal à leur part proportionnelle de la valeur liquidative du Fonds, entre autres droits contractuels. Les titres rachetables du Fonds satisfont aux critères de classement à titre de passifs financiers conformément à 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.

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

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

NOTES ANNEXES

3. Principales méthodes comptables (suite)

b) Évaluation de la juste valeur

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

Les placements dans des titres cotés à une Bourse des valeurs mobilières ou négociés sur un marché hors cote sont évalués selon le dernier cours de marché ou le cours de clôture enregistré par la Bourse sur laquelle le titre se négocie principalement, le cours se situant à l'intérieur d'un écart acheteur-vendeur pour le placement. Dans certaines circonstances, lorsque le cours ne se situe pas à l'intérieur de l'écart acheteur-vendeur, GPCV 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 GPCV, sont inexacts ou incertains, ou ne reflètent pas tous les renseignements importants disponibles, sont évalués à leur juste valeur, laquelle sera déterminée par GPCV à l'aide de techniques d'évaluation appropriées et acceptées par le secteur, y compris des modèles d'évaluation. La juste valeur d'un titre déterminée à l'aide de modèles d'évaluation exige l'utilisation de facteurs et d'hypothèses fondés sur les données observables sur le marché, notamment la volatilité et les autres taux ou prix applicables. Dans des cas limités, la juste valeur d'un titre peut être déterminée grâce à des techniques d'évaluation qui ne sont pas appuyées par des données observables sur le marché.

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

Le Fonds peut avoir recours à des instruments dérivés (comme les options souscrites, les contrats à terme standardisés ou de gré à gré, les swaps ou les instruments dérivés synthétiques) 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 liquidées. La variation de la valeur des contrats à terme de gré à gré est incluse dans l'état du résultat global au poste Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets – Profit (perte) net(te) latent(e).

La valeur des contrats à terme standardisés ou des swaps fluctue quotidiennement; les règlements au comptant effectués tous les jours par le Fonds, le cas échéant, représentent la variation des profits ou des pertes latent(e)s, mieux établi(e)s au prix de règlement. Ces profits ou pertes latent(e)s sont inscrit(e)s et comptabilisé(e)s de cette manière jusqu'à ce que le Fonds liquide 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 – 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 obtenue.

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 2022.

Le Fonds classe la juste valeur de ses actifs et de ses passifs en trois catégories, lesquelles se différencient en fonction de la nature des données, observables ou non, et de la portée de l'estimation requise.

Niveau 1 – Prix non rajustés cotés sur des marchés actifs pour des actifs ou passifs identiques;

Niveau 2 – Données autres que les prix cotés qui sont observables pour l'actif ou le passif, soit directement, soit indirectement. Les évaluations de niveau 2 comprennent, par exemple, des prix cotés pour des titres semblables, des prix cotés sur des marchés inactifs et provenant de courtiers en valeurs mobilières reconnus, ainsi que l'application à des prix cotés ailleurs qu'en Amérique du Nord de facteurs obtenus à partir de données observables dans le but d'estimer l'incidence que peuvent avoir les différentes heures de clôture des marchés.

Les instruments financiers classés au niveau 2 sont évalués en fonction des prix fournis par une entreprise d'évaluation indépendante et reconnue qui établit le prix des titres en se fondant sur les opérations récentes et sur les estimations obtenues des intervenants du marché, en incorporant des données de marché observables et en ayant recours à des pratiques standards sur les marchés. Les placements à court terme classés au niveau 2 sont évalués en fonction du coût amorti, majoré des intérêts courus, ce qui se rapproche de la juste valeur.

Les justes valeurs estimées pour ces titres pourraient être différentes des valeurs qui auraient été utilisées si un marché pour le placement avait existé; et

Niveau 3 – Données qui ne sont pas fondées sur des données de marché observables.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

NOTES ANNEXES

3. Principales méthodes comptables (suite)

b) Évaluation de la juste valeur (suite)

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 de la juste valeur du Fonds.

c) Comptabilisation des produits

Le revenu d'intérêts provenant des placements productifs d'intérêts est comptabilisé au moyen de la méthode du taux d'intérêt effectif. Les dividendes sont cumulés à compter de la date ex-dividende. Les profits ou les pertes latent(e)s sur les placements, les profits ou pertes réalisé(e)s à la vente de placements, lesquels comprennent les profits ou pertes de change sur ces placements, sont établis selon la méthode du coût moyen. Les distributions reçues d'un fonds sous-jacent sont comprises dans les revenus d'intérêts ou de dividendes, dans le profit (la perte) réalisé(e) à la vente de placements ou dans le revenu provenant des rabais sur les frais, selon le cas, à la date ex-dividende ou de distribution.

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

d) Commissions et autres coûts de transaction liés au portefeuille

Les commissions et autres coûts de transaction liés au portefeuille sont des charges engagées en vue d'acquérir, d'émettre ou de céder des actifs ou des passifs financiers. Ils comprennent les honoraires et les commissions versés aux agents, aux bourses, aux courtiers et 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 des services fournis par des tiers qui ont été payés par les courtiers 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 les espèces 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 la Banque Canadienne Impériale de Commerce et The Bank of New York Mellon. La valeur des espèces 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 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 déduire 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 acquisitions et les ventes de placements en devises ainsi que les dividendes, le revenu d'intérêts et les intérêts débiteurs en devises ont été 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 a été 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 au moyen de la division de 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.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

NOTES ANNEXES

3. Principales méthodes comptables (suite)

i) Valeur liquidative par titre

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

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

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

k) Fusions

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

l) Modifications comptables futures

Le Fonds a déterminé qu'aucune incidence importante sur ses états financiers ne découle des IFRS publiées mais non encore en vigueur.

4. Estimations et jugements comptables critiques

La préparation 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.

Les impacts continus et les problèmes affectant la chaîne d'approvisionnement causés par la pandémie de COVID-19, conjugués à la guerre persistante en Ukraine, ont provoqué des augmentations marquées de l'inflation et des taux d'intérêt à l'échelle de l'économie mondiale et plombé les marchés boursiers. On s'attend à ce que ces facteurs nuisent aux marchés boursiers mondiaux ainsi qu'au rendement du Fonds pour le reste de 2022 et le début de 2023.

Voici à la suite les estimations et les jugements comptables les plus importants utilisés pour la préparation des 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 méthodes 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 prix de 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 de ces instruments financiers détenus par le Fonds.

Utilisation de jugements

Classement et évaluation des placements et application de l'option de la juste valeur

Lors du classement et de l'évaluation des instruments financiers détenus par le Fonds, GPCV doit exercer des jugements importants afin de déterminer le classement le plus approprié selon IFRS 9. GPCV a évalué le modèle d'affaires 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 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 transactions, 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.

Entités structurées et entreprises associées

Afin de déterminer si un fonds de placement à capital variable non coté ou un fonds négocié en bourse dans lequel le Fonds investit, mais qu'il ne consolide pas, respecte la définition d'une entité structurée ou la définition d'une entreprise associée, GPCV doit exercer des jugements importants visant à établir si ces fonds sous-jacents possèdent les caractéristiques typiques d'une entité structurée ou d'une entreprise associée. GPCV a évalué les caractéristiques de ces fonds sous-jacents, et elle a conclu que ceux-ci ne respectent pas la définition d'une entité structurée ni la définition d'une entreprise associée, puisque le Fonds n'a conclu ni contrat ni entente de financement avec eux, et qu'il n'a pas la capacité d'influer sur leurs activités ni sur le rendement qu'il tire de ses placements dans ces fonds sous-jacents.

5. Impôts sur les bénéfices

Le Fonds est admissible à titre de fiduciaire de fonds commun de placement en vertu des dispositions de la *Loi de l'impôt sur le revenu (Canada)*. Par conséquent, il est assujéti à l'impôt pour ce qui est de ses bénéfices, 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. Le Fonds maintient la fin de l'exercice en décembre aux fins de l'impôt. Le Fonds entend distribuer la totalité de son bénéfice net et une partie suffisante du montant net des gains en capital réalisés de sorte à n'être assujéti à aucun impôt sur les bénéfices autre que les impôts étrangers retenus à la source, le cas échéant.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

NOTES ANNEXES

5. Impôts sur les bénéfices (suite)

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 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 du Fonds.

6. Frais de gestion et frais d'exploitation

GPCV a utilisé les 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.

GPCV verse des frais d'administration à Mackenzie pour des services d'administration quotidienne, y compris la communication de l'information financière, les communications avec les investisseurs et la communication de l'information aux porteurs de titres, la tenue des livres et des registres du Fonds, les calculs de la valeur liquidative et le traitement d'ordres en lien avec les titres des Fonds. De plus, Mackenzie paie tous les frais et charges (autres que certains frais précis associés au Fonds) requis pour l'exploitation du Fonds et qui ne sont pas compris dans les frais de gestion. Les frais d'administration sont calculés sur chaque série du Fonds en tant que pourcentage annuel fixe de la valeur liquidative quotidienne de la série.

Les autres frais associés au Fonds comprennent les impôts (y compris, mais sans s'y limiter, la TPS/TVH et l'impôt sur les bénéfices), les intérêts et les coûts d'emprunt, l'ensemble des frais et charges du Comité d'examen indépendant (« CEI ») des fonds GPCV, 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 entrés en vigueur après la date 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 du prospectus simplifié le plus récent.

GPCV peut renoncer aux frais de gestion et d'administration ou les absorber à son gré et supprimer la renonciation ou 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 2022 et 2021 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. GPCV gère le capital du Fonds conformément aux objectifs de placement décrits à la note 10.

8. Risques découlant des instruments financiers

i. Exposition au risque et gestion du risque

Les activités de placement du Fonds l'exposent à divers risques financiers, tels qu'ils sont définis dans IFRS 7, *Instruments financiers : Informations à fournir*. L'exposition du Fonds aux risques financiers est concentrée dans ses placements, lesquels sont présentés dans le tableau des placements au 30 septembre 2022, regroupés par type d'actif, région géographique et secteur.

GPCV 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, GPCV maintient également une structure de gouvernance, dont le rôle consiste à superviser les activités de placement du Fonds et à s'assurer de la conformité avec la stratégie de placement établie du Fonds, les directives internes et la réglementation des valeurs mobilières.

ii. Risque de liquidité

Le risque de liquidité est le risque que le Fonds éprouve des difficultés à respecter ses obligations financières au fur et à mesure que celles-ci deviennent exigibles. Le Fonds est exposé au risque de liquidité en raison des rachats potentiels quotidiens en espèces de titres rachetables. Pour surveiller la liquidité de ses actifs, le Fonds a recours à un programme de gestion du risque de liquidité permettant de calculer le nombre de jours nécessaires pour convertir les placements détenus par le Fonds en espèces au moyen d'une approche de liquidation sur plusieurs jours. Cette analyse du risque de liquidité évalue la liquidité du Fonds en fonction de pourcentages de liquidité minimale prédéterminés établis pour diverses périodes et est surveillée sur une base trimestrielle. En outre, le Fonds peut emprunter jusqu'à concurrence de 5 % de la valeur de son actif net pour financer ses rachats.

Pour se conformer à la réglementation sur les valeurs mobilières, le Fonds doit conserver au moins 85 % de son actif dans des placements liquides (c.-à-d. des placements pouvant être facilement vendus).

iii. Risque de change

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

NOTES ANNEXES

8. Risques découlant des instruments financiers (suite)

iii. Risque de change (suite)

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

La sensibilité du Fonds au risque de change présentée à la note 10 comprend l'incidence indirecte potentielle des fonds sous-jacents et des fonds négociés en bourse (« 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 et passifs financiers (y compris les dividendes et les intérêts à recevoir, ainsi que les sommes à recevoir ou à payer pour les placements vendus ou achetés) libellés en devises n'exposent pas le Fonds à un risque de change important.

iv. Risque de taux d'intérêt

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

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

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

v. Autre risque de prix

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

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

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

vi. Risque de crédit

Le risque de crédit est le risque qu'une contrepartie à un instrument financier ne s'acquitte pas d'une obligation ou d'un engagement pris envers le Fonds. La note 10 résume l'exposition du Fonds au risque de crédit, si une telle exposition s'applique et est considérable.

Si elles sont présentées, les notes de crédit et les catégories de crédit sont basées sur les notes d'une agence de notation désignée. L'exposition indirecte au risque de crédit peut provenir des titres à revenu fixe, tels que les obligations, détenus par des fonds sous-jacents ou des FNB, le cas échéant. La juste valeur des titres de créance tient compte de la solvabilité de l'émetteur de ces titres.

Afin de réduire la possibilité d'un défaut de règlement, la livraison des titres vendus se fait simultanément contre paiement, quand les pratiques du marché le permettent, au moyen d'un dépôt central ou d'une agence de compensation et de dépôt lorsque c'est la façon de procéder.

La valeur comptable des placements et des autres actifs représente l'exposition maximale au risque de crédit à la date de l'état de la situation financière. Le Fonds peut effectuer des opérations de prêt sur titres avec d'autres parties et peut aussi être exposé au risque de crédit découlant des contreparties aux instruments dérivés qu'il pourrait utiliser. Le risque de crédit associé à ces opérations est jugé minime puisque toutes les contreparties ont une cote de solvabilité équivalant à une note de crédit d'une agence de notation désignée d'au moins A-1 (faible) pour la dette à court terme ou de A pour la dette à long terme, selon le cas.

vii. Fonds sous-jacents

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

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

NOTES ANNEXES

9. Autres renseignements

Abréviations

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

Code de la devise	Description	Code de la devise	Description	Code de la devise	Description
AUD	Dollar australien	HKD	Dollar de Hong Kong	PKR	Roupie pakistanaise
AED	Dirham des Émirats arabes unis	HUF	Forint hongrois	PLN	Zloty polonais
BRL	Real brésilien	IDR	Rupiah indonésienne	QAR	Rial du Qatar
CAD	Dollar canadien	ILS	Shekel israélien	RON	Leu roumain
CHF	Franc suisse	INR	Roupie indienne	RUB	Rouble russe
CKZ	Couronne tchèque	JPY	Yen japonais	SAR	Riyal saoudien
CLP	Peso chilien	KOR	Won sud-coréen	SEK	Couronne suédoise
CNY	Yuan chinois	MXN	Peso mexicain	SGD	Dollar de Singapour
COP	Peso colombien	MYR	Ringgit malaisien	THB	Baht thaïlandais
CZK	Couronne tchèque	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		

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

NOTES ANNEXES

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

a) Constitution du Fonds, renseignements sur les séries et réorganisation

Date de constitution du Fonds prédécesseur : 30 novembre 2005

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

Le 17 septembre 2021, les porteurs de titres qui investissaient dans des titres des séries du Fonds de revenu stratégique Mackenzie (le « Fonds Mackenzie ») ayant été distribués par Services d'investissement Quadrus ltée (les séries de Canada Vie) ont vu leurs titres être remplacés par des titres de la série correspondante du Fonds. Le Fonds et le Fonds Mackenzie ont les mêmes objectifs et stratégies de placement, et les mêmes frais.

Cette réorganisation a fait l'objet d'une recommandation positive du comité d'examen indépendant des Fonds Mackenzie et a été approuvée par les investisseurs des séries de Canada Vie ainsi que par les organismes de réglementation des valeurs mobilières. Le 17 septembre 2021, 601 284 \$ ont été injectés dans le Fonds en raison de la réorganisation.

Les résultats d'exploitation, les variations de l'actif net et les flux de trésorerie pour la période du 1^{er} avril 2021 au 17 septembre 2021 pour l'année correspondante du Fonds reflètent la participation proportionnelle des séries de Canada Vie du Fonds Mackenzie.

Séries distribuées par Services d'investissement Quadrus ltée (255, avenue Dufferin, London (Ontario) N6A 4K1; 1-888-532-3322; www.placementscanadavie.com)

Les titres des séries A, T5 et T8 sont offerts aux investisseurs qui investissent un minimum de 500 \$. 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 des séries F, F5 et F8 sont offerts aux investisseurs qui investissent un minimum de 500 \$, qui participent à un programme de services rémunérés à l'acte ou de comptes intégrés parrainé par Quadrus et qui sont assujettis à des frais établis en fonction de l'actif. 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 N, N5 et N8 sont offerts aux investisseurs qui investissent un minimum de 500 \$, qui satisfont aux exigences de placement minimales de 500 000 \$ et qui ont conclu une entente avec GPCV et Quadrus en vue de la mise sur pied d'un compte de série N. Les investisseurs des séries N5 et N8 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % ou de 8 % par année, respectivement.

Les titres des séries QF et QF5 sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$. Les investisseurs doivent négocier leurs honoraires de service du conseiller, lesquels ne peuvent dépasser 1,25 %, avec leur conseiller financier. Les investisseurs de série QF5 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année.

Les titres des séries QFW et QFW5 sont offerts aux investisseurs à valeur nette élevée qui investissent un minimum de 500 \$ et qui satisfont aux exigences de placement minimales de 500 000 \$. Les investisseurs doivent négocier leurs honoraires de service du conseiller, lesquels ne peuvent dépasser 1,25 %, avec leur conseiller financier. Les investisseurs de série QFW5 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année.

Les titres de série R sont offerts exclusivement à d'autres fonds gérés par GPCV et non visés par un prospectus relativement à des ententes de fonds de fonds.

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

Les titres des séries W, W5 et W8 sont offerts aux investisseurs qui investissent un minimum de 500 \$ et qui satisfont aux exigences de placement minimales de 500 000 \$. Les investisseurs des séries W5 et W8 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % et de 8 % par année, respectivement.

Le 16 septembre 2022, les titres des séries FW, FW5 et FW8 ont été renommés titres de séries F, F5 et F8, respectivement.

Un investisseur dans le Fonds peut choisir parmi différents modes de souscription offerts au sein de chaque série. Ces modes de souscription comprennent le mode de souscription avec frais d'acquisition, le mode de souscription avec frais de rachat[†], le mode de souscription avec frais modérés[†] et le mode de souscription sans frais. Les frais du mode de souscription avec frais d'acquisition sont négociés entre l'investisseur et son courtier. Les frais du mode de souscription avec frais de rachat et avec frais modérés sont payables à CLIML si un investisseur procède au rachat de ses titres du Fonds au cours de périodes précises. Les séries du Fonds ne sont pas toutes offertes selon tous les modes de souscription, et les frais de chaque mode de souscription peuvent varier selon la série. Pour de plus amples renseignements sur ces modes de souscription, veuillez vous reporter au prospectus simplifié du Fonds et à l'aperçu du Fonds.

[†] Le mode de souscription avec frais de rachat et le mode de souscription avec frais modérés ne sont plus offerts, y compris dans le cadre de programmes de retraits systématiques comme les programmes de prélèvements automatiques. Les échanges de titres d'un Fonds Canada Vie achetés antérieurement selon le mode de souscription avec frais de rachat ou le mode de souscription avec frais modérés contre des titres d'un autre Fonds Canada Vie, selon le même mode d'acquisition, demeureront possibles.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

NOTES ANNEXES

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

a) Constitution du Fonds, renseignements sur les séries et réorganisation (suite)

Série	Date d'établissement/ de rétablissement ¹⁾	Frais de gestion	Frais d'administration
Série A	8 juillet 2013	1,85 %	0,21 %
Série F	16 juillet 2013	0,55 % ⁴⁾	0,15 %
Série F5	17 octobre 2014	0,55 % ⁴⁾	0,15 %
Série F8	16 août 2019	0,55 % ⁴⁾	0,15 %
Série FW	Aucun titre émis ⁵⁾	0,55 %	0,15 %
Série FW5	Aucun titre émis ⁶⁾	0,55 %	0,15 %
Série FW8	Aucun titre émis ⁷⁾	0,55 %	0,15 %
Série N	17 juillet 2013	— ²⁾	— ²⁾
Série N5	15 octobre 2014	— ²⁾	— ²⁾
Série N8	16 août 2019	— ²⁾	— ²⁾
Série QF	12 juillet 2016	0,85 %	0,21 %
Série QF5	12 juillet 2016	0,85 %	0,21 %
Série QFW	7 août 2018	0,55 %	0,15 %
Série QFW5	7 août 2018	0,55 %	0,15 %
Série R	25 avril 2022	s.o.	s.o.
Série S	16 août 2019	— ³⁾	0,025 %
Série T5	9 septembre 2013	1,85 %	0,21 %
Série T8	13 août 2019	1,85 %	0,21 %
Série W	22 août 2013	1,55 %	0,15 %
Série W5	1 ^{er} septembre 2015	1,55 %	0,15 %
Série W8	16 août 2019	1,55 %	0,15 %

1) Il s'agit de la date d'établissement des séries applicables du Fonds prédécesseur.

2) Ces frais sont négociables et sont payables directement à GPCV par les investisseurs dans cette série par l'entremise du rachat de leurs titres.

3) Ces frais sont négociables et sont payables directement à GPCV par les investisseurs dans cette série.

4) Avant le 22 juillet 2022, les frais de gestion pour les séries F, F5 et F8 étaient imputés au Fonds au taux de 0,85 %.

5) La date d'établissement initiale de la série est le 7 août 2018. Tous les titres de la série ont été renommés série F le 16 septembre 2022.

6) La date d'établissement initiale de la série est le 7 août 2018. Tous les titres de la série ont été renommés série F5 le 16 septembre 2022.

7) La date d'établissement initiale de la série est le 7 août 2018. Tous les titres de la série ont été renommés série F8 le 16 septembre 2022.

b) Reports prospectifs de pertes

À la fin de la dernière année d'imposition, aucune perte en capital ni autre qu'en capital n'était disponible pour un report prospectif aux fins de l'impôt.

c) Prêt de titres

	30 septembre 2022	31 mars 2022
	(\$)	(\$)
Valeur des titres prêtés	71 881	289
Valeur des biens reçus en garantie	76 125	304

	30 septembre 2022		30 septembre 2021	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
Revenus de prêts de titres bruts	48	100,0	3	100,0
Impôt retenu à la source	(1)	(2,1)	—	—
	47	97,9	3	100,0
Paiements à l'agent de prêt de titres	(10)	(20,8)	—	—
Revenu tiré du prêt de titres	37	77,1	3	100,0

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

NOTES ANNEXES

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

d) Commissions

	(\$)
30 septembre 2022	3
30 septembre 2021	–

e) Risques découlant des instruments financiers

i. Exposition au risque et gestion du risque

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

ii. Risque de change

Les tableaux ci-après résument l'exposition du Fonds au risque de change.

Devise	30 septembre 2022				Incidence sur l'actif net			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Renforcement de 5 %		Affaiblissement de 5 %	
					(\$)	%	(\$)	%
USD	708 267	19 813	(356 362)	371 718				
EUR	70 346	(3 915)	(9 714)	56 717				
CHF	23 412	–	–	23 412				
JPY	21 590	(441)	68	21 217				
GBP	10 403	–	–	10 403				
DKK	8 568	6	–	8 574				
HKD	8 424	17	–	8 441				
NTD	7 768	54	–	7 822				
SGD	4 861	–	–	4 861				
BRL	4 608	–	–	4 608				
SEK	3 035	–	–	3 035				
CNY	3 953	(2 969)	–	984				
AUD	3 079	–	(3 147)	(68)				
MXN	9 042	2	(9 129)	(85)				
Total	887 356	12 567	(378 284)	521 639				
% de l'actif net	45,9	0,7	(19,6)	27,0				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					(27 014)	(1,4)	27 014	1,4

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

NOTES ANNEXES

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

e) Risques découlant des instruments financiers (suite)

ii. Risque de change (suite)

Devise	31 mars 2022				Incidence sur l'actif net			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Renforcement de 5 %		Affaiblissement de 5 %	
					(\$)	%	(\$)	%
USD	209 410	1 759	(26 866)	184 303				
EUR	26 067	478	7 939	34 484				
CHF	10 209	–	–	10 209				
JPY	8 648	–	–	8 648				
DKK	3 562	3	–	3 565				
HKD	3 145	(35)	–	3 110				
NTD	2 264	7	–	2 271				
GBP	1 889	–	–	1 889				
BRL	1 719	–	–	1 719				
SEK	1 477	–	–	1 477				
CNY	712	–	–	712				
MXN	575	–	–	575				
RUB	53	–	–	53				
EGP	–	–	(737)	(737)				
PHP	–	–	(8 999)	(8 999)				
INR	–	–	(20 749)	(20 749)				
Total	269 730	2 212	(49 412)	222 530				
% de l'actif net	36,5	0,3	(6,7)	30,1				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					(15 132)	(2,0)	15 297	2,1

* Comprend les instruments financiers monétaires et non monétaires.

iii. Risque de taux d'intérêt

Les tableaux ci-après résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt découlant de ses placements dans des obligations et des instruments dérivés selon la durée jusqu'à l'échéance.

30 septembre 2022	Obligations (\$)	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
			Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
			(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	2 414	(465 565)				
1 an à 5 ans	114 079	–				
5 ans à 10 ans	319 637	–				
Plus de 10 ans	246 577	–				
Total	682 707	(465 565)				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt			(43 458)	(2,2)	43 516	2,3

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

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)

	Obligations (\$)	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
			Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
31 mars 2022			(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	669	(68 133)				
1 an à 5 ans	19 999	–				
5 ans à 10 ans	70 251	–				
Plus de 10 ans	40 874	–				
Total	131 793	(68 133)				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt			(15 168)	(2,1)	15 187	2,1

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 2022	94 977	4,9	(94 977)	(4,9)
31 mars 2022	36 754	5,0	(36 754)	(5,0)

v. Risque de crédit

Pour ce Fonds, la plus forte concentration du risque de crédit se trouve dans les titres de créance, tels que les obligations. La juste valeur des titres de créance tient compte de la solvabilité de l'émetteur de ces titres. L'exposition maximale à tout émetteur de titres de créance au 30 septembre 2022 était de 2,8 % de l'actif net du Fonds (3,6 % au 31 mars 2022).

Au 30 septembre 2022 et au 31 mars 2022, les titres de créance par note de crédit étaient les suivants :

Note des obligations*	30 septembre 2022	31 mars 2022
	% de l'actif net	% de l'actif net
AAA	4,1	2,0
AA	4,4	3,8
A	1,5	0,5
BBB	7,9	2,2
Inférieure à BBB	15,5	8,0
Sans note	1,9	1,3
Total	35,3	17,8

* Les notes de crédit et les catégories de crédit sont basées sur les notes d'une agence de notation désignée.

f) Classement de la juste valeur

Les tableaux ci-après résument la juste valeur des instruments financiers du Fonds selon la hiérarchie de la juste valeur décrite à la note 3.

	30 septembre 2022				31 mars 2022			
	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	–	682 707	–	682 707	–	131 740	53	131 793
Actions	786 598	149 326	–	935 924	300 718	56 003	–	356 721
Options	–	121	–	121	–	70	–	70
Fonds/billets négociés en bourse	149 118	–	–	149 118	53 180	–	–	53 180
Fonds communs de placement	130 827	–	–	130 827	155 296	–	–	155 296
Actifs dérivés	7 476	136	–	7 612	2 318	975	–	3 293
Passifs dérivés	–	(26 550)	–	(26 550)	–	(14)	–	(14)
Placements à court terme	–	28 748	–	28 748	–	102 182	–	102 182
Total	1 074 019	834 488	–	1 908 507	511 512	290 886	53	802 451

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

NOTES ANNEXES

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

f) Classement de la juste valeur (suite)

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

Au cours de la période close le 30 septembre 2022, les actions autres que nord-américaines étaient fréquemment transférées entre le niveau 1 (prix non rajustés cotés) et le niveau 2 (prix rajustés). Au 30 septembre 2022, ces titres étaient classés dans le niveau 2 (niveau 2 au 31 mars 2022).

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 2022 et le 31 mars 2022 :

	30 septembre 2022	31 mars 2022
	Actions (\$)	Actions (\$)
Solde, à l'ouverture	53	170
Achats	–	2 875
Ventes	(905)	(174)
Transferts entrants	–	–
Transferts sortants	–	–
Profits (pertes) au cours de la période :		
Réalisé(e)s	(1 970)	(1)
Latent(e)s	2 822	(2 817)
Solde, à la clôture	–	53
Variation des profits (pertes) latent(e)s au cours de la période attribuables aux titres détenus à la clôture de la période	–	(2 822)

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 la série 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 2022	31 mars 2022
	(\$)	(\$)
Gestionnaire	23	25
Autres fonds gérés par le gestionnaire	113 185	–
Fonds gérés par des sociétés affiliées au gestionnaire	1 445 513	315 962

h) Compensation d'actifs et de passifs financiers

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

	30 septembre 2022			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	7 494	(18)	–	7 476
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(2 248)	18	–	(2 230)
Obligation pour options vendues	(46)	–	–	(46)
Total	5 200	–	–	5 200
	31 mars 2022			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	2 636	–	–	2 636
Pertes latentes sur les contrats dérivés	–	–	–	–
Obligation pour options vendues	(14)	–	–	(14)
Total	2 622	–	–	2 622