

États financiers intermédiaires non audités

Pour la période de six mois close le 30 septembre 2021

Les présents États financiers intermédiaires non audités ne contiennent pas le Rapport intermédiaire de la direction sur le rendement du Fonds (« RDRF ») du fonds de placement. Vous pouvez obtenir un exemplaire du RDRF intermédiaire gratuitement en nous téléphonant au 1-888-532-3322, en nous écrivant au 255, avenue Dufferin, London (Ontario) N6A 4K1, en visitant notre site Web à l'adresse www.placementscanadavie.ca ou celui de SEDAR à l'adresse 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 de placement.

AVIS DE NON-AUDIT DES ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES

Gestion de placements Canada Vie limitée, le gestionnaire du Fonds, nomme des auditeurs indépendants pour auditer les états financiers annuels du Fonds. Conformément aux lois sur les valeurs mobilières du Canada (Norme canadienne 81-106), si un auditeur n'a pas revu les états financiers intermédiaires, cela doit être divulgué dans un avis complémentaire.

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

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

au (en milliers de dollars, sauf les montants par titre) (note 10)

| | 30 sept. 2021 \$ | 31 mars 2021 \$ | Actif net attribuable aux porteurs de titres (note 3) | | | | |
|---|------------------------|-----------------------|---|-----------------|------------------|-----------------|----------------|
| | | | par titre | | par série | | |
| | | | 30 sept. 2021 | 31 mars 2021 | 30 sept. 2021 | 31 mars 2021 | |
| ACTIF | | | | | | | |
| Actifs courants | | | | | | | |
| Placements à la juste valeur | 585 632 | 526 388 | Série A | 12,75 | 12,79 | 235 589 | 220 944 |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie | 5 852 | 12 748 | Série F | 12,56 | 12,59 | 10 332 | 9 104 |
| Intérêts courus à recevoir | 182 | 1 866 | Série F5 | 15,17 | 15,48 | 206 | 152 |
| Dividendes à recevoir | 576 | 436 | Série F8 | 14,17 | 14,67 | 72 | 72 |
| Sommes à recevoir pour placements vendus | 7 840 | 1 579 | Série FW | 10,85 | 10,88 | 8 299 | 6 619 |
| Sommes à recevoir pour titres émis | 771 | 510 | Série FW5 | 15,05 | 15,33 | 295 | 292 |
| Sommes à recevoir du gestionnaire | 18 | 23 | Série FW8 | 14,30 | 14,79 | 1 | 1 |
| Marge sur instruments dérivés | – | 939 | Série N | 12,84 | 12,86 | 51 901 | 44 119 |
| Profits latents sur les contrats dérivés | – | 1 172 | Série N5 | 16,39 | 16,67 | 1 398 | 1 366 |
| Impôt à recouvrer | 24 | – | Série N8 | 14,46 | 14,92 | 169 | 205 |
| Total de l'actif | 600 895 | 545 661 | Série QF | 11,83 | 11,86 | 10 481 | 10 138 |
| | | | Série QF5 | 15,40 | 15,72 | 265 | 353 |
| | | | Série QFW | 10,86 | 10,88 | 4 630 | 3 945 |
| | | | Série QFW5 | 15,07 | 15,35 | 29 | 2 |
| PASSIF | | | Série S | 10,80 | 10,86 | 168 902 | 150 789 |
| Passifs courants | | | Série T5 | 14,46 | 14,81 | 2 237 | 1 755 |
| Sommes à payer pour placements achetés | 5 503 | 8 395 | Série T8 | 13,85 | 14,41 | 1 492 | 1 619 |
| Sommes à payer pour titres rachetés | 391 | 413 | Série W | 12,79 | 12,82 | 92 635 | 79 289 |
| Sommes à payer au gestionnaire | 20 | 24 | Série W5 | 15,12 | 15,46 | 4 942 | 4 394 |
| Obligation pour options vendues | – | 29 | Série W8 | 13,95 | 14,49 | 1 106 | 1 078 |
| Pertes latentes sur les contrats dérivés | – | 564 | | | | | |
| Total du passif | 5 914 | 9 425 | | | | 594 981 | 536 236 |
| Actif net attribuable aux porteurs de titres | 594 981 | 536 236 | | | | | |

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

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

| | 2021 | 2020 |
|---|---------------|---------------|
| | \$ | \$ |
| Revenus | | |
| Dividendes | 4 414 | 5 518 |
| Revenu d'intérêts | 4 477 | 4 035 |
| Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets | | |
| Profit (perte) net(te) réalisé(e) | 86 282 | (2 801) |
| Profit (perte) net(te) latent(e) | (67 618) | 51 983 |
| Revenu tiré du prêt de titres | 3 | 28 |
| Revenu provenant des rabais sur les frais | 135 | 118 |
| Total des revenus (pertes) | 27 693 | 58 881 |
| Charges (note 6) | | |
| Frais de gestion | 3 328 | 2 962 |
| Rabais sur les frais de gestion | (58) | (49) |
| Frais d'administration | 403 | 356 |
| Intérêts débiteurs | 5 | 2 |
| Commissions et autres coûts de transaction liés au portefeuille | 133 | 3 |
| Frais du comité d'examen indépendant | – | 1 |
| Autre | – | 1 |
| Charges avant les montants absorbés par le gestionnaire | 3 811 | 3 276 |
| Charges absorbées par le gestionnaire | – | – |
| Charges nettes | 3 811 | 3 276 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, avant impôt | 23 882 | 55 605 |
| Impôt étranger retenu à la source | 177 | 193 |
| Impôt étranger sur le résultat payé (recouvré) | 57 | – |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation | 23 648 | 55 412 |

Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation (note 3)

| | par titre | | par série | |
|------------|-----------|------|---------------|---------------|
| | 2021 | 2020 | 2021 | 2020 |
| Série A | 0,48 | 1,28 | 8 533 | 23 182 |
| Série F | 0,55 | 1,32 | 434 | 1 007 |
| Série F5 | 0,68 | 1,60 | 8 | 16 |
| Série F8 | 0,61 | 1,62 | 3 | – |
| Série FW | 0,46 | 1,13 | 300 | 573 |
| Série FW5 | 0,68 | 1,67 | 13 | 32 |
| Série FW8 | – | 1,65 | – | – |
| Série N | 0,62 | 1,40 | 2 269 | 4 384 |
| Série N5 | 0,81 | 1,87 | 67 | 169 |
| Série N8 | 0,75 | 1,64 | 9 | 16 |
| Série QF | 0,52 | 1,25 | 460 | 1 010 |
| Série QF5 | 0,66 | 1,67 | 12 | 32 |
| Série QFW | 0,48 | 1,14 | 189 | 337 |
| Série QFW5 | – | 1,66 | – | – |
| Série S | 0,53 | 1,18 | 7 700 | 15 958 |
| Série T5 | 0,53 | 1,53 | 72 | 150 |
| Série T8 | 0,57 | 1,53 | 61 | 204 |
| Série W | 0,50 | 1,29 | 3 309 | 7 901 |
| Série W5 | 0,59 | 1,60 | 166 | 331 |
| Série W8 | 0,56 | 1,54 | 43 | 110 |
| | | | 23 648 | 55 412 |

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE LA SITUATION FINANCIÈRE

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

| | 2021 | 2020 | 2021 | 2020 | 2021 | 2020 | 2021 | 2020 | 2021 | 2020 |
|--|----------------|----------------|---------------|--------------|------------|------------|-----------|----------|--------------|--------------|
| | Série A | | Série F | | Série F5 | | Série F8 | | Série FW | |
| | \$ | | \$ | | \$ | | \$ | | \$ | |
| ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES | | | | | | | | | | |
| À l'ouverture | 220 944 | 197 797 | 9 104 | 7 922 | 152 | 102 | 72 | 1 | 6 619 | 4 573 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation | 8 533 | 23 182 | 434 | 1 007 | 8 | 16 | 3 | – | 300 | 573 |
| Distributions aux porteurs de titres : | | | | | | | | | | |
| Revenu de placement | (1 920) | (1 815) | (120) | (129) | (3) | (2) | (1) | – | (91) | (84) |
| Gains en capital | (7 247) | – | (353) | – | (7) | – | (2) | – | (252) | – |
| Remboursement de capital | – | – | – | – | (3) | (2) | (2) | – | – | – |
| Rabais sur les frais de gestion | (50) | (42) | (4) | (4) | – | – | – | – | – | – |
| Total des distributions aux porteurs de titres | (9 217) | (1 857) | (477) | (133) | (13) | (4) | (5) | – | (343) | (84) |
| Opérations sur les titres : | | | | | | | | | | |
| Produit de l'émission de titres | 31 975 | 15 057 | 2 812 | 1 478 | 50 | 32 | – | – | 1 726 | 719 |
| Réinvestissement des distributions | 9 217 | 1 856 | 477 | 133 | 9 | 2 | 3 | – | 343 | 84 |
| Paiements au rachat de titres | (25 863) | (26 723) | (2 018) | (1 215) | – | – | (1) | – | (346) | (214) |
| Total des opérations sur les titres | 15 329 | (9 810) | 1 271 | 396 | 59 | 34 | 2 | – | 1 723 | 589 |
| Augmentation (diminution) totale de l'actif net | 14 645 | 11 515 | 1 228 | 1 270 | 54 | 46 | – | – | 1 680 | 1 078 |
| À la clôture | 235 589 | 209 312 | 10 332 | 9 192 | 206 | 148 | 72 | 1 | 8 299 | 5 651 |

Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) :

| | Titres | | Titres | | Titres | | Titres | | Titres | |
|---|---------------|---------------|------------|------------|-----------|-----------|----------|----------|------------|------------|
| Titres en circulation, à l'ouverture | 17 278 | 18 354 | 723 | 747 | 10 | 8 | 5 | – | 608 | 500 |
| Émis | 2 617 | 1 293 | 238 | 130 | 4 | 2 | – | – | 200 | 70 |
| Réinvestissement des distributions | 719 | 158 | 23 | 11 | – | – | – | – | 17 | 8 |
| Rachetés | (2 136) | (2 280) | (161) | (106) | – | – | – | – | (60) | (21) |
| Titres en circulation, à la clôture | 18 478 | 17 525 | 823 | 782 | 14 | 10 | 5 | – | 765 | 557 |

| | Série FW5 | | Série FW8 | | Série N | | Série N5 | | Série N8 | |
|--|------------|------------|-----------|----------|---------------|---------------|--------------|--------------|-------------|------------|
| | \$ | | \$ | | \$ | | \$ | | \$ | |
| ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES | | | | | | | | | | |
| À l'ouverture | 292 | 262 | 1 | 1 | 44 119 | 33 302 | 1 366 | 1 303 | 205 | 125 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation | 13 | 32 | – | – | 2 269 | 4 384 | 67 | 169 | 9 | 16 |
| Distributions aux porteurs de titres : | | | | | | | | | | |
| Revenu de placement | (5) | (4) | – | – | (706) | (733) | (26) | (27) | (3) | (3) |
| Gains en capital | (10) | – | – | – | (1 733) | – | (49) | – | (6) | – |
| Remboursement de capital | (4) | (3) | – | – | – | – | (16) | (9) | (5) | (3) |
| Rabais sur les frais de gestion | – | – | – | – | – | – | – | – | – | – |
| Total des distributions aux porteurs de titres | (19) | (7) | – | – | (2 439) | (733) | (91) | (36) | (14) | (6) |
| Opérations sur les titres : | | | | | | | | | | |
| Produit de l'émission de titres | – | – | – | – | 7 801 | 5 135 | (4) | 20 | – | 60 |
| Réinvestissement des distributions | 12 | – | – | – | 2 439 | 733 | 72 | 19 | 8 | 1 |
| Paiements au rachat de titres | (3) | (3) | – | – | (2 288) | (4 575) | (12) | (246) | (39) | (1) |
| Total des opérations sur les titres | 9 | (3) | – | – | 7 952 | 1 293 | 56 | (207) | (31) | 60 |
| Augmentation (diminution) totale de l'actif net | 3 | 22 | – | – | 7 782 | 4 944 | 32 | (74) | (36) | 70 |
| À la clôture | 295 | 284 | 1 | 1 | 51 901 | 38 246 | 1 398 | 1 229 | 169 | 195 |

Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) :

| | Titres | | Titres | | Titres | | Titres | | Titres | |
|---|-----------|-----------|----------|----------|--------------|--------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Titres en circulation, à l'ouverture | 19 | 20 | – | – | 3 430 | 3 080 | 82 | 91 | 14 | 9 |
| Émis | 1 | – | – | – | 676 | 444 | – | 2 | 1 | 5 |
| Réinvestissement des distributions | – | – | – | – | 125 | 62 | 3 | 1 | – | – |
| Rachetés | – | – | – | – | (187) | (396) | – | (16) | (3) | – |
| Titres en circulation, à la clôture | 20 | 20 | – | – | 4 044 | 3 190 | 85 | 78 | 12 | 14 |

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

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

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

| | 2021 | 2020 | 2021 | 2020 | 2021 | 2020 | 2021 | 2020 |
|---|---------------|--------------|-------------|------------|--------------|--------------|------------|----------|
| | Série QF | | Série QF5 | | Série QFW | | Série QFW5 | |
| | \$ | | \$ | | \$ | | \$ | |
| ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES | | | | | | | | |
| À l'ouverture | 10 138 | 8 268 | 353 | 259 | 3 945 | 2 667 | 2 | 2 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation | 460 | 1 010 | 12 | 32 | 189 | 337 | – | – |
| Distributions aux porteurs de titres : | | | | | | | | |
| Revenu de placement | (125) | (125) | (4) | (4) | (55) | (46) | – | – |
| Gains en capital | (364) | – | (9) | – | (153) | – | (1) | – |
| Remboursement de capital | – | – | (4) | (3) | – | – | – | – |
| Rabais sur les frais de gestion | (3) | (2) | – | – | – | – | – | – |
| Total des distributions aux porteurs de titres | (492) | (127) | (17) | (7) | (208) | (46) | (1) | – |
| Opérations sur les titres : | | | | | | | | |
| Produit de l'émission de titres | 1 657 | 944 | 1 | 1 | 860 | 253 | 27 | – |
| Réinvestissement des distributions | 492 | 127 | 17 | 7 | 207 | 46 | 1 | – |
| Paiements au rachat de titres | (1 774) | (1 460) | (101) | (1) | (363) | (197) | – | – |
| Total des opérations sur les titres | 375 | (389) | (83) | 7 | 704 | 102 | 28 | – |
| Augmentation (diminution) totale de l'actif net | 343 | 494 | (88) | 32 | 685 | 393 | 27 | – |
| À la clôture | 10 481 | 8 762 | 265 | 291 | 4 630 | 3 060 | 29 | 2 |

| Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) : | Titres | | Titres | | Titres | | Titres | |
|--|------------|------------|-----------|-----------|------------|------------|----------|----------|
| Titres en circulation, à l'ouverture | 854 | 828 | 22 | 19 | 363 | 291 | – | – |
| Émis | 164 | 86 | – | – | 144 | 25 | 2 | – |
| Réinvestissement des distributions | 23 | 12 | 1 | 1 | 10 | 5 | – | – |
| Rachetés | (155) | (135) | (6) | – | (91) | (20) | – | – |
| Titres en circulation, à la clôture | 886 | 791 | 17 | 20 | 426 | 301 | 2 | – |

| | Série S | | Série T5 | | Série T8 | | Série W | |
|---|----------------|----------------|--------------|--------------|--------------|--------------|---------------|---------------|
| | \$ | | \$ | | \$ | | \$ | |
| ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES | | | | | | | | |
| À l'ouverture | 150 789 | 122 398 | 1 755 | 1 286 | 1 619 | 1 742 | 79 289 | 66 598 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation | 7 700 | 15 958 | 72 | 150 | 61 | 204 | 3 309 | 7 901 |
| Distributions aux porteurs de titres : | | | | | | | | |
| Revenu de placement | (2 988) | (2 579) | (21) | (12) | (15) | (16) | (823) | (747) |
| Gains en capital | (5 720) | – | (63) | – | (48) | – | (2 888) | – |
| Remboursement de capital | – | – | (40) | (24) | (54) | (63) | – | – |
| Rabais sur les frais de gestion | – | – | – | – | (1) | (1) | – | – |
| Total des distributions aux porteurs de titres | (8 708) | (2 579) | (124) | (36) | (118) | (80) | (3 711) | (747) |
| Opérations sur les titres : | | | | | | | | |
| Produit de l'émission de titres | 19 074 | 5 949 | 497 | 62 | 210 | 3 | 15 097 | 5 548 |
| Réinvestissement des distributions | 8 707 | 2 579 | 109 | 24 | 88 | 43 | 3 711 | 746 |
| Paiements au rachat de titres | (8 660) | (6 802) | (72) | (120) | (368) | (126) | (5 060) | (6 107) |
| Total des opérations sur les titres | 19 121 | 1 726 | 534 | (34) | (70) | (80) | 13 748 | 187 |
| Augmentation (diminution) totale de l'actif net | 18 113 | 15 105 | 482 | 80 | (127) | 44 | 13 346 | 7 341 |
| À la clôture | 168 902 | 137 503 | 2 237 | 1 366 | 1 492 | 1 786 | 92 635 | 73 939 |

| Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) : | Titres | | Titres | | Titres | | Titres | |
|--|---------------|---------------|------------|-----------|------------|------------|--------------|--------------|
| Titres en circulation, à l'ouverture | 13 887 | 13 409 | 119 | 99 | 112 | 134 | 6 183 | 6 167 |
| Émis | 1 734 | 606 | 37 | 5 | 15 | – | 1 378 | 471 |
| Réinvestissement des distributions | 798 | 262 | 4 | 2 | 6 | 3 | 129 | 63 |
| Rachetés | (786) | (691) | (5) | (9) | (25) | (9) | (448) | (525) |
| Titres en circulation, à la clôture | 15 633 | 13 586 | 155 | 97 | 108 | 128 | 7 242 | 6 176 |

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

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

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

| | 2021 | 2020 | 2021 | 2020 | 2021 | 2020 |
|---|---------------|---------------|---------------|---------------|----------------|----------------|
| | Série W5 | | Série W8 | | Total | |
| | \$ | | \$ | | \$ | |
| ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES | | | | | | |
| À l'ouverture | 4 394 | 2 726 | 1 078 | 917 | 536 236 | 452 251 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation | 166 | 331 | 43 | 110 | 23 648 | 55 412 |
| Distributions aux porteurs de titres : | | | | | | |
| Revenu de placement | (50) | (32) | (12) | (10) | (6 968) | (6 368) |
| Gains en capital | (135) | – | (36) | – | (19 076) | – |
| Remboursement de capital | (82) | (48) | (37) | (33) | (247) | (188) |
| Rabais sur les frais de gestion | – | – | – | – | (58) | (49) |
| Total des distributions aux porteurs de titres | (267) | (80) | (85) | (43) | (26 349) | (6 605) |
| Opérations sur les titres : | | | | | | |
| Produit de l'émission de titres | 917 | 268 | – | 4 | 82 700 | 35 533 |
| Réinvestissement des distributions | 207 | 29 | 76 | 33 | 26 195 | 6 462 |
| Paiements au rachat de titres | (475) | (253) | (6) | (3) | (47 449) | (48 046) |
| Total des opérations sur les titres | 649 | 44 | 70 | 34 | 61 446 | (6 051) |
| Augmentation (diminution) totale de l'actif net | 548 | 295 | 28 | 101 | 58 745 | 42 756 |
| À la clôture | 4 942 | 3 021 | 1 106 | 1 018 | 594 981 | 495 007 |
| Augmentation (diminution) des titres du Fonds (note 7) : | Titres | Titres | Titres | Titres | | |
| Titres en circulation, à l'ouverture | 284 | 202 | 74 | 70 | | |
| Émis | 67 | 18 | – | – | | |
| Réinvestissement des distributions | 6 | 2 | 5 | 3 | | |
| Rachetés | (30) | (17) | – | – | | |
| Titres en circulation, à la clôture | 327 | 205 | 79 | 73 | | |

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

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

| | 2021 | 2020 |
|---|-----------------|-----------------|
| | \$ | \$ |
| 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 | 23 648 | 55 412 |
| Ajustements pour : | | |
| Perte (profit) net(te) réalisé(e) sur les placements | (86 282) | 2 801 |
| Variation de la perte (du profit) net(te) latent(e) sur les placements | 67 618 | (51 983) |
| Achat de placements | (236 101) | (110 858) |
| Produit de la vente et de l'échéance de placements | 186 948 | 92 828 |
| Variation des intérêts courus à recevoir | 1 684 | (68) |
| Variation des dividendes à recevoir | (140) | (69) |
| Variation des sommes à recevoir du gestionnaire | 5 | – |
| Variation de la marge sur instruments dérivés | 939 | 404 |
| Variation de l'impôt à recouvrer | (24) | – |
| Variation des sommes à payer au gestionnaire | (4) | 2 |
| Trésorerie nette liée aux activités d'exploitation | (41 709) | (11 531) |

Flux de trésorerie liés aux activités de financement

| | | |
|--|---------------|-----------------|
| Produit de l'émission de titres | 82 439 | 35 555 |
| Paiements au rachat de titres | (47 471) | (48 359) |
| Distributions versées, déduction faite des réinvestissements | (154) | (143) |
| Trésorerie nette liée aux activités de financement | 34 814 | (12 947) |

Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie

| | | |
|--|--------------|------------|
| Trésorerie et équivalents de trésorerie, à l'ouverture | 12 748 | 24 754 |
| Incidence des fluctuations des taux de change sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie | (1) | 487 |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture | 5 852 | 763 |

| | | |
|--|--------------|------------|
| Trésorerie | – | 470 |
| Équivalents de trésorerie | 6 616 | 293 |
| Dette bancaire | (764) | |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture | 5 852 | 763 |

Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :

| | | |
|------------------------|-------|-------|
| Dividendes reçus | 4 274 | 5 449 |
| Impôts étrangers payés | 234 | 193 |
| Intérêts reçus | 6 161 | 4 035 |
| Intérêts versés | 5 | 2 |

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

TABLEAU DES PLACEMENTS

Au 30 septembre 2021

| | Pays | Secteur | Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts | Coût moyen \$ (en milliers) | Juste valeur \$ (en milliers) |
|---|------------|------------------------------|---|--------------------------------|----------------------------------|
| OBLIGATIONS | | | | | |
| ARC Falcon I Inc., prêt à terme à prélèvement différé de premier rang, taux variable 22-09-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 11 338 USD | 14 | 14 |
| ARC Falcon I Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 22-09-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 77 662 USD | 99 | 98 |
| ARC Falcon I Inc., prêt à terme de second rang, taux variable 22-09-2029 | États-Unis | Prêts à terme | 64 000 USD | 81 | 81 |
| Azurity Pharmaceuticals Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 20-09-2027 | États-Unis | Prêts à terme | 310 000 USD | 381 | 381 |
| Becle SAB de CV 2,50 % 14-10-2031 | Mexique | Sociétés – Non convertibles | 361 000 USD | 452 | 452 |
| Carriage Purchaser Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 23-09-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 45 000 USD | 57 | 57 |
| Carriage Purchaser Inc. 7,88 % 15-10-2029 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 80 000 USD | 101 | 101 |
| Clearway Energy LLC 3,75 % 15-01-2032 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 60 000 USD | 76 | 76 |
| ConnectWise LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 24-09-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 75 000 USD | 94 | 94 |
| Creation Technologies Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 24-09-2028 | Canada | Prêts à terme | 106 000 USD | 132 | 133 |
| GOL Linhas aéreas inteligentes SA 8,00 % 30-06-2026 144A | Brésil | Sociétés – Non convertibles | 200 000 USD | 255 | 254 |
| Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2029 | Brésil | Gouvernements étrangers | 500 000 BRL | 1 152 | 1 111 |
| Gouvernement de la Chine 1,99 % 09-04-2025 | Chine | Gouvernements étrangers | 36 000 000 CNY | 6 963 | 6 910 |
| Gouvernement de la Chine 3,13 % 21-11-2029 | Chine | Gouvernements étrangers | 32 600 000 CNY | 6 559 | 6 495 |
| Mozart Borrower LP, prêt à terme B de premier rang, taux variable 30-09-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 782 000 USD | 985 | 985 |
| Mozart Debt Merger Sub Inc. 3,88 % 01-04-2029 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 1 192 000 USD | 1 509 | 1 509 |
| Mozart Debt Merger Sub Inc. 5,25 % 01-10-2029 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 378 000 USD | 479 | 479 |
| NorthStar Group Services Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 12-11-2026 | États-Unis | Prêts à terme | 204 000 USD | 259 | 253 |
| Province de l'Ontario 1,90 % 02-12-2051 | Canada | Gouvernements provinciaux | 30 000 | 25 | 25 |
| Province de Québec 3,10 % 01-12-2051 | Canada | Gouvernements provinciaux | 98 000 | 107 | 105 |
| Secure Energy Services Inc. 7,25 % 30-12-2026 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 420 000 | 423 | 425 |
| TopBuild Corp. 4,13 % 15-02-2032 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 100 000 USD | 127 | 128 |
| La Banque Toronto-Dominion, taux variable 22-04-2030, rachetables 2025 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 66 000 | 69 | 69 |
| TransCanada PipeLines Ltd. 4,18 % 03-07-2048, rachetables 2048 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 30 000 | 30 | 30 |
| Total des obligations | | | | 20 429 | 20 265 |
| ACTIONS | | | | | |
| AbbVie Inc. | États-Unis | Soins de santé | 12 101 | 1 661 | 1 652 |
| Mines Agnico Eagle Ltée | Canada | Matériaux | 38 974 | 2 592 | 2 561 |
| AIA Group Ltd. | Hong Kong | Services financiers | 93 402 | 1 345 | 1 361 |
| Air Liquide SA | France | Matériaux | 10 038 | 2 161 | 2 033 |
| Algonquin Power & Utilities Corp. | Canada | Services publics | 63 552 | 1 241 | 1 180 |
| Alibaba Group Holding Ltd., CAAE | Chine | Consommation discrétionnaire | 7 490 | 1 436 | 1 404 |
| Alimentation Couche-Tard inc., cat. B, à droit de vote subalterne | Canada | Consommation de base | 36 779 | 1 780 | 1 782 |
| Fonds de placement immobilier Allied | Canada | Biens immobiliers | 16 817 | 693 | 676 |
| Alphabet Inc., cat. A | États-Unis | Services de communication | 1 294 | 4 644 | 4 379 |
| Altria Group Inc. | États-Unis | Consommation de base | 22 991 | 1 424 | 1 325 |
| Amadeus IT Group SA | Espagne | Technologie de l'information | 19 297 | 1 524 | 1 605 |
| Amazon.com Inc. | États-Unis | Consommation discrétionnaire | 954 | 4 209 | 3 967 |
| Aon PLC | Irlande | Services financiers | 6 325 | 2 331 | 2 288 |

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2021

| | Pays | Secteur | Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts | Coût moyen \$ (en milliers) | Juste valeur \$ (en milliers) |
|---|-------------|------------------------------|---|--------------------------------|----------------------------------|
| ACTIONS (suite) | | | | | |
| Apple Inc. | États-Unis | Technologie de l'information | 19 002 | 3 537 | 3 404 |
| ARC Resources Ltd. | Canada | Énergie | 145 815 | 1 463 | 1 731 |
| Atlas Copco AB, A | Suède | Produits industriels | 18 286 | 1 601 | 1 403 |
| Banque de Montréal | Canada | Services financiers | 37 596 | 4 803 | 4 754 |
| La Banque de Nouvelle-Écosse | Canada | Services financiers | 91 597 | 7 158 | 7 141 |
| Société aurifère Barrick | Canada | Matériaux | 85 604 | 1 983 | 1 958 |
| BCE Inc. | Canada | Services de communication | 9 979 | 645 | 633 |
| Becton, Dickinson and Co. | États-Unis | Soins de santé | 9 261 | 3 091 | 2 882 |
| The Blackstone Group Inc., cat. A | États-Unis | Services financiers | 21 638 | 3 685 | 3 187 |
| Boralex inc., cat. A | Canada | Services publics | 18 028 | 706 | 674 |
| Broadcom Inc. | États-Unis | Technologie de l'information | 4 589 | 2 959 | 2 817 |
| Brookfield Asset Management Inc., cat. A (\$ CA) | Canada | Services financiers | 59 044 | 4 067 | 4 007 |
| Brookfield Asset Management Reinsurance Partners Ltd. | Canada | Services financiers | 451 | 32 | 32 |
| CAE Inc. | Canada | Produits industriels | 54 897 | 2 014 | 2 077 |
| Calfrac Well Services Ltd. | Canada | Énergie | 6 770 | 23 | 23 |
| Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada | Canada | Produits industriels | 36 043 | 5 418 | 5 290 |
| Canadian Natural Resources Ltd. | Canada | Énergie | 47 064 | 2 001 | 2 180 |
| Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée | Canada | Produits industriels | 62 535 | 5 338 | 5 172 |
| Canadian Utilities Ltd., cat. A, sans droit de vote | Canada | Services publics | 48 768 | 1 689 | 1 664 |
| Cargojet Inc. | Canada | Produits industriels | 1 873 | 357 | 379 |
| CCL Industries Inc., cat. B, sans droit de vote | Canada | Matériaux | 27 267 | 1 912 | 1 789 |
| Groupe CGI inc. | Canada | Technologie de l'information | 15 383 | 1 726 | 1 655 |
| Chevron Corp. | États-Unis | Énergie | 17 707 | 2 183 | 2 274 |
| Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix | Canada | Biens immobiliers | 62 748 | 935 | 894 |
| CME Group Inc. | États-Unis | Services financiers | 7 522 | 1 808 | 1 841 |
| Cogeco Communications inc. | Canada | Services de communication | 9 914 | 1 133 | 1 116 |
| Corteva Inc. | États-Unis | Matériaux | 29 902 | 1 595 | 1 593 |
| Deutsche Börse AG | Allemagne | Services financiers | 12 480 | 2 614 | 2 572 |
| Diageo PLC | Royaume-Uni | Consommation de base | 24 007 | 1 452 | 1 465 |
| Dollarama inc. | Canada | Consommation discrétionnaire | 40 763 | 2 281 | 2 240 |
| Emera Inc. | Canada | Services publics | 32 930 | 1 924 | 1 889 |
| Emerson Electric Co. | États-Unis | Produits industriels | 16 770 | 2 061 | 2 000 |
| Enbridge Inc. | Canada | Énergie | 90 375 | 4 578 | 4 560 |
| Equifax Inc. | États-Unis | Produits industriels | 8 071 | 2 761 | 2 589 |
| Eurofins Scientific | France | Soins de santé | 16 319 | 3 063 | 2 649 |
| Facebook Inc. | États-Unis | Services de communication | 6 651 | 3 091 | 2 858 |
| Finning International Inc. | Canada | Produits industriels | 27 410 | 865 | 857 |
| Fonds de placement immobilier First Capital | Canada | Biens immobiliers | 54 729 | 993 | 958 |
| Fortis Inc. | Canada | Services publics | 25 748 | 1 480 | 1 447 |
| George Weston Itée | Canada | Consommation de base | 6 573 | 867 | 898 |
| Heineken Holding NV, A | Pays-Bas | Consommation de base | 11 769 | 1 329 | 1 295 |
| Honeywell International Inc. | États-Unis | Produits industriels | 8 538 | 2 379 | 2 297 |
| Intact Corporation financière | Canada | Services financiers | 34 495 | 5 905 | 5 777 |
| Japan Exchange Group Inc. | Japon | Services financiers | 55 110 | 1 901 | 1 731 |
| Johnson & Johnson | États-Unis | Soins de santé | 12 654 | 2 657 | 2 587 |
| JPMorgan Chase & Co. | États-Unis | Services financiers | 25 754 | 5 175 | 5 337 |
| Keyence Corp. | Japon | Technologie de l'information | 2 508 | 2 120 | 1 902 |
| Koninklijke Philips NV | Pays-Bas | Soins de santé | 23 833 | 1 426 | 1 337 |
| Linde PLC | Irlande | Matériaux | 4 257 | 1 678 | 1 581 |
| Les Compagnies Loblaw Itée | Canada | Consommation de base | 8 631 | 739 | 750 |
| Lockheed Martin Corp. | États-Unis | Produits industriels | 4 141 | 1 799 | 1 809 |

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2021

| | Pays | Secteur | Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts | Coût moyen \$ (en milliers) | Juste valeur \$ (en milliers) |
|--|------------|------------------------------|--|-----------------------------------|----------------------------------|
| ACTIONS (suite) | | | | | |
| LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE | France | Consommation discrétionnaire | 2 114 | 1 992 | 1 914 |
| Société Financière Manuvie | Canada | Services financiers | 197 193 | 4 828 | 4 808 |
| McDonald's Corp. | États-Unis | Consommation discrétionnaire | 4 574 | 1 413 | 1 396 |
| Medtronic PLC | États-Unis | Soins de santé | 11 809 | 1 952 | 1 874 |
| Microsoft Corp. | États-Unis | Technologie de l'information | 15 735 | 6 013 | 5 616 |
| Moody's Corp. | États-Unis | Services financiers | 2 805 | 1 323 | 1 261 |
| Motorola Solutions Inc. | États-Unis | Technologie de l'information | 5 777 | 1 748 | 1 699 |
| Nestlé SA, nom. | Suisse | Consommation de base | 20 059 | 3 138 | 3 054 |
| Nike Inc., cat. B | États-Unis | Consommation discrétionnaire | 6 124 | 1 221 | 1 126 |
| Novo Nordisk AS, B | Danemark | Soins de santé | 20 656 | 2 670 | 2 515 |
| Nutrien Ltd. | Canada | Matériaux | 51 904 | 4 176 | 4 267 |
| Open Text Corp. | Canada | Technologie de l'information | 89 182 | 5 818 | 5 513 |
| Otsuka Corp. | Japon | Technologie de l'information | 19 678 | 1 371 | 1 280 |
| Corporation Pétroles Parkland | Canada | Énergie | 23 600 | 840 | 840 |
| Pembina Pipeline Corp. | Canada | Énergie | 40 699 | 1 623 | 1 634 |
| PepsiCo Inc. | États-Unis | Consommation de base | 7 029 | 1 381 | 1 338 |
| ¹ Pernod Ricard SA | France | Consommation de base | 3 775 | 1 043 | 1 045 |
| Philip Morris International Inc. | États-Unis | Consommation de base | 22 919 | 2 975 | 2 750 |
| ¹ Power Corporation du Canada, à droit de vote subalterne | Canada | Services financiers | 52 794 | 2 278 | 2 204 |
| Restaurant Brands International Inc. | Canada | Consommation discrétionnaire | 46 583 | 3 733 | 3 615 |
| Roche Holding AG Genussscheine | Suisse | Soins de santé | 6 102 | 2 859 | 2 818 |
| Rogers Communications Inc., cat. B, sans droit de vote | Canada | Services de communication | 62 962 | 3 763 | 3 724 |
| Banque Royale du Canada | Canada | Services financiers | 102 114 | 13 029 | 12 870 |
| S&P Global Inc. | États-Unis | Services financiers | 3 852 | 2 191 | 2 072 |
| Safran SA | France | Produits industriels | 11 400 | 1 802 | 1 809 |
| SAP AG | Allemagne | Technologie de l'information | 13 469 | 2 460 | 2 310 |
| Schlumberger Ltd. | États-Unis | Énergie | 64 980 | 2 344 | 2 438 |
| The Sherwin-Williams Co. | États-Unis | Matériaux | 5 791 | 2 168 | 2 051 |
| Shiseido Co. Ltd. | Japon | Consommation de base | 11 165 | 1 020 | 952 |
| Sika AG | Suisse | Matériaux | 4 672 | 2 071 | 1 870 |
| Sony Corp. | Japon | Consommation discrétionnaire | 20 389 | 2 880 | 2 874 |
| Source Energy Services Ltd. | Canada | Énergie | 37 838 | 55 | 51 |
| Starbucks Corp. | États-Unis | Consommation discrétionnaire | 13 530 | 1 955 | 1 889 |
| Financière Sun Life inc. | Canada | Services financiers | 110 501 | 7 143 | 7 205 |
| Suncor Énergie Inc. | Canada | Énergie | 167 907 | 4 194 | 4 409 |
| Corporation TC Énergie | Canada | Énergie | 73 381 | 4 601 | 4 473 |
| Ressources Teck Ltée, cat. B | Canada | Matériaux | 53 841 | 1 692 | 1 698 |
| TELUS Corp. | Canada | Services de communication | 150 500 | 4 322 | 4 190 |
| TELUS International (Cda) Inc. | Canada | Technologie de l'information | 51 742 | 2 312 | 2 299 |
| Tencent Holdings Ltd. | Chine | Services de communication | 22 107 | 1 673 | 1 641 |
| Texas Instruments Inc. | États-Unis | Technologie de l'information | 12 154 | 3 040 | 2 957 |
| The TJX Companies Inc. | États-Unis | Consommation discrétionnaire | 16 458 | 1 477 | 1 375 |
| La Banque Toronto-Dominion | Canada | Services financiers | 126 022 | 10 391 | 10 567 |
| U.S. Bancorp | États-Unis | Services financiers | 33 471 | 2 432 | 2 519 |
| Union Pacific Corp. | États-Unis | Produits industriels | 5 588 | 1 435 | 1 387 |
| Visa Inc., cat. A | États-Unis | Technologie de l'information | 8 916 | 2 520 | 2 514 |
| The Walt Disney Co. | États-Unis | Services de communication | 4 873 | 1 139 | 1 044 |
| West Fraser Timber Co. Ltd. | Canada | Matériaux | 4 896 | 486 | 522 |
| Wolters Kluwer NV | Pays-Bas | Produits industriels | 16 289 | 2 342 | 2 180 |
| Total des actions | | | | 287 373 | 280 625 |

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2021

| | Pays | Secteur | Valeur nominale/ N ^{bre} d'actions/ de parts | Coût moyen \$ (en milliers) | Juste valeur \$ (en milliers) |
|--|------------|----------------------------------|---|--------------------------------|----------------------------------|
| FONDS/BILLETS NÉGOCIÉS EN BOURSE | | | | | |
| iShares S&P/TSX 60 Index ETF | Canada | Fonds/billets négociés en bourse | 115 830 | 3 580 | 3 518 |
| iShares S&P/TSX Global Gold Index ETF | États-Unis | Fonds/billets négociés en bourse | 82 692 | 1 381 | 1 365 |
| ² FINB Obligations de marchés émergents Mackenzie (couvert en \$ CA) | Canada | Fonds/billets négociés en bourse | 20 976 | 2 030 | 1 992 |
| ² FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie | Canada | Fonds/billets négociés en bourse | 39 935 | 3 580 | 3 499 |
| ² FNB de revenu fixe à rendement élevé mondial Mackenzie | Canada | Fonds/billets négociés en bourse | 1 863 570 | 37 728 | 37 589 |
| ² FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA) | Canada | Fonds/billets négociés en bourse | 23 388 | 2 494 | 2 459 |
| Total des fonds/billets négociés en bourse | | | | 50 793 | 50 422 |
| FONDS COMMUNS DE PLACEMENT | | | | | |
| ³ SEC Mackenzie CL Revenu stratégique (Revenu fixe), série R | Canada | Fonds communs de placement | 22 279 094 | 222 488 | 222 725 |
| ⁴ Fonds à rendement absolu de titres de créance Mackenzie, série CL | Canada | Fonds communs de placement | 549 703 | 5 466 | 5 446 |
| ⁴ Fonds d'obligations tactique mondial Mackenzie, série CL | Canada | Fonds communs de placement | 337 464 | 3 168 | 3 145 |
| ⁴ Fonds international de dividendes Mackenzie, série CL | Canada | Fonds communs de placement | 91 645 | 1 496 | 1 422 |
| ⁴ Fonds d'obligations de sociétés nord-américaines Mackenzie, série CL | Canada | Fonds communs de placement | 147 781 | 1 585 | 1 582 |
| Total des fonds communs de placement | | | | 234 203 | 234 320 |
| Coûts de transaction | | | | (2) | — |
| Total des placements | | | | 592 796 | 585 632 |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie | | | | | 5 852 |
| Autres éléments d'actif moins le passif | | | | | 3 497 |
| Actif net attribuable aux porteurs de titres | | | | | 594 981 |

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 une société affiliée à GPCV et investit dans des titres détenus auparavant par le Fonds prédécesseur qui ont été transférés à la société en commandite dans le cadre de la réorganisation qui a eu lieu le 17 septembre 2021.

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

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

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

Au 30 septembre 2021

(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) | Juste valeur \$ (en milliers) |
|---|------------|-----------------------------|---|--------------------------------|----------------------------------|
| OBLIGATIONS | | | | | |
| 407 International Inc. 1,80 % 22-05-2025, rachetables 2025 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 90 849 | 93 | 92 |
| 407 International Inc. 3,14 % 06-03-2030, rachetables 2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 75 708 | 83 | 81 |
| 407 International Inc. 2,59 % 25-05-2032, rachetables 2032 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 80 755 | 83 | 82 |
| 407 International Inc. 4,19 % 25-04-2042, rachetables | Canada | Sociétés – Non convertibles | 30 283 | 35 | 34 |
| 407 International Inc. 3,72 % 11-05-2048, rachetables 2047 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 307 879 | 339 | 327 |
| 407 International Inc. 3,67 % 08-03-2049, rachetables 2048 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 32 807 | 36 | 35 |
| 407 International Inc. 2,84 % 07-03-2050 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 35 330 | 33 | 32 |
| A&V Holdings Midco LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 28-02-2027 | États-Unis | Prêts à terme | 155 682 USD | 197 | 197 |
| ADS Tactical Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 04-03-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 271 634 USD | 345 | 346 |
| Adtalem Global Education Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 12-02-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 300 308 USD | 382 | 381 |
| Advantage Sales & Marketing Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 31-10-2027 | États-Unis | Prêts à terme | 217 906 USD | 278 | 278 |
| Aegis Toxicology Sciences Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 09-05-2025 | États-Unis | Prêts à terme | 93 691 USD | 115 | 115 |
| AES Panama Generation Holdings SRL 4,38 % 31-05-2030, rachetables 2030 | Panama | Sociétés – Non convertibles | 252 360 USD | 337 | 331 |
| AIMCo Realty Investors LP 3,04 % 01-06-2028, rachetables 2028 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 166 557 | 178 | 176 |
| AIMCo Realty Investors LP 2,71 % 01-06-2029, rachetables 2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 295 261 | 309 | 305 |
| Air Canada, prêt à terme B de premier rang, taux variable 27-07-2028 | Canada | Prêts à terme | 343 209 USD | 434 | 437 |
| Albertsons Cos. Inc. 4,63 % 15-01-2027, rachetables 2023 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 283 905 USD | 382 | 379 |
| Alcami Carolinas Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 06-07-2025 | États-Unis | Prêts à terme | 347 600 USD | 392 | 392 |
| Alchemy US Holdco LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-10-2025 | États-Unis | Prêts à terme | 238 272 USD | 301 | 301 |
| Alcoa Nederland Holding BV 5,50 % 15-12-2027, rachetables 2023 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 252 360 USD | 345 | 343 |
| Alectra Inc. 3,24 % 21-11-2024, rachetables 2024 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 52 996 | 56 | 56 |
| Algonquin Power & Utilities Corp. 4,09 % 17-02-2027, rachetables | Canada | Sociétés – Non convertibles | 270 025 | 300 | 297 |
| Algonquin Power & Utilities Corp. 2,85 % 15-07-2031 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 147 630 | 152 | 149 |
| Alimentation Couche-Tard inc. 2,95 % 25-01-2030, rachetables 2029 144A | Canada | Sociétés – Non convertibles | 126 180 USD | 168 | 166 |
| Allied Universal Holdco LLC 3,63 % 01-06-2028 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 353 303 EUR | 524 | 509 |
| Alpine US Bidco LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 13-04-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 276 902 USD | 344 | 353 |
| AltaLink, L.P. 1,51 % 11-09-2030 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 73 184 | 70 | 69 |
| AltaLink, L.P. 3,72 % 03-12-2046, rachetables, série MTN | Canada | Sociétés – Non convertibles | 169 333 | 189 | 183 |
| Altice Financing SA 5,75 % 15-08-2029 144A | Luxembourg | Sociétés – Non convertibles | 555 191 USD | 719 | 689 |
| Altice France SA 2,13 % 15-02-2025, rachetables 2022 | France | Sociétés – Non convertibles | 328 067 EUR | 479 | 469 |
| Altice France SA 5,13 % 15-07-2029 | France | Sociétés – Non convertibles | 504 719 USD | 642 | 630 |
| Amentum Government Services Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 03-02-2027 | États-Unis | Prêts à terme | 258 631 USD | 331 | 331 |
| American Teleconferencing Services Ltd., prêt à terme de premier rang, taux variable 08-06-2023 | États-Unis | Prêts à terme | 585 181 USD | 283 | 283 |
| AP Core Holdings II LLC, prêt à terme B2 de premier rang, taux variable 21-07-2027 | États-Unis | Prêts à terme | 363 398 USD | 454 | 462 |
| Apex Tool Group LLC 9,00 % 15-02-2023 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 146 369 USD | 186 | 187 |

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

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

Au 30 septembre 2021

(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) | Juste valeur \$ (en milliers) |
|--|-------------|-----------------------------|---|-----------------------------------|----------------------------------|
| OBLIGATIONS (suite) | | | | | |
| APFS Staffing Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 10-04-2026 | États-Unis | Prêts à terme | 278 750 USD | 353 | 353 |
| ARC Resources Ltd. 2,35 % 10-03-2026 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 113 057 | 115 | 114 |
| ARC Resources Ltd. 3,47 % 10-03-2031 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 113 562 | 118 | 116 |
| Arcos Dorados Holdings Inc. 5,88 % 04-04-2027, rachetables 2022 | Uruguay | Sociétés – Non convertibles | 360 874 USD | 481 | 474 |
| ARD Finance SA 6,50 % 30-06-2027, rachetables 2022 144A | Luxembourg | Sociétés – Non convertibles | 237 218 USD | 319 | 320 |
| Ardagh Metal Packaging 4,00 % 01-09-2029 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 267 501 USD | 347 | 343 |
| Aroundtown SA 4,63 % 18-09-2025, rachetables 2025 | Allemagne | Sociétés – Non convertibles | 229 647 | 249 | 247 |
| Vins Arterra Canada Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 18-11-2027 (\$ US) | Canada | Prêts à terme | 133 082 USD | 169 | 169 |
| Vins Arterra Canada Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 18-11-2027 | Canada | Prêts à terme | 120 527 | 120 | 120 |
| Ascend Performance Materials Operations LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 27-08-2026 | États-Unis | Prêts à terme | 298 742 USD | 384 | 383 |
| Ascend Wellness Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 27-08-2025 | États-Unis | Prêts à terme | 257 407 USD | 323 | 326 |
| Ashtead US Holdings Inc. 4,00 % 01-05-2028 | Royaume-Uni | Sociétés – Non convertibles | 204 411 USD | 275 | 275 |
| Ashton Woods USA LLC 4,63 % 01-08-2029 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 414 374 USD | 536 | 532 |
| Astoria Energy LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 04-12-2027 | États-Unis | Prêts à terme | 189 051 USD | 240 | 240 |
| Asurion LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 18-12-2026 | États-Unis | Prêts à terme | 140 261 USD | 175 | 175 |
| AT&T Inc., taux variable 25-03-2024 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 55 519 USD | 70 | 70 |
| AT&T Inc. 2,25 % 01-02-2032, rachetables 2031 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 148 892 USD | 188 | 184 |
| Athenahealth Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 11-02-2026 | États-Unis | Prêts à terme | 207 281 USD | 264 | 263 |
| Athene Global Funding, taux variable 09-04-2024 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 239 742 | 240 | 240 |
| Athene Global Funding 2,10 % 24-09-2025 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 141 321 | 144 | 143 |
| Atlantica Sustainable Infrastructure PLC 4,13 % 15-06-2028 144A | Espagne | Sociétés – Non convertibles | 247 312 USD | 329 | 325 |
| AutoCanada Inc. 8,75 % 11-02-2025 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 325 544 | 350 | 350 |
| Baidu Inc. 2,38 % 23-08-2031 | Chine | Sociétés – Non convertibles | 88 326 USD | 111 | 108 |
| Ball Metalpack Finco LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 26-07-2025 | États-Unis | Prêts à terme | 271 015 USD | 342 | 343 |
| Bank of America Corp., taux variable 24-03-2026, rachetables 2025 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 103 467 | 111 | 110 |
| Bank of America Corp., taux variable 04-04-2029 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 149 649 | 154 | 153 |
| Banque de Montréal 2,37 % 03-02-2025, rachetables 2025 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 186 746 | 194 | 193 |
| Banque de Montréal 1,76 % 10-03-2026 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 201 888 | 204 | 203 |
| Banque de Montréal 1,55 % 28-05-2026 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 276 334 | 277 | 275 |
| Banque de Montréal 3,19 % 01-03-2028 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 305 355 | 335 | 331 |
| Banque de Montréal, taux variable 22-07-2031 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 118 357 | 119 | 118 |
| Banque de Montréal, taux variable 26-11-2080 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 579 165 | 610 | 610 |
| La Banque de Nouvelle-Écosse 2,16 % 03-02-2025 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 328 067 | 338 | 336 |
| La Banque de Nouvelle-Écosse 1,40 % 01-11-2027 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 131 227 | 128 | 127 |
| La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 27-07-2081 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 169 081 | 169 | 169 |
| Bausch Health Cos. Inc. 5,50 % 01-11-2025, rachetables 2021 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 50 472 USD | 65 | 65 |
| Bausch Health Cos. Inc. 8,50 %, 31-01-2027, rachetables 2022 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 66 875 USD | 91 | 91 |
| Bausch Health Cos. Inc. 6,25 %, 15-02-2029 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 175 138 USD | 220 | 220 |
| Baytex Energy Corp. 5,63 % 01-06-2024, rachetables 2021 144A | Canada | Sociétés – Non convertibles | 126 180 USD | 162 | 161 |
| bclMC Realty Corp. 1,06 % 12-03-2024 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 61 071 | 61 | 61 |

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

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

Au 30 septembre 2021

(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) | Juste valeur \$ (en milliers) |
|---|------------|---|---|--------------------------------|----------------------------------|
| OBLIGATIONS (suite) | | | | | |
| bcIMC Realty Corp. 1,68 % 03-03-2025, rachetables 2025 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 70 661 | 72 | 71 |
| bcIMC Realty Corp. 1,07 % 04-02-2026 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 93 373 | 92 | 91 |
| bcIMC Realty Corp. 1,75 % 24-07-2030, rachetables 2030 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 85 802 | 84 | 82 |
| BCPE Cycle Merger Sub II Inc. 10,63 % 15-07-2027, rachetables 2022 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 272 548 USD | 367 | 368 |
| Bell Canada Inc. 3,35 % 12-03-2025, rachetables 2025 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 123 656 | 131 | 131 |
| Bell Canada Inc. 1,65 % 16-08-2027, rachetables 2027 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 141 321 | 139 | 138 |
| Bell Canada Inc. 2,90 % 10-09-2029, rachetables 2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 302 832 | 315 | 311 |
| Bell Canada Inc. 2,50 % 14-05-2030 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 209 458 | 210 | 207 |
| BMW Canada Auto Trust 0,33 % 20-07-2023 | Canada | Titres adossés à des créances hypothécaires | 2 878 | 3 | 3 |
| Bright Bidco BV, prêt à terme B de premier rang, taux variable 30-06-2024 | Pays-Bas | Prêts à terme | 55 401 USD | 57 | 56 |
| Broadcast Media Partners Holdings Inc. 4,50 % 01-05-2029 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 479 483 USD | 619 | 620 |
| Brookfield Infrastructure Finance ULC 4,20 % 11-09-2028, rachetables 2028 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 439 106 | 490 | 484 |
| Brookfield Infrastructure Finance ULC 3,41 % 09-10-2029, rachetables 2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 340 685 | 363 | 357 |
| Brookfield Infrastructure Finance ULC 2,86 % 01-09-2032, rachetables 2032 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 126 180 | 126 | 123 |
| Brookfield Property REIT Inc. 5,75 % 15-05-2026, rachetables 2022 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 270 025 USD | 358 | 356 |
| Brookfield Renewable Energy Partners ULC 3,63 % 15-01-2027, rachetables 2026 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 441 125 | 480 | 475 |
| Brookfield Renewable Partners ULC 4,25 % 15-01-2029, rachetables 2028 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 328 067 | 375 | 370 |
| Brookfield Renewable Partners ULC 3,38 % 15-01-2030, rachetables 2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 196 840 | 214 | 210 |
| Brookfield Renewable Partners ULC 4,29 % 05-11-2049, rachetables 2049 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 151 416 | 172 | 167 |
| Brookfield Renewable Partners ULC 3,33 % 13-08-2050, rachetables 2050 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 73 184 | 71 | 69 |
| Brookfield Residential Properties Inc. 6,25 % 15-09-2027, rachetables 2022 144A | Canada | Sociétés – Non convertibles | 278 857 USD | 373 | 372 |
| Brookfield Residential Properties Inc. 5,13 % 15-06-2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 559 734 | 567 | 567 |
| BWAY Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 03-04-2024 | États-Unis | Prêts à terme | 80 503 USD | 100 | 100 |
| BWAY Holding Co. 7,25 % 15-04-2025 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 328 320 USD | 416 | 414 |
| C&D Technologies Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 13-12-2025 | États-Unis | Prêts à terme | 286 956 USD | 360 | 359 |
| California Resources Corp. 7,13 % 01-02-2026 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 535 002 USD | 724 | 718 |
| Callon Petroleum Co. 9,00 % 01-04-2025 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 148 892 USD | 204 | 205 |
| Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 04-03-2025 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 259 930 | 260 | 260 |
| Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 21-04-2031 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 722 505 | 726 | 721 |
| Banque Canadienne Impériale de Commerce 4,38 % 28-10-2080 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 138 798 | 146 | 146 |
| Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada 3,00 % 08-02-2029, rachetables 2028 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 247 312 | 265 | 261 |
| Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada 3,60 % 31-07-2048, rachetables 2048 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 138 798 | 148 | 143 |

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

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

Au 30 septembre 2021

(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) | Juste valeur \$ (en milliers) |
|--|------------|-----------------------------|---|--------------------------------|----------------------------------|
| OBLIGATIONS (suite) | | | | | |
| Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 3,15 % 13-03-2029, rachetables 2028 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 164 034 | 177 | 174 |
| Banque canadienne de l'Ouest 1,57 % 14-09-2023 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 113 562 | 115 | 115 |
| Banque canadienne de l'Ouest, taux variable 22-01-2024 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 152 173 | 152 | 152 |
| Banque canadienne de l'Ouest 1,93 % 16-04-2026 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 126 180 | 127 | 126 |
| Banque canadienne de l'Ouest 1,82 % 16-12-2027 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 141 321 | 140 | 138 |
| Banque canadienne de l'Ouest, taux variable 31-07-2081 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 127 442 | 130 | 130 |
| Cansortium Inc., prêt à terme, taux variable 27-04-2025 | États-Unis | Prêts à terme | 90 849 USD | 112 | 112 |
| CanWel Building Materials Group Ltd. 5,25 % 15-05-2026 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 372 483 | 371 | 374 |
| Capital Power Corp. 4,42 % 08-02-2030, rachetables 2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 126 180 | 142 | 140 |
| Capital Power Corp. 3,15 % 01-10-2032 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 141 321 | 141 | 139 |
| CareCentrix Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 22-03-2025 | États-Unis | Prêts à terme | 351 939 USD | 410 | 425 |
| Carnival Corp. 9,88 % 01-08-2027 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 341 695 USD | 500 | 500 |
| Cascades inc. 5,13 % 15-01-2025, rachetables 2022 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 292 737 | 304 | 303 |
| Cascades inc. 5,13 % 15-01-2026, rachetables 2023 144A | Canada | Sociétés – Non convertibles | 502 196 USD | 676 | 679 |
| CCL Industries Inc. 3,86 % 13-04-2028, rachetables 2028 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 184 222 | 202 | 199 |
| CCO Holdings LLC 4,00 % 01-03-2023, rachetables 2021 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 50 472 USD | 64 | 64 |
| CCO Holdings LLC 5,38 % 01-06-2029, rachetables 2024 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 229 647 USD | 318 | 315 |
| CCO Holdings LLC 4,25 % 01-02-2031, rachetables 2025 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 27 760 USD | 36 | 36 |
| CCS-CMGC Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 25-09-2025 | États-Unis | Prêts à terme | 233 149 USD | 290 | 290 |
| Genovus Energy Inc. 6,75 % 15-11-2039, rachetables | Canada | Sociétés – Non convertibles | 148 892 USD | 258 | 256 |
| Centene Corp. 4,63 % 15-12-2029, rachetables 2024 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 88 326 USD | 123 | 122 |
| Centene Corp. 3,38 % 15-02-2030, rachetables 2028 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 191 793 USD | 254 | 252 |
| CenturyLink Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 15-03-2027 | États-Unis | Prêts à terme | 228 108 USD | 286 | 286 |
| CenturyLink Inc. 4,00 % 15-02-2027, rachetables 2023 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 136 274 USD | 177 | 177 |
| Charter Communications Operating LLC 4,50 % 01-02-2024, rachetables 2024 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 199 364 USD | 274 | 273 |
| Charter Communications Operating LLC 5,05 % 30-03-2029, rachetables 2028 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 340 685 USD | 511 | 505 |
| Charter Communications Operating LLC 2,80 % 01-04-2031, rachetables 2031 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 90 849 USD | 118 | 116 |
| Charter Communications Operating LLC 2,30 % 01-02-2032 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 105 991 USD | 130 | 129 |
| Charter Communications Operating LLC 3,50 % 01-06-2041 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 52 996 USD | 68 | 66 |
| Chartwell résidences pour retraités 4,21 % 28-04-2025, rachetables 2025 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 116 085 | 124 | 123 |
| Chemtrade Logistics Income Fund 4,75 % 31-05-2024, conv., rachetables 2022 | Canada | Sociétés – Convertibles | 426 488 | 413 | 413 |
| Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 3,55 % 10-01-2025, rachetables 2024 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 105 991 | 113 | 112 |
| Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 4,18 % 08-03-2028, rachetables 2027 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 418 917 | 467 | 463 |
| Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 3,53 % 11-06-2029, rachetables 2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 254 883 | 274 | 271 |
| Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 2,98 % 04-03-2030, rachetables 2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 141 321 | 146 | 143 |
| Clarios Global LP, prêt à terme B de premier rang, taux variable 30-04-2026 | Canada | Prêts à terme | 146 993 USD | 185 | 185 |

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

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

Au 30 septembre 2021

(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) | Juste valeur \$ (en milliers) |
|--|-------------|-----------------------------|---|--------------------------------|----------------------------------|
| OBLIGATIONS (suite) | | | | | |
| Clarios Global LP 6,75 % 15-05-2025, rachetables 2022 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 63 595 USD | 86 | 85 |
| The Clorox Co. 1,80 % 15-05-2030, rachetables 2030 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 111 038 USD | 139 | 138 |
| Columbia Care Inc. 13,00 % 14-05-2023 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 393 681 USD | 538 | 533 |
| Columbia Care Inc. 6,00 % 29-06-2025, conv. | Canada | Sociétés – Convertibles | 459 294 USD | 582 | 581 |
| CommScope Inc. 7,13 % 01-07-2028, rachetables 2023 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 174 128 USD | 233 | 226 |
| CommScope Inc. 4,75 % 01-09-2029 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 224 600 USD | 289 | 285 |
| CommScope Technologies Finance LLC 8,25 % 01-03-2027, rachetables 2022 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 103 467 USD | 138 | 138 |
| Connect Finco SARL 6,75 % 01-10-2026 | Royaume-Uni | Sociétés – Non convertibles | 388 634 USD | 521 | 517 |
| ConocoPhillips 3,75 % 01-10-2027 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 262 454 USD | 373 | 371 |
| Constellium NV 4,25 % 15-02-2026, rachetables 2021 | Pays-Bas | Sociétés – Non convertibles | 128 703 EUR | 196 | 192 |
| Constellium NV 5,88 % 15-02-2026, rachetables 2021 144A | Pays-Bas | Sociétés – Non convertibles | 330 591 USD | 428 | 426 |
| Constellium SE 3,75 % 15-04-2029 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 85 802 USD | 108 | 107 |
| Continental Resources Inc. 4,50 % 15-04-2023, rachetables 2023 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 204 411 USD | 271 | 269 |
| Continental Resources Inc. 5,75 % 15-01-2031 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 181 699 USD | 281 | 278 |
| Cook & Boardman Group LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 12-10-2025 | États-Unis | Prêts à terme | 156 646 USD | 196 | 197 |
| Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-06-2034 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 138 434 | 154 | 151 |
| Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-09-2034 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 140 758 | 156 | 153 |
| Corus Entertainment Inc. 5,00 % 11-05-2028 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 706 607 | 714 | 713 |
| Costco Wholesale Corp. 1,38 % 20-06-2027, rachetables 2027 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 179 175 USD | 229 | 228 |
| Cowen Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 12-03-2021 | États-Unis | Prêts à terme | 306 339 USD | 389 | 390 |
| CP Atlas Buyer Inc., prêt à terme B1 de premier rang, taux variable 27-12-2027 | États-Unis | Prêts à terme | 138 104 USD | 175 | 175 |
| CPPIB Capital Inc. 1,95 % 30-09-2029 | Canada | Gouvernement fédéral | 514 814 | 528 | 521 |
| Crew Energy Inc. 6,50 % 14-03-2024, rachetables | Canada | Sociétés – Non convertibles | 282 643 | 272 | 279 |
| Crocs Inc. 4,13 % 15-08-2031 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 68 137 USD | 88 | 87 |
| Fonds de placement immobilier Crombie 3,13 % 12-08-2031 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 37 854 | 38 | 37 |
| CrownRock LP/CrownRock Finance Inc. 5,63 % 15-10-2025, rachetables 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 282 643 USD | 370 | 367 |
| CSC Holdings LLC 5,75 % 15-01-2030 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 146 369 USD | 196 | 189 |
| CU Inc. 4,72 % 09-09-2043, rachetables 2043 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 55 519 | 69 | 67 |
| CVR Partners LP 9,25 % 15-06-2023, rachetables 2021 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 25 488 USD | 33 | 32 |
| CVS Health Corp. 3,70 % 09-03-2023, rachetables 2023 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 100 439 USD | 133 | 133 |
| Dana Inc. 3,00 % 15-07-2029 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 176 652 EUR | 274 | 265 |
| Daseke Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 05-03-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 201 383 USD | 256 | 255 |
| DaVita Inc. 3,75 % 15-02-2031, rachetables 2026 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 153 939 USD | 192 | 191 |
| Dawn Acquisition LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 25-10-2025 | États-Unis | Prêts à terme | 272 115 USD | 292 | 292 |
| Devon Energy Corp. 4,50 % 15-01-2030 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 132 236 USD | 183 | 182 |
| Diamond Sports Group LLC 5,38 % 15-08-2026, rachetables 2022 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 320 497 USD | 270 | 270 |
| Diamond Sports Group LLC 6,63 % 15-08-2027, rachetables 2022 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 280 119 USD | 152 | 158 |
| Diamondback Energy Inc. 3,50 % 01-12-2029, rachetables 2029 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 262 454 USD | 358 | 357 |
| DIRECTV Financing LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 22-07-2027 | États-Unis | Prêts à terme | 608 187 USD | 763 | 771 |
| DIRECTV Holdings LLC 5,88 % 15-08-2027 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 378 539 USD | 502 | 500 |

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

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

Au 30 septembre 2021

(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) | Juste valeur \$ (en milliers) |
|--|-------------|-----------------------------|---|-----------------------------------|----------------------------------|
| OBLIGATIONS (suite) | | | | | |
| DMT Solutions Global Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 25-06-2024 | États-Unis | Prêts à terme | 105 048 USD | 133 | 132 |
| Dollarama inc. 1,51 % 20-09-2027, rachetables 2027 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 47 948 | 47 | 46 |
| Fiducie de placement immobilier industriel Dream 1,66 % 22-12-2025 (A) | Canada | Sociétés – Non convertibles | 52 996 | 53 | 52 |
| Fiducie de placement immobilier industriel Dream 1,66 % 22-12-2025 (JUN) | Canada | Sociétés – Non convertibles | 46 182 | 46 | 46 |
| Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,06 % 17-06-2027 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 59 305 | 60 | 59 |
| DRW Holdings LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 24-02-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 202 367 USD | 256 | 256 |
| DT Midstream Inc. 4,13 % 15-06-2029 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 141 321 USD | 186 | 183 |
| Eastern Power LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 02-10-2025 | États-Unis | Prêts à terme | 171 528 USD | 195 | 194 |
| eG Global Finance PLC 6,75 % 07-02-2025, rachetables 2021 144A | Royaume-Uni | Sociétés – Non convertibles | 372 987 USD | 489 | 485 |
| Electrical Components International Inc., prêt à terme de second rang, taux variable 22-06-2026 | États-Unis | Prêts à terme | 75 708 USD | 91 | 91 |
| Empire Communities Corp. 7,38 % 15-12-2025 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 454 247 | 477 | 476 |
| L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie 3,63 % 17-04-2081 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 15 142 | 15 | 15 |
| Empresas CMPC SA 3,00 % 06-04-2031 | Chili | Sociétés – Non convertibles | 340 685 USD | 440 | 429 |
| Enbridge Gas Inc. 2,37 % 09-08-2029, rachetables 2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 90 849 | 94 | 92 |
| Enbridge Gas Inc. 3,01 % 09-08-2049, rachetables 2049 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 83 279 | 81 | 79 |
| Enbridge Gas Inc. 3,65 % 01-04-2050, rachetables 2049 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 27 760 | 30 | 29 |
| Enbridge Inc. 2,44 % 02-06-2025 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 78 231 | 81 | 80 |
| Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 3 654 167 | 3 912 | 3 897 |
| Enbridge Inc., taux variable 12-04-2078, rachetables 2028 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 905 971 | 1 042 | 1 037 |
| Energizer Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 16-12-2027 | États-Unis | Prêts à terme | 168 236 USD | 213 | 213 |
| Ensign Drilling Inc. 9,25 % 15-04-2024 144A | Canada | Sociétés – Non convertibles | 302 074 USD | 352 | 375 |
| EPCOR Utilities Inc. 3,55 % 27-11-2047, rachetables 2047 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 217 029 | 233 | 226 |
| EPCOR Utilities Inc. 3,11 % 08-07-2049, rachetables 2049 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 239 742 | 239 | 231 |
| EPCOR Utilities Inc. 2,90 % 19-05-2050, rachetables 2049 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 70 661 | 68 | 65 |
| The Estée Lauder Cos. Inc. 1,95 % 15-03-2031 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 83 279 USD | 107 | 106 |
| Exxon Mobil Corp. 2,61 % 15-10-2030, rachetables 2030 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 116 085 USD | 156 | 154 |
| FAGE International SA/FAGE USA Dairy Industry Inc. 5,63 % 15-08-2026, rachetables 2021 144A | Luxembourg | Sociétés – Non convertibles | 100 944 USD | 132 | 132 |
| Fairfax Financial Holdings Ltd. 8,30 % 15-04-2026 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 338 162 USD | 539 | 535 |
| Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,23 % 14-06-2029, rachetables 2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 90 849 | 99 | 98 |
| Fairfax Financial Holdings Ltd. 3,95 % 03-03-2031 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 431 535 | 457 | 449 |
| Fairfax India Holdings Corp. 5,00 % 26-02-2028 144A | Inde | Sociétés – Non convertibles | 653 611 USD | 827 | 826 |
| Fédération des caisses Desjardins du Québec 2,42 % 04-10-2024 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 22 712 | 23 | 23 |
| Fédération des caisses Desjardins du Québec, taux variable 26-05-2030, rachetables 2025 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 55 519 | 58 | 58 |
| First Eagle Holdings Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 17-02-2027 | États-Unis | Prêts à terme | 343 680 USD | 430 | 431 |
| First Quantum Minerals Ltd. 7,25 % 01-04-2023, rachetables 2021 144A | Zambie | Sociétés – Non convertibles | 421 441 USD | 544 | 543 |
| Flynn America LP, prêt à terme B de premier rang, taux variable 23-07-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 348 256 USD | 427 | 428 |

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

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

Au 30 septembre 2021

(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) | Juste valeur \$ (en milliers) |
|---|----------------|-----------------------------|---|-----------------------------------|----------------------------------|
| OBLIGATIONS (suite) | | | | | |
| Ford Motor Co. 9,00 % 22-04-2025, rachetables 2025 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 138 798 USD | 215 | 212 |
| Fortified Trust 2,34 % 23-01-2023 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 257 407 | 263 | 263 |
| Foxtrot Escrow Issuer LLC 12,25 % 15-11-2026, rachetables 2022 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 490 335 USD | 710 | 706 |
| Frontera Generation Holdings LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 28-07-2026 | États-Unis | Prêts à terme | 33 385 USD | 42 | 42 |
| Frontera Generation Holdings LLC, prêt à terme de second rang, taux variable 26-04-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 32 237 USD | 23 | 23 |
| FXI Holdings Inc. 7,88 % 01-11-2024, rachetables 2021 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 356 584 USD | 464 | 462 |
| Gannett Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 08-02-2026 | États-Unis | Prêts à terme | 211 541 USD | 271 | 270 |
| Garrett LX I SARL, prêt à terme B de premier rang, taux variable 05-03-2028 | Luxembourg | Prêts à terme | 229 647 EUR | 344 | 337 |
| Garrett LX I SARL, prêt à terme B de premier rang, taux variable 05-03-2028 (\$ US) | Luxembourg | Prêts à terme | 234 694 USD | 298 | 297 |
| General Motors Co. 6,13 % 01-10-2025, rachetables 2025 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 277 596 USD | 416 | 413 |
| General Motors Co. 6,80 % 01-10-2027, rachetables 2027 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 138 798 USD | 222 | 220 |
| GFL Environmental Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 31-05-2025 | Canada | Prêts à terme | 523 523 USD | 665 | 665 |
| GFL Environmental Inc. 3,75 % 01-08-2025, rachetables 2022 144A | Canada | Sociétés – Non convertibles | 196 840 USD | 258 | 257 |
| GFL Environmental Inc. 5,13 % 15-12-2026, rachetables 2022 144A | Canada | Sociétés – Non convertibles | 206 935 USD | 276 | 276 |
| GFL Environmental Inc. 3,50 % 01-09-2028 144A | Canada | Sociétés – Non convertibles | 175 138 USD | 223 | 223 |
| Gibson Energy Inc. 2,85 % 14-07-2027, rachetables 2027 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 671 276 | 696 | 688 |
| Gibson Energy Inc., taux variable 22-12-2080 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 757 079 | 770 | 774 |
| GoDaddy Operating Co. LLC 3,50 % 01-03-2029 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 340 685 USD | 434 | 430 |
| GOL Linhas aéreas inteligentes SA 8,00 % 30-06-2026 | Brésil | Sociétés – Non convertibles | 100 944 USD | 128 | 128 |
| The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 29-04-2025 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 300 056 | 301 | 301 |
| The Goldman Sachs Group Inc., 3,31 %, taux variable 31-10-2025, rachetables 2024 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 249 836 | 265 | 264 |
| The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 28-02-2029 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 247 312 | 246 | 243 |
| Gouvernement des Bahamas 5,75 % 16-01-2024 | Bahamas | Gouvernements étrangers | 83 783 USD | 109 | 99 |
| Gouvernement des Bahamas 6,00 % 21-11-2028, rachetables 2028 | Bahamas | Gouvernements étrangers | 338 162 USD | 422 | 369 |
| Gouvernement des Bahamas 6,95 % 20-11-2029 | Bahamas | Gouvernements étrangers | 7 571 USD | 10 | 9 |
| Gouvernement du Canada 1,25 % 01-06-2030 | Canada | Gouvernement fédéral | 5 570 333 | 5 602 | 5 502 |
| Gouvernement du Chili 4,50 % 01-03-2026 | Chili | Gouvernements étrangers | 273 810 151 CLP | 433 | 419 |
| Gouvernement du Chili 4,70 % 09-01-2030 | Chili | Gouvernements étrangers | 278 857 343 CLP | 428 | 412 |
| Gouvernement du Mexique 5,75 % 05-03-2026 | Mexique | Gouvernements étrangers | 45 298 546 MXN | 2 797 | 2 655 |
| Gouvernement du Mexique 7,75 % 29-05-2031 | Mexique | Gouvernements étrangers | 11 230 002 MXN | 755 | 708 |
| Gouvernement de la Russie 7,65 % 10-04-2030 | Russie | Gouvernements étrangers | 135 718 986 RUB | 2 481 | 2 439 |
| Gouvernement de l'Afrique du Sud 8,00 % 31-01-2030 | Afrique du Sud | Gouvernements étrangers | 18 674 609 ZAR | 1 583 | 1 460 |
| Grab Holdings Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 20-01-2026 | Singapour | Prêts à terme | 328 938 USD | 423 | 422 |
| Fiducie de placement immobilier Granite 2,19 % 30-08-2028 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 87 569 | 88 | 87 |
| Gray Escrow Inc. 7,00 % 15-05-2027, rachetables 2022 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 58 043 USD | 79 | 79 |
| Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 2,73 % 03-04-2029, rachetables 2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 128 703 | 136 | 134 |
| Greenhill & Co. Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 05-04-2024 | États-Unis | Prêts à terme | 123 745 USD | 157 | 156 |
| Gulfport Energy Corp. 8,00 % 17-05-2026 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 143 845 USD | 197 | 199 |

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

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

Au 30 septembre 2021

(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) | Juste valeur \$ (en milliers) |
|--|--------------|-----------------------------|---|-----------------------------------|----------------------------------|
| OBLIGATIONS (suite) | | | | | |
| Fonds de placement immobilier H&R 3,42 % 23-01-2023, rachetables 2022 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 181 699 | 187 | 187 |
| Fonds de placement immobilier H&R 4,07 % 16-06-2025, rachetables 2025 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 290 718 | 312 | 310 |
| Fonds de placement immobilier H&R 2,63 % 19-02-2027 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 138 798 | 140 | 139 |
| Hadrian Merger Sub Inc. 8,50 % 01-05-2026, rachetables 2021 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 316 964 USD | 417 | 417 |
| HCA Healthcare Inc. 3,50 % 01-09-2030, rachetables 2030 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 374 754 USD | 513 | 504 |
| Heathrow Funding Ltd. 3,25 % 21-05-2025 | Royaume-Uni | Sociétés – Non convertibles | 911 018 | 959 | 953 |
| Heathrow Funding Ltd. 2,69 % 13-10-2027 | Royaume-Uni | Sociétés – Non convertibles | 148 892 | 153 | 150 |
| Heathrow Funding Ltd. 3,40 % 08-03-2028 | Royaume-Uni | Sociétés – Non convertibles | 323 020 | 343 | 337 |
| Heathrow Funding Ltd. 3,79 % 04-09-2030, rachetables 2030 | Royaume-Uni | Sociétés – Non convertibles | 254 883 | 276 | 271 |
| Heritage Power LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 08-07-2026 | États-Unis | Prêts à terme | 461 049 USD | 527 | 521 |
| Honda Canada Finance Inc., taux variable 26-02-2024 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 138 798 | 139 | 139 |
| Honda Canada Finance Inc. 1,34 % 17-03-2026 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 93 373 | 93 | 92 |
| Honda Canada Finance Inc. 1,65 % 25-02-2028 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 143 845 | 142 | 140 |
| Horizon Therapeutics PLC 5,50 % 01-08-2027, rachetables 2022 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 184 222 USD | 248 | 247 |
| Hudson River Trading LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 19-03-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 361 581 USD | 454 | 456 |
| Hydro One Inc. 1,69 % 16-01-2031, rachetables 2030 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 85 802 | 83 | 81 |
| Hydro One Ltd. 1,41 % 15-10-2027, rachetables 2027 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 100 944 | 99 | 98 |
| Hyster-Yale Group Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 21-05-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 216 979 USD | 275 | 274 |
| Hyundai Capital Canada Inc. 2,01 % 12-05-2026 | Corée du Sud | Sociétés – Non convertibles | 56 781 | 58 | 57 |
| IAMGOLD Corp. 5,75 % 15-10-2028, rachetables 2023 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 270 025 USD | 343 | 338 |
| INEOS Enterprises Holdings US Finco LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 03-09-2026 | États-Unis | Prêts à terme | 367 873 USD | 468 | 468 |
| Innovative Industrial Properties Inc. 5,50 % 25-05-2026 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 285 166 USD | 381 | 381 |
| Innovative Water Care Global Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 27-02-2026 | États-Unis | Prêts à terme | 440 431 USD | 558 | 557 |
| Intact Corporation financière 2,18 % 18-05-2028 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 58 800 | 60 | 59 |
| Intact Corporation financière, taux variable 31-03-2081 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 55 519 | 57 | 57 |
| Integro Ltd. United States, prêt à terme B1 de premier rang, taux variable 31-10-2022 | États-Unis | Prêts à terme | 120 630 USD | 150 | 150 |
| Intel Corp. 2,45 % 15-11-2029, rachetables 2029 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 135 517 USD | 181 | 179 |
| Intelsat Jackson Holdings SA 8,50 % 15-10-2024, rachetables 2021 144A | Luxembourg | Sociétés – Non convertibles | 73 184 USD | 51 | 53 |
| Inter Pipeline Ltd., taux variable 26-03-2079, rachetables 2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 1 372 836 | 1 525 | 1 508 |
| Inter Pipeline Ltd., taux variable 19-11-2079, rachetables 2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 406 299 | 445 | 441 |
| Iris Merger Sub 2019 Inc. 9,38 % 15-02-2028, rachetables 2023 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 174 128 USD | 239 | 238 |
| Iron Mountain Inc. 5,00 % 15-07-2028, rachetables 2023 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 201 888 USD | 270 | 268 |
| Iron Mountain Inc. 5,25 % 15-07-2030, rachetables 2025 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 328 067 USD | 446 | 443 |
| Isagenix International LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 26-04-2025 | États-Unis | Prêts à terme | 286 847 USD | 304 | 304 |
| Ivanhoe Cambridge II Inc. 2,91 % 27-06-2023, rachetables 2023 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 136 274 | 141 | 141 |
| Ivanhoe Cambridge II Inc. 2,30 % 12-12-2024, rachetables 2024 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 15 142 | 16 | 16 |
| Jadex Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 12-02-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 503 778 USD | 633 | 633 |

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

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

Au 30 septembre 2021

(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) | Juste valeur \$ (en milliers) |
|--|------------|-----------------------------|---|--------------------------------|----------------------------------|
| OBLIGATIONS (suite) | | | | | |
| Jane Street Group LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 21-01-2027 | États-Unis | Prêts à terme | 373 031 USD | 468 | 468 |
| Jazz Financing Lux SARL, prêt à terme B de premier rang, taux variable 22-04-2028 | Luxembourg | Prêts à terme | 136 274 USD | 172 | 173 |
| Jazz Pharmaceuticals PLC 4,38 % 15-01-2029 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 479 483 USD | 633 | 631 |
| Journey Personal Care Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 19-02-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 241 660 USD | 307 | 307 |
| JPMorgan Chase & Co. 1,90 % 05-03-2028 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 244 789 | 246 | 244 |
| Jump Financial LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 04-08-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 292 737 USD | 367 | 370 |
| Kaisa Group Holdings Ltd. 9,38 % 30-06-2024 | Chine | Sociétés – Non convertibles | 206 935 USD | 227 | 200 |
| Kaisa Group Holdings Ltd. 11,70 % 11-11-2025 | Chine | Sociétés – Non convertibles | 100 944 USD | 117 | 101 |
| Keane Group Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 18-05-2025 | États-Unis | Prêts à terme | 494 583 USD | 613 | 612 |
| Kestrel Bidco Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 07-08-2026 | Canada | Prêts à terme | 328 065 USD | 405 | 406 |
| Keyera Corp. 3,96 % 29-05-2030 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 116 085 | 126 | 124 |
| Keyera Corp., taux variable 13-06-2079, rachetables 2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 1 175 996 | 1 315 | 1 304 |
| Keyera Corp., taux variable 10-03-2081 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 620 805 | 654 | 644 |
| Kronos Acquisition Holdings Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 22-12-2026 | États-Unis | Prêts à terme | 215 944 USD | 268 | 267 |
| Produits Kruger s.e.c. 6,00 % 24-04-2025, rachetables 2021 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 482 259 | 503 | 504 |
| Produits Kruger s.e.c. 5,38 % 09-04-2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 343 209 | 351 | 351 |
| LABL Escrow Issuer LLC 6,75 % 15-07-2026, rachetables 2022 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 317 468 USD | 424 | 423 |
| LABL Escrow Issuer LLC 10,50 % 15-07-2027, rachetables 2022 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 447 434 USD | 618 | 613 |
| LABL Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 02-07-2026 | États-Unis | Prêts à terme | 356 130 USD | 451 | 451 |
| Lamar Media Corp. 4,00 % 15-02-2030, rachetables 2025 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 300 308 USD | 395 | 392 |
| Lamb Weston Holdings Inc. 4,63 % 01-11-2024, rachetables 2021 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 476 960 USD | 623 | 620 |
| Lamb Weston Holdings Inc. 4,88 % 01-11-2026, rachetables 2021 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 275 072 USD | 359 | 357 |
| Lancet Merger Sub Inc., prêt à terme à prélèvement différé de premier rang, taux variable 09-08-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 22 455 USD | 29 | 28 |
| Lancet Merger Sub Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 09-08-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 252 617 USD | 320 | 318 |
| Banque Laurentienne du Canada 1,15 % 03-06-2024 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 99 177 | 99 | 99 |
| Banque Laurentienne du Canada, taux variable 15-06-2081 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 363 398 | 366 | 373 |
| LBM Acquisition LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 08-12-2027 | États-Unis | Prêts à terme | 160 649 USD | 202 | 202 |
| LBM Acquisition LLC, prêt à terme à prélèvement différé de premier rang, taux variable 08-12-2027 | États-Unis | Prêts à terme | 35 789 USD | 45 | 45 |
| Level 3 Financing Inc. 3,75 % 15-07-2029 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 98 420 USD | 123 | 121 |
| Liberty Utilities (Canada) LP 3,32 % 14-02-2050, rachetables 2049 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 73 184 | 71 | 70 |
| LifeMiles Ltd., prêt à terme B de premier rang, taux variable 16-08-2026 | Colombie | Prêts à terme | 386 609 USD | 485 | 488 |

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

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

Au 30 septembre 2021

(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) | Juste valeur \$ (en milliers) |
|--|------------|-----------------------------|---|-----------------------------------|----------------------------------|
| OBLIGATIONS (suite) | | | | | |
| LifeScan Global Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 19-06-2024 | États-Unis | Prêts à terme | 208 050 USD | 262 | 261 |
| LifeScan Global Corp., prêt à terme de second rang, taux variable 19-06-2025 | États-Unis | Prêts à terme | 189 270 USD | 228 | 228 |
| Lions Gate Entertainment Inc. 5,50 % 15-04-2029 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 209 458 USD | 273 | 275 |
| Les Compagnies Loblaw Itée 4,49 % 11-12-2028, rachetables 2028 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 73 184 | 85 | 84 |
| Les Compagnies Loblaw Itée 2,28 % 07-05-2030, rachetables 2030 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 158 987 | 158 | 156 |
| LogMeln Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 14-08-2027 | États-Unis | Prêts à terme | 225 988 USD | 286 | 286 |
| Lower Mattagami Energy LP 3,42 % 20-06-2024 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 118 609 | 127 | 126 |
| Lower Mattagami Energy LP 2,43 % 14-05-2031 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 75 203 | 78 | 76 |
| LRS Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 13-08-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 257 407 USD | 327 | 326 |
| Magenta Buyer LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 03-05-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 565 285 USD | 710 | 716 |
| Magenta Buyer LLC, prêt à terme de second rang, taux variable 03-05-2029 | États-Unis | Prêts à terme | 121 133 USD | 154 | 153 |
| Banque Manuvie du Canada 2,38 % 19-11-2024 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 42 901 | 45 | 44 |
| Banque Manuvie du Canada 1,50 % 25-06-2025 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 302 832 | 306 | 304 |
| Société Financière Manuvie, taux variable 09-05-2028, rachetables 2023 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 146 369 | 152 | 152 |
| Société Financière Manuvie, taux variable 12-05-2030, rachetables 2025 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 85 802 | 88 | 87 |
| Société Financière Manuvie 3,38 % 19-06-2081 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 239 742 | 241 | 238 |
| Mar Bidco SARL, prêt à terme B de premier rang, taux variable 21-04-2028 | Luxembourg | Prêts à terme | 209 458 USD | 265 | 265 |
| Mastercard Inc. 1,90 % 15-03-2031 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 47 948 USD | 62 | 61 |
| Matador Resources Co. 5,88 % 15-09-2026, rachetables 2021 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 235 199 USD | 309 | 309 |
| Mattel Inc. 3,15 % 15-03-2023, rachetables 2022 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 196 840 USD | 255 | 254 |
| Mattel Inc. 3,38 % 01-04-2026 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 295 261 USD | 390 | 386 |
| Mav Acquisition Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 21-07-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 211 982 USD | 266 | 270 |
| Mav Acquisition Corp. 5,75 % 01-08-2028 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 575 380 USD | 725 | 716 |
| McDonald's Corp. 3,13 % 04-03-2025, rachetables 2025 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 391 157 | 415 | 412 |
| McKissock Investment Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 17-06-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 262 454 USD | 328 | 328 |
| MEG Energy Corp. 7,13 % 01-02-2027, rachetables 2023 144A | Canada | Sociétés – Non convertibles | 393 681 USD | 527 | 526 |
| MEG Energy Corp. 5,88 % 01-02-2029 144A | Canada | Sociétés – Non convertibles | 391 157 USD | 511 | 506 |
| Mercer International Inc., taux variable 01-02-2029 | Allemagne | Sociétés – Non convertibles | 151 416 USD | 195 | 196 |
| Meredith Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 31-01-2025 | États-Unis | Prêts à terme | 166 088 USD | 210 | 210 |
| Mexico Remittances Funding Fiduciary Estate Management SARL 4,88 % 15-01-2028 | Mexique | Sociétés – Non convertibles | 378 539 USD | 475 | 472 |
| MicroStrategy Inc. 6,13 % 15-06-2028 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 229 647 USD | 299 | 297 |
| Minerva SA 4,38 % 18-03-2031 | Brésil | Sociétés – Non convertibles | 100 944 USD | 127 | 124 |
| Minotaur Acquisition Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 27-02-2026 | États-Unis | Prêts à terme | 424 125 USD | 536 | 535 |
| Morgan Stanley 3,00 % 07-02-2024 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 557 715 | 583 | 581 |
| Morgan Stanley, taux variable 21-03-2025 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 277 596 | 278 | 278 |

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

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

Au 30 septembre 2021

(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) | Juste valeur \$ (en milliers) |
|---|-------------|-----------------------------|---|-----------------------------------|----------------------------------|
| OBLIGATIONS (suite) | | | | | |
| Motel 6 Operating LP, prêt à terme B de premier rang, taux variable 19-08-2026 | États-Unis | Prêts à terme | 206 935 USD | 262 | 264 |
| Murphy Oil Corp. 6,88 % 15-08-2024, rachetables | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 103 972 USD | 135 | 135 |
| Nabors Industries Inc. 7,25 % 15-01-2026, rachetables 2022 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 171 605 USD | 208 | 212 |
| Banque Nationale du Canada 2,58 % 03-02-2025 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 194 317 | 203 | 202 |
| Banque Nationale du Canada, taux variable 18-08-2026, rachetables 2025 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 111 038 | 112 | 111 |
| Banque Nationale du Canada, taux variable 15-08-2081 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 370 969 | 372 | 372 |
| National Grid Electricity Transmission PLC 2,30 % 22-06-2029 | Royaume-Uni | Sociétés – Non convertibles | 125 170 | 126 | 124 |
| NAV CANADA 2,06 % 29-05-2030 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 70 661 | 71 | 70 |
| Neenah Foundry Co., prêt à terme B de premier rang, taux variable 08-12-2022 | États-Unis | Prêts à terme | 93 108 USD | 109 | 109 |
| New Arclin US Holding Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 14-02-2026 | États-Unis | Prêts à terme | 1 632 USD | 2 | 2 |
| New Red Finance Inc. 4,00 % 15-10-2030 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 222 076 USD | 282 | 279 |
| New Trojan Parent Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 22-01-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 151 416 USD | 192 | 192 |
| New Trojan Parent Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 22-01-2029 | États-Unis | Prêts à terme | 55 519 USD | 70 | 70 |
| Nexstar Escrow Inc. 5,63 % 15-07-2027, rachetables 2022 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 547 368 USD | 736 | 735 |
| NextEra Energy Capital Holdings Inc. 1,90 % 15-06-2028 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 52 996 USD | 68 | 67 |
| NextEra Energy Capital Holdings Inc. 2,25 % 01-06-2030, rachetables 2030 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 179 175 USD | 231 | 229 |
| Nielsen Holdings PLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 05-02-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 233 521 USD | 297 | 297 |
| Nine Energy Service Inc. 8,75 % 01-11-2023, rachetables 2021 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 290 214 USD | 183 | 177 |
| Nobian Finance BV, prêt à terme B de premier rang, taux variable 24-06-2026 | Pays-Bas | Prêts à terme | 378 539 EUR | 567 | 555 |
| Nobian Finance BV 3,63 % 15-07-2026 | Pays-Bas | Sociétés – Non convertibles | 378 539 EUR | 567 | 551 |
| North Battleford Power LP 4,96 % 31-12-2032 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 393 191 | 456 | 450 |
| North West Redwater Partnership 2,80 % 01-06-2031 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 168 071 | 171 | 168 |
| Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc. 4,11 % 31-03-2042 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 191 618 | 213 | 209 |
| Nova Scotia Power Inc. 3,57 % 05-04-2049, rachetables 2048 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 118 609 | 125 | 121 |
| Nufarm Australia Ltd. 5,75 % 30-04-2026, rachetables 2021 144A | Australie | Sociétés – Non convertibles | 434 058 USD | 567 | 564 |
| NuVista Energy Ltd. 7,88 % 23-07-2026 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 408 823 | 412 | 420 |
| OMERS Finance Trust 1,55 % 21-04-2027 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 643 517 | 648 | 642 |
| OMERS Finance Trust 2,60 % 14-05-2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 275 072 | 292 | 288 |
| OMERS Realty Corp. 3,63 % 05-06-2030, rachetables 2030 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 338 162 | 380 | 373 |
| OneDigital Borrower LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 30-10-2027 | États-Unis | Prêts à terme | 211 069 USD | 269 | 269 |
| OneDigital Borrower LLC, prêt à terme B à prélèvement différé de premier rang, taux variable 30-10-2027 | États-Unis | Prêts à terme | 6 843 USD | 9 | 9 |
| Ontario Power Generation Inc. 2,89 % 08-04-2025, rachetables 2025 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 100 944 | 107 | 106 |
| Ontario Power Generation Inc. 3,32 % 04-10-2027, rachetables 2027 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 194 317 | 212 | 209 |
| Ontario Power Generation Inc. 2,98 % 13-09-2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 159 491 | 171 | 168 |

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

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

Au 30 septembre 2021

(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) | Juste valeur \$ (en milliers) |
|--|------------|-----------------------------|---|--------------------------------|----------------------------------|
| OBLIGATIONS (suite) | | | | | |
| Ontario Power Generation Inc. 3,22 % 08-04-2030, rachetables 2030 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 75 708 | 82 | 81 |
| Ontario Power Generation Inc. 3,84 % 22-06-2048, rachetables 2047 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 88 326 | 97 | 94 |
| Ontario Teachers' Finance Trust 1,10 % 19-10-2027 | Canada | Gouvernements provinciaux | 80 755 | 79 | 78 |
| Osmosis Debt Merger Sub Inc., prêt à terme à prélèvement différé de premier rang, taux variable 17-06-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 31 124 USD | 39 | 40 |
| Osmosis Debt Merger Sub Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 17-06-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 248 995 USD | 314 | 317 |
| Panther BF Aggregator 2 LP 8,50 % 15-05-2027, rachetables 2022 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 384 091 USD | 522 | 518 |
| Corporation Parkland du Canada 3,88 % 16-06-2026 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 567 809 | 576 | 578 |
| Corporation Parkland du Canada 4,50 % 01-10-2029 144A | Canada | Sociétés – Non convertibles | 825 216 USD | 1 076 | 1 065 |
| Corporation Parkland 4,38 % 26-03-2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 986 726 | 1 004 | 1 006 |
| Corporation Pétroles Parkland 5,88 % 15-07-2027, rachetables 2022 144A | Canada | Sociétés – Non convertibles | 36 087 USD | 49 | 48 |
| Corporation Pétroles Parkland 6,00 % 23-06-2028, rachetables 2023 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 587 998 | 634 | 634 |
| Pattern Energy Operations LP 4,50 % 15-08-2028, rachetables 2023 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 118 609 USD | 159 | 157 |
| PayPal Holdings Inc. 1,35 % 01-06-2023 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 50 472 USD | 65 | 65 |
| PayPal Holdings Inc. 2,40 % 01-10-2024, rachetables 2024 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 136 274 USD | 182 | 181 |
| PayPal Holdings Inc. 2,65 % 01-10-2026 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 141 321 USD | 193 | 191 |
| PayPal Holdings Inc. 2,30 % 01-06-2030, rachetables 2030 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 63 090 USD | 83 | 82 |
| Pembina Pipeline Corp. 4,02 % 27-03-2028, rachetables 2027 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 100 944 | 111 | 110 |
| Pembina Pipeline Corp. 3,62 % 03-04-2029, rachetables 2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 227 124 | 245 | 241 |
| Pembina Pipeline Corp. 3,31 % 01-02-2030, rachetables 2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 32 807 | 35 | 34 |
| Pembina Pipeline Corp., taux variable 25-01-2081 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 1 218 897 | 1 222 | 1 218 |
| Peraton Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 24-02-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 296 295 USD | 376 | 376 |
| Petróleo de Venezuela SA 6,00 % 16-05-2024 | Venezuela | Sociétés – Non convertibles | 562 762 USD | 34 | 42 |
| Petróleo Mexicanos 6,50 % 13-03-2027 | Mexique | Sociétés – Non convertibles | 464 342 USD | 629 | 621 |
| PharmaCann LLC 12,00 % 30-06-2025 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 403 775 USD | 524 | 526 |
| Plaze Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 03-08-2026 | États-Unis | Prêts à terme | 177 387 USD | 224 | 225 |
| PLH Group Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 06-08-2023 | États-Unis | Prêts à terme | 179 661 USD | 225 | 226 |
| Pluto Acquisition I Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 20-06-2026 | États-Unis | Prêts à terme | 322 213 USD | 409 | 408 |
| Project Sky Merger Sub Inc., prêt à terme de second rang, taux variable 10-08-2029 | États-Unis | Prêts à terme | 214 506 USD | 272 | 272 |
| Project Sky Merger Sub Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 10-08-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 396 205 USD | 497 | 502 |
| Province de l'Alberta 3,05 % 01-12-2048 | Canada | Gouvernements provinciaux | 88 326 | 94 | 92 |
| Province de l'Alberta 2,95 % 01-06-2052 | Canada | Gouvernements provinciaux | 20 189 | 21 | 20 |
| Province de la Colombie-Britannique 1,55 % 18-06-2031 | Canada | Gouvernements provinciaux | 1 228 991 | 1 198 | 1 178 |
| Province de la Colombie-Britannique 2,80 % 18-06-2048 | Canada | Gouvernements provinciaux | 80 755 | 85 | 83 |
| Province de la Colombie-Britannique 2,95 % 18-06-2050 | Canada | Gouvernements provinciaux | 787 362 | 853 | 828 |
| Province de la Colombie-Britannique 2,75 % 18-06-2052 | Canada | Gouvernements provinciaux | 176 652 | 184 | 178 |
| Province du Manitoba 3,20 % 05-03-2050 | Canada | Gouvernements provinciaux | 42 901 | 47 | 46 |

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

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

Au 30 septembre 2021

(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) | Juste valeur \$ (en milliers) |
|--|------------|-----------------------------|---|--------------------------------|----------------------------------|
| OBLIGATIONS (suite) | | | | | |
| Province du Manitoba 2,05 % 05-09-2052 | Canada | Gouvernements provinciaux | 50 472 | 44 | 42 |
| Province de l'Ontario 1,55 % 01-11-2029 | Canada | Gouvernements provinciaux | 976 632 | 969 | 955 |
| Province de l'Ontario 3,45 % 02-06-2045 | Canada | Gouvernements provinciaux | 133 751 | 155 | 150 |
| Province de l'Ontario 1,90 % 02-12-2051 | Canada | Gouvernements provinciaux | 950 639 | 809 | 782 |
| Province de Québec 3,50 % 01-12-2048 | Canada | Gouvernements provinciaux | 78 231 | 93 | 90 |
| Province de Québec 3,10 % 01-12-2051 | Canada | Gouvernements provinciaux | 1 126 533 | 1 251 | 1 211 |
| Province de la Saskatchewan 3,10 % 02-06-2050 | Canada | Gouvernements provinciaux | 300 308 | 327 | 317 |
| Province de la Saskatchewan 2,80 % 02-12-2052 | Canada | Gouvernements provinciaux | 429 516 | 441 | 427 |
| PSC Industrial Outsourcing LP, prêt à terme de second rang, taux variable 05-10-2025 | États-Unis | Prêts à terme | 164 034 USD | 208 | 208 |
| PSP Capital Inc. 2,05 % 15-01-2030 | Canada | Gouvernement fédéral | 326 806 | 336 | 332 |
| Quad/Graphics Inc. 7,00 % 01-05-2022 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 315 449 USD | 409 | 408 |
| QVC Inc. 4,38 % 01-09-2028, rachetables 2028 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 479 231 USD | 637 | 629 |
| Rackspace Technology Global Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 09-02-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 256 120 USD | 322 | 322 |
| Rackspace Technology Global Inc. 3,50 % 15-02-2028 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 315 449 USD | 385 | 387 |
| RailWorks Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 11-12-2027 | États-Unis | Prêts à terme | 219 645 USD | 281 | 281 |
| Rather Outdoors Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 26-01-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 133 416 USD | 169 | 169 |
| Real Hero Merger Sub 2 Inc. 6,25 % 01-02-2029 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 151 416 USD | 200 | 199 |
| Reliance LP 2,68 % 01-12-2027 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 75 708 | 77 | 76 |
| Reliance LP 2,67 % 01-08-2028 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 201 888 | 205 | 203 |
| Resolute Investment Managers Inc., prêt à terme de second rang, taux variable 30-04-2025 | États-Unis | Prêts à terme | 119 679 USD | 152 | 152 |
| Resolute Investment Managers Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 30-04-2024 | États-Unis | Prêts à terme | 345 733 USD | 435 | 434 |
| Rite Aid Corp. 7,70 % 15-02-2027 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 383 587 USD | 475 | 447 |
| Banque Royale du Canada 1,59 % 04-05-2026 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 177 156 | 178 | 176 |
| Banque Royale du Canada 1,83 % 31-07-2028 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 189 270 | 189 | 186 |
| Banque Royale du Canada, taux variable 28-01-2033 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 247 060 | 242 | 239 |
| Banque Royale du Canada, taux variable 24-11-2080, rachetables 2025 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 521 123 | 554 | 553 |
| Banque Royale du Canada, taux variable 24-02-2081 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 265 735 | 276 | 276 |
| R.R. Donnelley & Sons Co. 6,13 % 01-11-2026 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 331 348 USD | 442 | 439 |
| Métaux Russel Inc. 6,00 % 16-03-2026, rachetables 2021 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 310 402 | 325 | 326 |
| Sagen MI Canada Inc. 3,26 % 05-03-2031 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 88 326 | 91 | 89 |
| Sagen MI Canada Inc., taux variable 24-03-2081 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 65 613 | 67 | 67 |
| San Miguel Industrias Pet SA 3,50 % 02-08-2028 | Pérou | Sociétés – Non convertibles | 378 539 USD | 479 | 473 |
| Saputo inc. 2,88 % 19-11-2024, rachetables 2024 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 80 755 | 85 | 84 |
| Saputo inc. 2,24 % 16-06-2027, rachetables 2027 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 92 868 | 94 | 93 |
| Saputo inc. 2,30 % 22-06-2028 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 40 882 | 41 | 41 |
| Schweitzer-Mauduit International Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 23-02-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 289 488 USD | 367 | 367 |
| Seaspan Corp. 5,50 % 01-08-2029 144A | Hong Kong | Sociétés – Non convertibles | 418 917 USD | 552 | 543 |
| Secure Energy Services Inc. 7,25 % 30-12-2026 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 229 647 | 232 | 233 |
| Shaw Communications Inc. 4,40 % 02-11-2028, rachetables 2028 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 333 115 | 374 | 370 |
| Shaw Communications Inc. 2,90 % 09-12-2030, rachetables 2030 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 249 836 | 252 | 248 |
| Sienna Senior Living Inc. 3,11 % 04-11-2024 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 60 566 | 63 | 63 |
| Sienna Senior Living Inc. 3,45 % 27-02-2026, rachetables 2026 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 55 519 | 59 | 58 |

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

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

Au 30 septembre 2021

(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) | Juste valeur \$ (en milliers) |
|--|------------|-----------------------------|---|--------------------------------|----------------------------------|
| OBLIGATIONS (suite) | | | | | |
| Sigma Bidco BV, prêt à terme B de premier rang, taux variable 07-03-2025 | Pays-Bas | Prêts à terme | 404 532 EUR | 592 | 578 |
| Signify Health LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 16-06-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 285 166 USD | 362 | 360 |
| Silgan Holdings Inc. 4,13 % 01-02-2028 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 267 501 USD | 352 | 350 |
| Sinclair Television Group Inc., prêt à terme B2 de premier rang, taux variable 18-07-2026 | États-Unis | Prêts à terme | 242 366 USD | 301 | 302 |
| Sinclair Television Group Inc. 5,13 % 15-02-2027, rachetables 2021 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 249 836 USD | 308 | 317 |
| Sinclair Television Group Inc. 5,50 % 01-03-2030, rachetables 2024 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 275 072 USD | 338 | 346 |
| Sinclair Television Group Inc. 4,13 % 01-12-2030 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 174 128 USD | 216 | 217 |
| SITEL Worldwide Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 28-07-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 242 265 USD | 306 | 307 |
| SmartCentres Real Estate Investment Trust 3,19 % 11-06-2027, rachetables 2027 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 63 090 | 66 | 66 |
| SmartCentres Real Estate Investment Trust 3,53 % 20-12-2029, rachetables 2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 320 244 | 339 | 335 |
| Sorenson Communications LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 12-03-2026 | États-Unis | Prêts à terme | 230 152 USD | 295 | 294 |
| Source energy Services 10,50 % 15-03-2025 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 687 414 | 169 | 286 |
| South Coast British Columbia Transportation Authority 1,60 % 03-07-2030 | Canada | Gouvernements provinciaux | 148 892 | 146 | 144 |
| Southwestern Energy Co. 5,38 % 15-03-2030 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 229 647 USD | 310 | 315 |
| Spa Holdings 3 Oy 4,88 % 04-02-2028 144A | Finlande | Sociétés – Non convertibles | 277 596 USD | 355 | 354 |
| Spa US HoldCo Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 12-03-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 264 978 USD | 337 | 337 |
| Specialty Pharma III Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 24-02-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 214 506 USD | 272 | 271 |
| Sprint Capital Corp. 6,88 % 15-11-2028 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 103 467 USD | 171 | 167 |
| Sprint Corp. 7,88 % 15-09-2023 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 227 124 USD | 325 | 322 |
| Sprint Corp. 7,13 % 15-06-2024 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 141 321 USD | 206 | 204 |
| Stitch Acquisition Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 27-07-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 307 879 USD | 363 | 367 |
| Summer (BC) Bidco B LLC 5,50 % 31-10-2026 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 227 124 USD | 297 | 295 |
| Summit Industrial Income Real Estate Investment Trust 2,44 % 14-07-2028 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 40 882 | 41 | 41 |
| Financière Sun Life inc., taux variable 13-08-2029, rachetables 2024 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 153 939 | 159 | 158 |
| Financière Sun Life inc., taux variable 10-05-2032, rachetables 2027 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 158 987 | 165 | 163 |
| Financière Sun Life inc., taux variable 01-10-2035 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 141 321 | 138 | 136 |
| Financière Sun Life inc., taux variable 30-06-2081 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 93 878 | 95 | 94 |
| Suncor Énergie Inc. 3,10 % 24-05-2029, rachetables 2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 194 317 | 204 | 202 |
| Suncor Énergie Inc. 3,95 % 04-03-2051 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 37 854 | 38 | 37 |
| Supérieur Plus S.E.C. 4,25 % 18-05-2028 144A | Canada | Sociétés – Non convertibles | 971 584 | 999 | 999 |
| Supérieur Plus S.E.C. 4,50 % 15-03-2029 144A | Canada | Sociétés – Non convertibles | 315 449 USD | 413 | 415 |
| Switch Ltd. 3,75 % 15-09-2028 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 328 067 USD | 426 | 423 |
| Tacora Resources Inc. 8,25 % 15-05-2026 144A | Canada | Sociétés – Non convertibles | 257 407 USD | 341 | 331 |
| Talen Energy Supply LLC 7,25 % 15-05-2027, rachetables 2022 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 136 274 USD | 156 | 163 |

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

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

Au 30 septembre 2021

(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) | Juste valeur \$ (en milliers) |
|---|------------|-----------------------------|---|--------------------------------|----------------------------------|
| OBLIGATIONS (suite) | | | | | |
| Talen Energy Supply LLC | | | | | |
| 6,63 % 15-01-2028, rachetables 2023 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 161 510 USD | 183 | 191 |
| Target Corp. 2,25 % 15-04-2025, rachetables 2025 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 75 708 USD | 101 | 100 |
| TELUS Corp. 2,35 % 27-01-2028, rachetables 2027 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 103 467 | 105 | 104 |
| TELUS Corp. 3,30 % 02-05-2029, rachetables 2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 201 888 | 216 | 213 |
| TELUS Corp. 3,15 % 19-02-2030, rachetables 2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 391 157 | 413 | 407 |
| TELUS Corp. 2,05 % 07-10-2030 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 151 416 | 145 | 143 |
| TELUS Corp. 2,85 % 13-11-2031 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 107 253 | 109 | 107 |
| Tencent Holdings Ltd. 2,39 % 03-06-2030, rachetables 2030 | Chine | Sociétés – Non convertibles | 73 184 USD | 92 | 91 |
| Tencent Music Entertainment Group | | | | | |
| 1,38 % 03-09-2025, rachetables 2025 | Chine | Sociétés – Non convertibles | 50 472 USD | 63 | 63 |
| Teneo Holdings LLC, | | | | | |
| prêt à terme B de premier rang, taux variable 12-07-2025 | États-Unis | Prêts à terme | 114 472 USD | 144 | 145 |
| Tenet Healthcare Corp. | | | | | |
| 4,88 % 01-01-2026, rachetables 2022 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 151 163 USD | 199 | 198 |
| Tenet Healthcare Corp. 6,13 % 01-10-2028 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 535 002 USD | 718 | 713 |
| Terex Corp. 5,00 % 15-05-2029 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 251 855 USD | 338 | 331 |
| TerraForm Power Operating LLC | | | | | |
| 5,00 % 31-01-2028, rachetables 2027 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 494 625 USD | 679 | 676 |
| TerraForm Power Operating LLC | | | | | |
| 4,75 % 15-01-2030, rachetables 2025 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 85 802 USD | 115 | 114 |
| Terrier Media Buyer Inc., | | | | | |
| prêt à terme B de premier rang, taux variable 17-12-2026 | États-Unis | Prêts à terme | 488 486 USD | 617 | 618 |
| Teva Pharmaceutical Industries Ltd. 2,80 % 21-07-2023 | Israël | Sociétés – Non convertibles | 784 838 USD | 982 | 987 |
| Thomson Reuters Corp. 2,24 % 14-05-2025, rachetables 2025 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 158 987 | 164 | 162 |
| Tianqi Finco Co. Ltd. 3,75 % 28-11-2022 | Chine | Sociétés – Non convertibles | 50 472 USD | 58 | 60 |
| Titan Sub LLC, | | | | | |
| prêt à terme B de premier rang, taux variable 19-09-2026 | États-Unis | Prêts à terme | 313 202 USD | 399 | 399 |
| T-Mobile USA Inc. 2,25 % 15-02-2026 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 105 991 USD | 138 | 136 |
| T-Mobile USA Inc. 2,25 % 15-02-2026 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 176 652 USD | 230 | 227 |
| T-Mobile USA Inc. 3,75 % 15-04-2027, cat. B | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 335 638 USD | 472 | 468 |
| T-Mobile USA Inc. 2,55 % 15-02-2031, cat. B | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 65 613 USD | 85 | 84 |
| Groupe TMX Ltée 2,30 % 11-12-2024, rachetables 2024 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 169 081 | 178 | 177 |
| Groupe TMX Ltée 3,78 % 05-06-2028, rachetables 2028 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 126 180 | 141 | 139 |
| Groupe TMX Ltée 2,02 % 12-02-2031 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 58 043 | 57 | 56 |
| La Banque Toronto-Dominion 2,85 % 08-03-2024 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 466 865 | 488 | 486 |
| La Banque Toronto-Dominion 1,94 % 13-03-2025 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 292 737 | 300 | 298 |
| La Banque Toronto-Dominion 1,13 % 09-12-2025 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 141 321 | 140 | 139 |
| La Banque Toronto-Dominion 1,89 % 08-03-2028 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 492 101 | 494 | 489 |
| La Banque Toronto-Dominion 1,90 % 11-09-2028 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 214 506 | 215 | 212 |
| La Banque Toronto-Dominion, | | | | | |
| taux variable 22-04-2030, rachetables 2025 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 214 253 | 226 | 225 |
| La Banque Toronto-Dominion, | | | | | |
| taux variable 26-01-2032, rachetables 2027 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 42 901 | 45 | 45 |
| La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-10-2081 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 278 857 | 275 | 278 |
| Tourmaline Oil Corp. 2,53 % 12-02-2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 43 911 | 44 | 44 |
| Crédit Toyota Canada Inc. 2,11 % 26-02-2025 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 5 047 | 5 | 5 |
| Crédit Toyota Canada Inc. 1,18 % 23-02-2026 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 95 897 | 95 | 94 |
| Toyota Motor Corp. 1,34 % 25-03-2026 | Japon | Sociétés – Non convertibles | 58 043 USD | 74 | 74 |
| TransCanada PipeLines Ltd. | | | | | |
| 3,30 % 17-07-2025, rachetables 2025, série MTN | Canada | Sociétés – Non convertibles | 30 788 | 33 | 33 |

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

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

Au 30 septembre 2021

(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) | Juste valeur \$ (en milliers) |
|--|------------|-----------------------------|---|--------------------------------|----------------------------------|
| OBLIGATIONS (suite) | | | | | |
| TransCanada PipeLines Ltd. 3,80 % 05-04-2027, rachetables 2027 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 426 488 | 466 | 461 |
| TransCanada PipeLines Ltd. 3,00 % 18-09-2029, rachetables 2029 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 302 832 | 316 | 312 |
| TransCanada PipeLines Ltd. 4,18 % 03-07-2048, rachetables 2048 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 32 807 | 34 | 33 |
| TransCanada PipeLines Ltd. 4,20 % 04-03-2081 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 245 294 | 245 | 243 |
| TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 1 612 578 | 1 691 | 1 678 |
| Transurban Finance Co. Pty. Ltd. 4,56 % 14-11-2028, rachetables 2028 | Australie | Sociétés – Non convertibles | 429 011 | 477 | 469 |
| Triton Water Holdings Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 16-03-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 211 452 USD | 267 | 268 |
| Trulieve Cannabis Corp. 9,75 % 18-06-2024 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 663 706 USD | 904 | 897 |
| Uber Technologies Inc. 8,00 % 01-11-2026, rachetables 2021 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 757 079 USD | 1 025 | 1 022 |
| Uber Technologies Inc. 4,50 % 15-08-2029 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 141 321 USD | 179 | 180 |
| Ultra Clean Holdings Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 27-08-2025 | États-Unis | Prêts à terme | 225 780 USD | 287 | 287 |
| Obligations du Trésor des États-Unis 0,88 % 15-11-2030 | États-Unis | Gouvernements étrangers | 13 249 USD | 16 | 16 |
| Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,25 % 15-02-2050 | États-Unis | Gouvernements étrangers | 2 604 856 USD | 4 120 | 3 930 |
| Uniti Group LP 6,50 % 15-02-2029 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 271 539 USD | 359 | 354 |
| Univision Communications Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 07-05-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 598 092 USD | 751 | 757 |
| UPC Broadband Finco BV 4,88 % 15-07-2031 144A | Pays-Bas | Sociétés – Non convertibles | 262 454 USD | 345 | 342 |
| Urban One Inc. 7,38 % 01-02-2028 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 126 180 USD | 174 | 172 |
| US Radiology Specialists Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 15-12-2027 | États-Unis | Prêts à terme | 175 327 USD | 224 | 223 |
| US Silica Holdings Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-05-2025 | États-Unis | Prêts à terme | 70 661 USD | 87 | 88 |
| Ventas Canada Finance Ltd. 2,55 % 15-03-2023, rachetables 2023 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 416 393 | 425 | 425 |
| Ventas Inc. 2,80 % 12-04-2024, rachetables 2024 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 138 798 | 144 | 144 |
| Veregy, prêt à terme de premier rang, taux variable 03-11-2027 | États-Unis | Prêts à terme | 205 383 USD | 262 | 261 |
| VeriFone Systems Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 09-08-2025 | États-Unis | Prêts à terme | 326 032 USD | 402 | 405 |
| Verizon Communications Inc. 2,38 % 22-03-2028 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 217 029 | 221 | 219 |
| Verizon Communications Inc. 2,50 % 16-05-2030, rachetables 2030 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 143 845 | 145 | 143 |
| Verizon Communications Inc. 1,75 % 20-01-2031 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 189 270 USD | 232 | 228 |
| Verizon Communications Inc. 2,55 % 21-03-2031 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 98 420 USD | 129 | 127 |
| Vertex Aerospace Services Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 29-06-2027 | États-Unis | Prêts à terme | 155 968 USD | 198 | 197 |
| Vesta Energy Corp. 8,13 % 24-07-2023, rachetables 2021 144A | Canada | Sociétés – Non convertibles | 290 214 | 241 | 245 |
| VFH Parent LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 01-03-2026 | États-Unis | Prêts à terme | 211 713 USD | 268 | 268 |
| Viad Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 27-07-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 239 742 USD | 302 | 304 |
| ViaSat Inc. 6,50 % 15-07-2028, rachetables 2023 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 166 557 USD | 224 | 223 |
| Vidéotron ltée 5,75 % 15-01-2026, rachetables 2021 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 227 124 | 233 | 232 |
| Vidéotron ltée 3,63 % 15-06-2028 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 595 569 | 600 | 599 |
| Vidéotron ltée 4,50 % 15-01-2030, rachetables 2024 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 227 124 | 238 | 237 |
| Vidéotron ltée 3,13 % 15-01-2031 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 749 508 | 709 | 706 |

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

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

Au 30 septembre 2021

(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) | Juste valeur \$ (en milliers) |
|---|-------------|-----------------------------|---|-----------------------------------|----------------------------------|
| OBLIGATIONS (suite) | | | | | |
| Vidéotron Itée 5,63 % 15-06-2025, rachetables 2025 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 1 710 241 | 1 887 | 1 883 |
| Virgin Media Secured Finance PLC 4,50 % 15-08-2030, rachetables 2025 144A | Royaume-Uni | Sociétés – Non convertibles | 133 751 USD | 175 | 173 |
| VistaJet Malta Finance PLC 10,50 % 01-06-2024, rachetables 2022 144A | Suisse | Sociétés – Non convertibles | 378 539 USD | 525 | 523 |
| VMED 02 UK Financing I PLC 4,25 % 31-01-2031 | Royaume-Uni | Sociétés – Non convertibles | 699 036 USD | 892 | 889 |
| VRX Escrow Corp. 6,13 % 15-04-2025, rachetables 2021 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 41 387 USD | 54 | 54 |
| VZ Vendor Financing BV 2,88 % 15-01-2029 | Pays-Bas | Sociétés – Non convertibles | 151 416 EUR | 224 | 220 |
| W&T Offshore Inc. 9,75 % 01-11-2023, rachetables 2021 144A | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 131 984 USD | 157 | 159 |
| Walmart Inc. 2,38 % 24-09-2029, rachetables 2029 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 23 217 USD | 32 | 31 |
| Waste Management of Canada Corp. 2,60 % 23-09-2026, rachetables 2026 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 272 548 | 286 | 283 |
| WDB Holding PA Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 18-12-2024 | États-Unis | Prêts à terme | 181 699 USD | 226 | 226 |
| Weatherford International PLC 11,00 % 01-12-2024, rachetables 2021 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 437 087 USD | 587 | 586 |
| Wells Fargo & Co. 2,57 % 01-05-2026, rachetables 2025 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 264 978 | 275 | 273 |
| Wells Fargo & Co. 2,98 % 19-05-2026 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 107 000 | 113 | 112 |
| Wells Fargo & Co. 2,49 % 18-02-2027 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 353 303 | 364 | 361 |
| Wells Fargo & Co., taux variable 15-03-2169 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 23 722 USD | 31 | 31 |
| Welltower Inc. 2,95 % 15-01-2027, rachetables 2026 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 65 613 | 69 | 68 |
| Welltower Inc. 4,25 % 15-04-2028, rachetables 2028 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 169 081 USD | 246 | 243 |
| Welltower Inc. 4,13 % 15-03-2029, rachetables 2028 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 164 034 USD | 237 | 234 |
| Whole Earth Brands Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 02-02-2026 | États-Unis | Prêts à terme | 292 005 USD | 369 | 368 |
| WildBrain Ltd. 5,88 % 30-09-2024, conv. | Canada | Sociétés – Convertibles | 146 369 | 143 | 146 |
| Women's Care Holdings Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 15-01-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 183 762 USD | 233 | 233 |
| W. R. Grace Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 11-08-2028 | États-Unis | Prêts à terme | 310 402 USD | 392 | 395 |
| Groupe WSP Global Inc. 2,41 % 19-04-2028 | Canada | Sociétés – Non convertibles | 121 133 | 123 | 121 |
| Xperi Holding Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-06-2025 | États-Unis | Prêts à terme | 177 188 USD | 224 | 224 |
| Xplornet Communications Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 29-05-2027 | Canada | Prêts à terme | 219 856 USD | 279 | 279 |
| YPF SA 6,95 % 21-07-2027 | Argentine | Sociétés – Non convertibles | 100 944 USD | 97 | 95 |
| Yum! Brands Inc. 3,63 % 15-03-2031 | États-Unis | Sociétés – Non convertibles | 73 184 USD | 96 | 94 |
| Ziggo BV 4,88 % 15-01-2030, rachetables 2024 144A | Pays-Bas | Sociétés – Non convertibles | 214 506 USD | 281 | 279 |
| Zotec Partners LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 14-02-2024 | États-Unis | Prêts à terme | 422 287 USD | 536 | 535 |
| Total des obligations | | | | 196 675 | 194 955 |
| ACTIONS | | | | | |
| AltaGas Ltd., priv., série K | Canada | Énergie | 27 585 | 703 | 702 |
| American Addiction Centers Holdings Inc. | États-Unis | Soins de santé | 14 295 | 181 | 181 |
| BCE Inc., priv., série AA | Canada | Services de communication | 4 074 | 75 | 78 |
| BCE Inc., priv., série AI | Canada | Services de communication | 16 877 | 318 | 321 |
| BCE Inc., priv., série AL | Canada | Services de communication | 13 784 | 240 | 246 |
| BCE Inc. 4,54 %, à div. cumulatif, rachetables, priv. de premier rang, série R, rachetables | Canada | Services de communication | 5 186 | 95 | 96 |

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

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

Au 30 septembre 2021

(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) | Juste valeur \$ (en milliers) |
|--|------------|------------------------------|---|--------------------------------|----------------------------------|
| ACTIONS (suite) | | | | | |
| Brookfield Asset Management Inc., priv., série 46 | Canada | Biens immobiliers | 14 875 | 381 | 380 |
| Brookfield Asset Management Inc., priv., série 48 | Canada | Biens immobiliers | 10 971 | 284 | 283 |
| Brookfield Renewable Partners L.P., priv., série 11 | Canada | Services publics | 46 774 | 1 209 | 1 218 |
| Brookfield Renewable Partners L.P., priv., série 13 | Canada | Services publics | 1 860 | 48 | 48 |
| Cenovus Energy Inc., priv., série 3 | Canada | Énergie | 4 674 | 103 | 108 |
| Cenovus Energy Inc., priv., série 7 | Canada | Énergie | 5 678 | 128 | 132 |
| Cenovus Energy Inc. 4,45 % 31-12-2049, priv., série 1 | Canada | Énergie | 3 737 | 59 | 60 |
| Columbia Care Inc., bons de souscription éch. 14-05-2023 | Canada | Soins de santé | 23 621 | 15 | 15 |
| Emera Inc., priv., série J | Canada | Services publics | 34 304 | 913 | 907 |
| Fairfax Financial Holdings Ltd., priv., série E | Canada | Services financiers | 5 905 | 101 | 104 |
| Fairfax Financial Holdings Ltd., priv., série F | Canada | Services financiers | 4 131 | 68 | 70 |
| Fannie Mae, priv., série S | États-Unis | Services financiers | 6 145 | 13 | 20 |
| Frontera Generation Holdings LLC | États-Unis | Énergie | 2 360 | 6 | 6 |
| iQor US Inc. | États-Unis | Technologie de l'information | 1 268 | 22 | 20 |
| Les Compagnies Loblaw Itée | | | | | |
| 5,30 %, à div. cumulatif, rachetables, priv. de second rang, série B | Canada | Consommation de base | 8 863 | 235 | 233 |
| Société Financière Manuvie, priv., série 13 | Canada | Services financiers | 17 377 | 418 | 425 |
| Corporation TC Énergie, priv., série 15 | Canada | Énergie | 40 890 | 1 046 | 1 050 |
| TransAlta Corp., priv., série A | Canada | Services publics | 54 341 | 783 | 793 |
| TransAlta Corp. | | | | | |
| 4,60 %, perpétuelles, priv., rachetables 2022, série C | Canada | Services publics | 10 142 | 190 | 189 |
| Westcoast Energy Inc. | | | | | |
| 5,20 %, à div. cumulatif, rachetables, priv. de premier rang, série 12 | Canada | Services publics | 20 200 | 511 | 505 |
| Total des actions | | | | 8 143 | 8 190 |
| OPTIONS | | | | | |
| Options achetées (se reporter au tableau des options achetées) | | | | 87 | 111 |
| Total des options | | | | 87 | 111 |
| Coûts de transaction | | | | | |
| Total des placements | | | | 204 905 | 203 255 |
| Instruments dérivés | | | | | |
| (se reporter au tableau des instruments dérivés) | | | | | 1 142 |
| Obligation pour options vendues (se reporter au tableau des options vendues) | | | | | (32) |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie | | | | | 22 309 |
| Autres éléments d'actif moins le passif | | | | | (3 949) |
| Actif net attribuable aux commanditaires | | | | | 222 725 |

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

APERÇU DU PORTEFEUILLE

| 30 septembre 2021 | | 31 mars 2021 | |
|--|------------|---|------------|
| Répartition effective du portefeuille | % de la VL | Répartition effective du portefeuille | % de la VL |
| Actions | 49,8 | Actions | 51,9 |
| Obligations | 44,7 | Obligations | 45,7 |
| Trésorerie et placements à court terme | 5,3 | <i>Obligations</i> | 45,6 |
| Fonds/billets négociés en bourse | 0,1 | <i>Positions vendeur sur contrats à terme</i> | 0,1 |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 0,1 | <i>Options achetées</i> | 0,0 |
| | | <i>Options vendues</i> | (0,0) |
| | | Trésorerie et placements à court terme | 3,1 |
| | | Fonds/billets négociés en bourse | 0,1 |
| | | Autres éléments d'actif (de passif) | (0,8) |
| Répartition régionale effective | % de la VL | Répartition régionale effective | % de la VL |
| Canada | 41,7 | Canada | 41,5 |
| États-Unis | 33,3 | États-Unis | 34,7 |
| Trésorerie et placements à court terme | 5,3 | Autre | 4,6 |
| Autre | 4,2 | Chine | 3,7 |
| Chine | 3,1 | Trésorerie et placements à court terme | 3,1 |
| France | 1,9 | France | 2,1 |
| Pays-Bas | 1,7 | Royaume-Uni | 1,9 |
| Japon | 1,5 | Pays-Bas | 1,7 |
| Suisse | 1,5 | Suisse | 1,6 |
| Royaume-Uni | 1,2 | Japon | 1,5 |
| Mexique | 1,1 | Allemagne | 1,1 |
| Allemagne | 1,0 | Mexique | 0,7 |
| Luxembourg | 0,8 | Irlande | 0,7 |
| Irlande | 0,7 | Taiwan | 0,7 |
| Russie | 0,5 | Luxembourg | 0,6 |
| Danemark | 0,4 | Russie | 0,6 |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 0,1 | Autres éléments d'actif (de passif) | (0,8) |
| Répartition sectorielle effective | % de la VL | Répartition sectorielle effective | % de la VL |
| Obligations de sociétés | 28,7 | Obligations de sociétés | 29,2 |
| Services financiers | 15,7 | Services financiers | 15,4 |
| Prêts à terme | 7,9 | Prêts à terme | 7,9 |
| Technologie de l'information | 6,1 | Technologie de l'information | 6,7 |
| Obligations d'État étrangères | 5,9 | Obligations d'État étrangères | 6,4 |
| Trésorerie et placements à court terme | 5,3 | Produits industriels | 5,1 |
| Produits industriels | 5,0 | Consommation de base | 4,5 |
| Énergie | 4,3 | Énergie | 3,8 |
| Matériaux | 4,0 | Services de communication | 3,7 |
| Consommation discrétionnaire | 3,7 | Consommation discrétionnaire | 3,7 |
| Services de communication | 3,3 | Matériaux | 3,2 |
| Soins de santé | 3,1 | Soins de santé | 3,2 |
| Consommation de base | 2,9 | Trésorerie et placements à court terme | 3,1 |
| Autre | 1,6 | Obligations fédérales | 1,2 |
| Services publics | 1,3 | Autre | 1,9 |
| Obligations provinciales | 1,1 | Services publics | 1,8 |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 0,1 | Autres éléments d'actif (de passif) | (0,8) |

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 2021

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 2021 et 2020 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 2021, 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. Avant le 1^{er} janvier 2021, Corporation Financière Mackenzie (« Mackenzie ») était le gestionnaire du Fonds. Le 1^{er} janvier 2021, Mackenzie, le gestionnaire et fiduciaire du Fonds, a été remplacée par GPCV. Mackenzie est également une filiale de Power Corporation du Canada. GPCV a conclu une convention d'administration de fonds avec Mackenzie. 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 2021. 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 16 novembre 2021.

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.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

NOTES ANNEXES

3. Principales méthodes comptables (suite)

a) Instruments financiers (suite)

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 des 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 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.

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. Pour de plus amples renseignements à cet égard, notamment sur les modalités de telles dispenses, le cas échéant, se reporter à la rubrique « Dispenses de l'application des dispositions du Règlement 81-102 » de la notice annuelle du Fonds.

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 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).

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

NOTES ANNEXES

3. Principales méthodes comptables (suite)

b) Évaluation de la juste valeur (suite)

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 2021.

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

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

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

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

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

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

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

Voir la note 10 pour le classement 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 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.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

NOTES ANNEXES

3. Principales méthodes comptables (suite)

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 The Bank of New York Mellon (l'« agent de prêt de titres »). 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, et présente un rapprochement des revenus de prêt de titres, 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 si le FNB a un droit exécutoire de compenser les montants comptabilisés et qu'il a l'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(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.

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.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

NOTES ANNEXES

3. Principales méthodes comptables (suite)

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.

La transformation qui s'opère à l'échelle internationale et la propagation de la COVID-19 ont continué de peser sur l'économie mondiale et ont alimenté la volatilité des marchés financiers. L'effet négatif de la pandémie de COVID-19 sur les marchés mondiaux et le rendement du Fonds est susceptible de persister.

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 fiducie de fonds commun de placement en vertu des dispositions de la Loi de l'impôt sur le revenu (Canada). Par conséquent, il est assujéti à l'impôt pour ce qui est de ses 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 2021

NOTES ANNEXES

5. Impôts sur les bénéfiques (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

Pour chaque série applicable, le Fonds a versé des frais de gestion et d'administration (les « frais d'administration ») à Mackenzie pour la période allant du 1^{er} avril 2020 au 31 décembre 2020 (la « période précédant le changement de gestionnaire ») et à GPCV par la suite aux taux annuels spécifiés à la rubrique Constitution du Fonds et renseignements sur les séries du présent rapport et décrits en détail dans le prospectus.

Les frais de gestion ont été utilisés par Mackenzie durant la période précédant le changement de gestionnaire et par GPCV après la période précédant le changement de gestionnaire pour la gestion du portefeuille de placement, l'analyse des placements, la formulation de recommandations, la prise de décisions quant aux placements, la prise de dispositions de courtage pour l'achat et la vente du portefeuille de placement 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.

Après la période précédant le changement de gestionnaire, GPCV a versé 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 bénéfiques), 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 2021 et 2020 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 2021, 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.

NOTES ANNEXES

8. Risques découlant des instruments financiers (suite)

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.

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 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.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

NOTES ANNEXES

8. Risques découlant des instruments financiers (suite)

v. Autre risque de prix (suite)

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 les fonds sous-jacents ou les 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.

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 2021

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.

Séries distribuées par Services d'investissement Quadrus Itée (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. Avant le 19 août 2021, les titres des séries A, T5 et T8 étaient connus sous le nom des séries Q, D5 et D8, respectivement. Avant le 14 août 2020, les titres de série Q étaient connus sous le nom de série Quadrus.

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. Avant le 19 août 2021, les titres des séries F, F5 et F8 étaient connus sous le nom des séries H, H5 et H8, respectivement.

Les titres des séries FW, FW5 et FW8 sont offerts aux investisseurs à valeur nette élevée qui investissent un minimum de 100 000 \$ et qui satisfont aux exigences de placement minimales de 500 000 \$, 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 FW5 et FW8 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % et de 8 % par année, respectivement. Avant le 19 août 2021, les titres des séries FW, FW5 et FW8 étaient connus sous le nom des séries HW, HW5 et HW8, respectivement.

Les titres des séries N, N5 et N8 sont offerts aux investisseurs qui investissent un minimum de 100 000 \$, 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 100 000 \$ 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 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 100 000 \$ 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. Avant le 19 août 2021, les titres des séries W, W5 et W8 étaient connus sous le nom des séries L, L5 et L8, 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 ou avec frais modérés sont payables à Mackenzie 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.

[†] Depuis le 19 août 2021, le mode de souscription avec frais d'acquisition 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 de la Canada Vie achetés antérieurement selon le mode de souscription avec frais d'acquisition ou le mode de souscription avec frais modérés contre des titres d'un autre Fonds de la Canada Vie, selon le même mode d'acquisition, demeureront possibles.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

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 ⁴⁾ | 8 juillet 2013 | 1,85 % | 0,21 % |
| Série F ⁴⁾ | 16 juillet 2013 | 0,85 % | 0,15 % |
| Série F5 ⁴⁾ | 17 octobre 2014 | 0,85 % | 0,15 % |
| Série F8 ⁴⁾ | 16 août 2019 | 0,85 % | 0,15 % |
| Série FW ⁴⁾ | 7 août 2018 | 0,55 % | 0,15 % |
| Série FW5 ⁴⁾ | 7 août 2018 | 0,55 % | 0,15 % |
| Série FW8 ⁴⁾ | 16 août 2019 | 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 S | 16 août 2019 | — ³⁾ | 0,03 % |
| Série T5 ⁴⁾ | 9 septembre 2013 | 1,85 % | 0,21 % |
| Série T8 ⁴⁾ | 13 août 2019 | 1,85 % | 0,21 % |
| Série W ⁴⁾ | 22 août 2013 | 1,55 % | 0,15 % |
| Série W5 ⁴⁾ | 1 ^{er} septembre 2015 | 1,55 % | 0,15 % |
| Série W8 ⁴⁾ | 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 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 19 août 2021, les titres des séries A, F, F5, F8, FW, FW5, FW8, T5, T8, W, W5 et W8 étaient connus sous le nom des séries Q, H, H5, H8, HW, HW5, HW8, D5, D8, L, L5 et L8, respectivement. Avant le 14 août 2020, les titres de série Q étaient connus sous le nom de série Quadrus.

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 Itée (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 données comparatives du Fonds représentent la participation proportionnelle des séries de Canada Vie en ce qui concerne l'actif net, les résultats d'exploitation et les variations de l'actif net du Fonds Mackenzie. Dans le même ordre d'idées, 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 courante du Fonds reflètent la participation proportionnelle des séries de Canada Vie du Fonds Mackenzie.

b) Placements détenus par Canada Vie, GPCV et des sociétés affiliées

Au 30 septembre 2021, Canada Vie et des fonds distincts gérés par Canada Vie détenaient un placement de 24 \$ et 168 902 \$ (néant et 150 789 \$ au 31 mars 2021), respectivement, dans le Fonds.

c) Reports prospectifs de pertes

Puisque le Fonds a été lancé le 17 mars 2021, il n'a pas encore eu de fin d'année d'imposition et n'a donc aucune perte en capital ni autre qu'en capital disponible pour un report prospectif aux fins de l'impôt.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

NOTES ANNEXES

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

d) Prêt de titres

Au 30 septembre 2021 et au 31 mars 2021, la valeur des titres prêtés et des biens reçus en garantie s'établissait comme suit :

| | 30 septembre 2021 | 31 mars 2021 |
|------------------------------------|-------------------|--------------|
| | (\$) | (\$) |
| Valeur des titres prêtés | – | 10 654 |
| Valeur des biens reçus en garantie | – | 11 316 |

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.

Le rapprochement du montant brut provenant des opérations de prêts de titres avec les revenus de prêts de titres du Fonds pour les périodes closes les 30 septembre 2021 et 2020 est présenté ci-après :

| | 2021 | | 2020 | |
|---------------------------------------|------|-------|------|--------|
| | (\$) | (%) | (\$) | (%) |
| Revenus de prêts de titres bruts | 3 | 100,0 | 38 | 100,0 |
| Impôt retenu à la source | – | – | (4) | (9,6) |
| | 3 | 100,0 | 34 | 90,4 |
| Paiements à l'agent de prêt de titres | – | – | (6) | (16,3) |
| Revenu tiré du prêt de titres | 3 | 100,0 | 28 | 74,1 |

e) Commissions

| | (\$) |
|-------------------|------|
| 30 septembre 2021 | – |
| 30 septembre 2020 | 20 |

f) Compensation d'actifs et de passifs financiers

Au 30 septembre 2021, aucun montant ne faisait l'objet d'une compensation.

Le tableau ci-après présente 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.

| | 31 mars 2021 | | | |
|--|---|--------------------------------------|------------------|------------------|
| | Montant brut des actifs (passifs) (\$) | Disponible pour compensation (\$) | Couvertures (\$) | Montant net (\$) |
| Profits latents sur les contrats dérivés | 771 | (124) | – | 647 |
| Pertes latentes sur les contrats dérivés | (240) | 124 | 939 | 823 |
| Obligation pour options vendues | (29) | – | – | (29) |
| Total | 502 | – | 939 | 1 441 |

g) 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.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

NOTES ANNEXES

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

g) Risques découlant des instruments financiers (suite)

ii. Risque de change

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

| 30 septembre 2021 | | | | |
|-------------------|--------------------|--|--------------------------------|------------------------------|
| Devise | Placements (\$) | Trésorerie et placements à court terme (\$) | Instruments dérivés (\$) | Exposition nette* (\$) |
| USD | 96 495 | 417 | – | 96 912 |
| EUR | 20 749 | 3 | – | 20 752 |
| CNY | 13 405 | – | – | 13 405 |
| JPY | 8 739 | – | – | 8 739 |
| CHF | 7 742 | – | – | 7 742 |
| HKD | 3 002 | – | – | 3 002 |
| DKK | 2 515 | – | – | 2 515 |
| GBP | 1 465 | – | – | 1 465 |
| SEK | 1 403 | – | – | 1 403 |
| BRL | 1 111 | – | – | 1 111 |
| Total | 156 626 | 420 | – | 157 046 |
| % de l'actif net | 26,3 | 0,1 | – | 26,4 |

| 31 mars 2021 | | | | |
|------------------|--------------------|--|--------------------------------|------------------------------|
| Devise | Placements (\$) | Trésorerie et placements à court terme (\$) | Instruments dérivés (\$) | Exposition nette* (\$) |
| EUR | 23 857 | – | (2 191) | 21 666 |
| CNY | 14 022 | 92 | – | 14 114 |
| JPY | 7 892 | – | – | 7 892 |
| CHF | 7 699 | – | – | 7 699 |
| NTD | 3 421 | – | – | 3 421 |
| HKD | 3 393 | – | – | 3 393 |
| RUB | 2 245 | – | – | 2 245 |
| DKK | 1 930 | – | – | 1 930 |
| ZAR | 1 369 | – | – | 1 369 |
| MXN | 1 164 | – | – | 1 164 |
| SEK | 1 354 | (223) | – | 1 131 |
| INR | 1 121 | – | – | 1 121 |
| BRL | 1 113 | – | – | 1 113 |
| GBP | 1 979 | – | – | 1 979 |
| USD | 186 292 | 1 070 | (93 501) | 93 861 |
| Total | 258 850 | 939 | (95 692) | 164 097 |
| % de l'actif net | 48,3 | 0,2 | (17,8) | 30,7 |

* Comprend les instruments financiers monétaires et non monétaires.

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

NOTES ANNEXES

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

g) Risques découlant des instruments financiers (suite)

ii. Risque de change (suite)

Au 30 septembre 2021, si le dollar canadien avait connu une hausse ou une baisse de 5 % relativement à toutes les devises, toute autre variable demeurant constante, l'actif net aurait diminué ou augmenté d'environ 9 285 \$ ou 1,6 % du total de l'actif net (8 779 \$ ou 1,6 % au 31 mars 2021). En pratique, les résultats réels de négociation peuvent différer et l'écart pourrait être important.

iii. Risque de taux d'intérêt

Le tableau ci-après résume 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.

| Durée jusqu'à l'échéance | 30 septembre 2021 (\$) | | 31 mars 2021 (\$) | |
|--------------------------|------------------------|---------------------|-------------------|---------------------|
| | Obligations | Instruments dérivés | Obligations | Instruments dérivés |
| Moins de 1 an | – | – | 324 | (46 382) |
| 1 an à 5 ans | 7 164 | – | 59 427 | – |
| 5 ans à 10 ans | 12 285 | – | 104 761 | – |
| Plus de 10 ans | 816 | – | 32 847 | – |
| Total | 20 265 | – | 197 359 | (46 382) |

Au 30 septembre 2021, si les taux d'intérêt en vigueur avaient connu une hausse de 1 %, la courbe des taux évoluant en parallèle et toute autre variable demeurant constante, l'actif net aurait diminué d'environ 13 853 \$ ou 2,3 % du total de l'actif net (35 911 \$ ou 1,6 % au 31 mars 2021). De même, si les taux d'intérêt en vigueur avaient connu une baisse de 1 %, la courbe des taux évoluant en parallèle et toute autre variable demeurant constante, l'actif net aurait augmenté d'environ 13 956 \$ ou 2,3 % du total de l'actif net (35 911 \$ ou 1,6 % au 31 mars 2021). En pratique, les résultats réels de négociation peuvent différer et l'écart pourrait être important.

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 2021 | 29 746 | 5,0 | (29 746) | (5,0) |
| 31 mars 2021 | 27 864 | 5,2 | (27 864) | (5,2) |

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 2021 était de 2,3 % de l'actif net du Fonds (2,4 % au 31 mars 2021).

Au 30 septembre 2021 et au 31 mars 2021, les titres de créance par note de crédit étaient les suivants :

| Note des obligations* | 30 septembre 2021 | 31 mars 2021 |
|-----------------------|-------------------|------------------|
| | % de l'actif net | % de l'actif net |
| AAA | – | 1,7 |
| AA | – | 2,0 |
| A | 2,3 | 4,8 |
| BBB | 0,1 | 7,7 |
| Inférieure à BBB | 0,8 | 17,8 |
| Sans note | 0,2 | 2,8 |
| Total | 3,4 | 36,8 |

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

FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2021

NOTES ANNEXES

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

h) Classement de la juste valeur

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

| | 30 septembre 2021 | | | | 31 mars 2021 | | | |
|-------------------------------------|-------------------|------------------|------------------|----------------|------------------|------------------|------------------|----------------|
| | Niveau 1 (\$) | Niveau 2 (\$) | Niveau 3 (\$) | Total (\$) | Niveau 1 (\$) | Niveau 2 (\$) | Niveau 3 (\$) | Total (\$) |
| Obligations | – | 20 265 | – | 20 265 | 499 | 196 860 | – | 197 359 |
| Actions | 235 010 | 45 615 | – | 280 625 | 222 820 | 51 608 | 170 | 274 597 |
| Options | – | – | – | – | – | 66 | – | 66 |
| Fonds/billets négociés en bourse | 50 422 | – | – | 50 422 | 43 096 | – | – | 43 096 |
| Fonds communs de placement | 234 320 | – | – | 234 320 | 11 269 | – | – | 11 269 |
| Actifs dérivés | – | – | – | – | 362 | 810 | – | 1 172 |
| Passifs dérivés | – | – | – | – | – | (593) | – | (593) |
| Placements à court terme | – | 6 616 | – | 6 616 | – | 11 956 | – | 11 956 |
| Total | 519 752 | 72 496 | – | 592 248 | 278 046 | 260 708 | 170 | 538 923 |

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 2021, 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 2021, ces titres étaient classés dans le niveau 2 (niveau 2 au 31 mars 2021).

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 2021 et le 31 mars 2021 :

| | 30 septembre 2021 | 31 mars 2021 |
|--|-------------------|--------------|
| | Actions (\$) | Actions (\$) |
| Solde, à l'ouverture | 170 | – |
| Achats | – | 172 |
| Ventes | (174) | – |
| Transferts entrants | – | – |
| Transferts sortants | – | – |
| Profits (pertes) au cours de la période : | | |
| Réalisé(e)s | (1) | – |
| Latent(e)s | 5 | (2) |
| Solde, à la clôture | – | 170 |
| Variation des profits (pertes) latent(e)s au cours de la période attribuables aux titres détenus à la clôture de la période | – | (2) |

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