

## **États financiers intermédiaires non audités**

*Pour la période de six mois close le 30 septembre 2022*

*Les présents états financiers intermédiaires non audités ne contiennent pas le rapport intermédiaire de la direction sur le rendement du Fonds (« RDRF ») du fonds d'investissement. Vous pouvez obtenir un exemplaire du RDRF intermédiaire gratuitement en composant le 1-888-532-3322, en écrivant à l'adresse 255, avenue Dufferin, London (Ontario) N6A 4K1, en visitant notre site Web à [www.placementscanadavie.com](http://www.placementscanadavie.com) ou celui de SEDAR à [www.sedar.com](http://www.sedar.com). Des exemplaires des états financiers annuels ou du RDRF annuel peuvent aussi être obtenus gratuitement des façons décrites ci-dessus.*

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

### **AVIS DE NON-AUDIT DES ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES**

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

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

# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

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

	30 sept. 2022	31 mars 2022 (Audité)
	\$	\$
<b>ACTIF</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements à la juste valeur	21 512	19 806
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1 848	3 755
Intérêts courus à recevoir	137	121
Sommes à recevoir pour placements vendus	83	257
Sommes à recevoir pour titres émis	2	31
Marge sur instruments dérivés	19	262
Actifs dérivés	226	573
<b>Total de l'actif</b>	<b>23 827</b>	<b>24 805</b>
<b>PASSIF</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Sommes à payer pour placements achetés	8	57
Sommes à payer pour titres rachetés	29	5
Passifs dérivés	1 085	84
<b>Total du passif</b>	<b>1 122</b>	<b>146</b>
<b>Actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>22 705</b>	<b>24 659</b>

## ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

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

	2022 \$	2021 \$
<b>Revenus</b>		
Dividendes	13	16
Revenu d'intérêts	545	363
Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets		
Profit (perte) net(te) réalisé(e)	(513)	(434)
Profit (perte) net(te) latent(e)	(1 732)	542
Revenu tiré du prêt de titres	1	–
Revenu provenant des rabais sur les frais	1	1
<b>Total des revenus (pertes)</b>	<b>(1 685)</b>	<b>488</b>
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	32	32
Rabais sur les frais de gestion	(1)	(1)
Frais d'administration	6	5
Commissions et autres coûts de transaction liés au portefeuille	6	7
Frais du comité d'examen indépendant	–	–
<b>Charges avant les montants absorbés par le gestionnaire</b>	<b>43</b>	<b>43</b>
Charges absorbées par le gestionnaire	–	–
<b>Charges nettes</b>	<b>43</b>	<b>43</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, avant impôt</b>	<b>(1 728)</b>	<b>445</b>
Charge (économie) d'impôt étranger retenu à la source	1	–
Impôt étranger sur le résultat payé (recouvré)	–	–
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation</b>	<b>(1 729)</b>	<b>445</b>

### Actif net attribuable aux porteurs de titres (note 3)

	par titre		par série	
	30 sept. 2022	31 mars 2022 (Audité)	30 sept. 2022	31 mars 2022 (Audité)
Série A	8,82	9,71	1 540	1 691
Série F	8,82	9,72	1 188	486
Série FW	–	9,76	–	627
Série I	8,84	9,74	7 941	8 733
Série N	8,70	9,59	386	432
Série QF	8,72	9,62	195	230
Série QFW	8,73	9,62	324	772
Série R	8,28	9,12	1	1
Série S	8,66	9,54	10 060	10 443
Série W	8,83	9,73	1 070	1 244
			<b>22 705</b>	<b>24 659</b>

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

	par titre		par série	
	2022	2021	2022	2021
Série A	(0,74)	0,10	(130)	16
Série F	(1,02)	0,17	(57)	9
Série FW	(0,45)	0,15	(30)	13
Série I	(0,66)	0,21	(596)	206
Série N	(0,66)	0,21	(30)	8
Série QF	(0,70)	0,11	(17)	3
Série QFW	(0,73)	0,15	(47)	4
Série R	(0,62)	0,19	–	–
Série S	(0,64)	0,19	(731)	172
Série W	(0,75)	0,12	(91)	14
			<b>(1 729)</b>	<b>445</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE LA SITUATION FINANCIÈRE

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

	Total		Série A		Série F		Série FW	
	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>								
<b>À l'ouverture</b>	<b>24 659</b>	<b>22 929</b>	<b>1 691</b>	<b>1 500</b>	<b>486</b>	<b>701</b>	<b>627</b>	<b>879</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(1 729)	445	(130)	16	(57)	9	(30)	13
Distributions aux porteurs de titres :								
Revenu de placement	(578)	(322)	(27)	(9)	(10)	(5)	(11)	(8)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–
Rabais sur les frais de gestion	(1)	(1)	(1)	(1)	–	–	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	(579)	(323)	(28)	(10)	(10)	(5)	(11)	(8)
Opérations sur les titres :								
Produit de l'émission de titres	3 014	6 334	228	319	803	67	3	–
Réinvestissement des distributions	579	321	28	9	10	5	11	8
Paiements au rachat de titres	(3 239)	(5 637)	(249)	(238)	(44)	(285)	(600)	–
Total des opérations sur les titres	354	1 018	7	90	769	(213)	(586)	8
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>(1 954)</b>	<b>1 140</b>	<b>(151)</b>	<b>96</b>	<b>702</b>	<b>(209)</b>	<b>(627)</b>	<b>13</b>
<b>À la clôture</b>	<b>22 705</b>	<b>24 069</b>	<b>1 540</b>	<b>1 596</b>	<b>1 188</b>	<b>492</b>	<b>–</b>	<b>892</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>			<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>
Titres en circulation, à l'ouverture			174	151	50	70	64	88
Émis			25	32	89	7	–	–
Réinvestissement des distributions			3	1	1	–	1	1
Rachetés			(27)	(24)	(5)	(28)	(65)	–
Titres en circulation, à la clôture			175	160	135	49	–	89

	Série I		Série N		Série QF		Série QFW	
	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>								
<b>À l'ouverture</b>	<b>8 733</b>	<b>9 332</b>	<b>432</b>	<b>682</b>	<b>230</b>	<b>142</b>	<b>772</b>	<b>220</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	(596)	206	(30)	8	(17)	3	(47)	4
Distributions aux porteurs de titres :								
Revenu de placement	(217)	(147)	(10)	(7)	(4)	(2)	(12)	(2)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	(217)	(147)	(10)	(7)	(4)	(2)	(12)	(2)
Opérations sur les titres :								
Produit de l'émission de titres	587	3 183	62	132	15	141	6	20
Réinvestissement des distributions	217	146	10	7	4	2	12	2
Paiements au rachat de titres	(783)	(3 609)	(78)	(381)	(33)	(84)	(407)	(35)
Total des opérations sur les titres	21	(280)	(6)	(242)	(14)	59	(389)	(13)
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>(792)</b>	<b>(221)</b>	<b>(46)</b>	<b>(241)</b>	<b>(35)</b>	<b>60</b>	<b>(448)</b>	<b>(11)</b>
<b>À la clôture</b>	<b>7 941</b>	<b>9 111</b>	<b>386</b>	<b>441</b>	<b>195</b>	<b>202</b>	<b>324</b>	<b>209</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>			<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>	<b>Titres</b>
Titres en circulation, à l'ouverture	896	933	45	69	24	14	80	22
Émis	64	316	7	14	2	14	1	3
Réinvestissement des distributions	23	14	1	1	–	–	1	–
Rachetés	(85)	(357)	(9)	(39)	(4)	(8)	(45)	(4)
Titres en circulation, à la clôture	898	906	44	45	22	20	37	21

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

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

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

	Série R		Série S		Série W	
	2022	2021	2022	2021	2022	2021
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>						
<b>À l'ouverture</b>	<b>1</b>	<b>1</b>	<b>10 443</b>	<b>8 107</b>	<b>1 244</b>	<b>1 365</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	–	–	(731)	172	(91)	14
Distributions aux porteurs de titres :						
Revenu de placement	–	–	(268)	(134)	(19)	(8)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–
Total des distributions aux porteurs de titres	–	–	(268)	(134)	(19)	(8)
Opérations sur les titres :						
Produit de l'émission de titres	–	–	1 240	2 361	70	111
Réinvestissement des distributions	–	–	268	134	19	8
Paievements au rachat de titres	–	–	(892)	(793)	(153)	(212)
Total des opérations sur les titres	–	–	616	1 702	(64)	(93)
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(383)</b>	<b>1 740</b>	<b>(174)</b>	<b>(87)</b>
<b>À la clôture</b>	<b>1</b>	<b>1</b>	<b>10 060</b>	<b>9 847</b>	<b>1 070</b>	<b>1 278</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>	<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>	
Titres en circulation, à l'ouverture	–	–	1 095	828	128	137
Émis	–	–	136	238	7	11
Réinvestissement des distributions	–	–	29	14	2	1
Rachetés	–	–	(98)	(80)	(16)	(21)
Titres en circulation, à la clôture	–	–	1 162	1 000	121	128

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

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

	2022	2021
	\$	\$
<b>Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation	(1 729)	445
Ajustements pour :		
Perte (profit) net(te) réalisé(e) sur les placements	1 151	351
Variation de la perte (du profit) net(te) latent(e) sur les placements	1 765	(542)
Achat de placements	(9 771)	(19 928)
Produit de la vente et de l'échéance de placements	6 567	15 237
(Augmentation) diminution des sommes à recevoir et autres actifs	227	(116)
<b>Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités d'exploitation</b>	<b>(1 790)</b>	<b>(4 553)</b>
<b>Flux de trésorerie liés aux activités de financement</b>		
Produit de l'émission de titres	2 398	6 371
Paiements au rachat de titres	(2 570)	(5 626)
Distributions versées, déduction faite des réinvestissements	–	(2)
<b>Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités de financement</b>	<b>(172)</b>	<b>743</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>	<b>(1 962)</b>	<b>(3 810)</b>
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à l'ouverture	3 755	5 002
Incidence des fluctuations des taux de change sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie	55	4
<b>Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture</b>	<b>1 848</b>	<b>1 196</b>
Trésorerie	1 848	1 196
Équivalents de trésorerie	–	–
<b>Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture</b>	<b>1 848</b>	<b>1 196</b>
<b>Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :</b>		
Dividendes reçus	13	16
Impôts étrangers payés	1	–
Intérêts reçus	529	334
Intérêts versés	–	–

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## TABLEAU DES PLACEMENTS

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N <sup>bre</sup> d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS</b>					
407 International Inc. 1,80 % 22-05-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	9
407 International Inc. 4,22 % 14-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	22 000	22	21
407 International Inc. 3,14 % 06-03-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	9
407 International Inc. 2,59 % 25-05-2032, rachetables 2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 000	5	4
407 International Inc. 3,43 % 01-06-2033, série MTN	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 000	5	4
407 International Inc. 4,19 % 25-04-2042, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 000	3	3
407 International Inc. 3,67 % 08-03-2049, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 000	4	3
ADS Tactical Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 04-03-2028	États-Unis	Prêts à terme	9 250 USD	11	12
Advantage Sales & Marketing Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 28-10-2027	États-Unis	Prêts à terme	9 825 USD	13	12
Aéroports de Montréal 3,92 % 12-06-2045, rachetables 2044	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 000	3	3
Al Aqua Merger Sub Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 30-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	1 222 USD	1	2
AIMCo Realty Investors LP 2,20 % 04-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	16 000	16	15
Albertsons Cos. Inc. 4,63 % 15-01-2027, rachetables 2023 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000 USD	28	25
Algonquin Power & Utilities Corp. 2,85 % 15-07-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	21 000	21	18
Algonquin Power & Utilities Corp., taux variable 18-01-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	17
Alimentation Couche-Tard inc. 2,95 % 25-01-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 USD	13	11
Alphabet Inc. 1,90 % 15-08-2040	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	133 000 USD	127	118
Alphabet Inc. 2,05 % 15-08-2050, rachetables 2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	167 000 USD	147	138
AltaGas Ltd. 2,17 % 16-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	11 000	11	10
AltaGas Ltd., taux variable 11-01-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	12 000	12	10
AltaLink, L.P. 1,51 % 11-09-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	8
American Tower Corp. 1,88 % 15-10-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000 USD	13	10
Anglian Water Services Financing PLC 4,53 % 26-08-2032	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	15 000	15	14
AP Core Holdings II LLC, prêt à terme B2 de premier rang, taux variable 21-07-2027	États-Unis	Prêts à terme	16 000 USD	20	21
Apple Inc. 3,35 % 10-01-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	40 000 AUD	39	35
Apple Inc. 2,65 % 11-05-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	178 000 USD	175	161
Apple Inc. 2,65 % 08-02-2051	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	120 000 USD	119	109
ARC Resources Ltd. 2,35 % 10-03-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	19 000	19	17
ARC Resources Ltd. 3,47 % 10-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	17
Ascend Wellness Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 27-08-2025	États-Unis	Prêts à terme	10 000 USD	13	12
Ashton Woods USA LLC 4,63 % 01-04-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	2 000 USD	3	2
AT&T Inc. 5,10 % 25-11-2048, rachetables 2048	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	7 000	7	6
Athene Global Funding, taux variable 09-04-2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	42 000	42	42
Athene Global Funding 3,13 % 10-03-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	16 000	16	15
Athene Global Funding 2,10 % 24-09-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	18
Bank of America Corp., taux variable 15-09-2027 (taux variable différé)	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	7 000	7	6
Bank of America Corp., taux variable 16-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	19 000	19	18
Bank of America Corp., taux variable 04-04-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	16 000	16	14
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	44 000	44	44
BCE Inc. 2,20 % 29-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	17
bclMC Realty Corp. 1,06 % 12-03-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	9
bclMC Realty Corp. 1,07 % 04-02-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	14 000	14	12
bclMC Realty Corp. 1,75 % 24-07-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	8
BCPE Cycle Merger Sub II Inc. 10,63 % 15-07-2027, rachetables 2022	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	5 000 USD	7	3
Bell Canada Inc. 3,60 % 29-09-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	21	19
Broadcast Media Partners 4,50 % 01-05-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	5 000 USD	6	6
Brookfield Infrastructure Finance ULC 3,41 % 09-10-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000	39	36
Brookfield Infrastructure Finance ULC 2,86 % 01-09-2032, rachetables 2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	8
Brookfield Renewable Energy Partners ULC 3,63 % 15-01-2027, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	18 000	19	17
Brookfield Renewable Partners ULC 4,25 % 15-01-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000	40	38
Brookfield Renewable Partners ULC 4,29 % 05-11-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	8
Brookfield Residential Properties Inc. 5,13 % 15-06-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	7 000	7	6
BWAY Holding Co. 7,25 % 15-04-2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	52 000 USD	67	63

# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N <sup>bre</sup> d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Canadian Core Real Estate LP 3,30 % 02-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	18 000	18	17
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 21-04-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	37 000	37	33
Canadian Natural Resources Ltd. 2,50 % 17-01-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	18
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 2,54 % 28-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	42 000	42	37
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 3,15 % 13-03-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000	129	108
Capital Power Corp. 4,42 % 08-02-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000	134	113
Capital Power Corp. 3,15 % 01-10-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	15 000	15	12
Capital Power Corp., taux variable 09-09-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	9 000	9	9
Cascades inc. 5,13 % 15-01-2026, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 000 USD	7	6
Cenovus Energy Inc. 3,50 % 07-02-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000	40	37
Cenovus Energy Inc. 3,75 % 15-02-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	58 000 USD	58	54
Groupe CGI inc. 2,10 % 18-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	11 000	11	9
Charter Communications Operating LLC 2,80 % 01-04-2031, rachetables 2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000 USD	28	21
Charter Communications Operating LLC 2,30 % 01-02-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000 USD	26	20
Charter Communications Operating LLC 3,50 % 01-06-2041	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000 USD	13	9
Chevron U.S.A. Inc. 2,34 % 12-08-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	116 000 USD	107	98
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 2,46 % 30-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	9 000	9	8
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 4,18 % 08-03-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	64 000	72	60
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 6,00 % 24-06-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	14 000	14	14
Ville d'Oslo, taux variable 06-05-2026	Norvège	Gouvernements étrangers	1 000 000 NOK	155	126
The Clorox Co. 1,80 % 15-05-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	15 000 USD	21	16
Cogeco Communications inc. 2,99 % 22-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	13 000	13	11
Cologix Data Centers Issuer LLC 4,94 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	5 000	5	5
Cologix Data Centers Issuer LLC 5,68 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	4 000	4	4
Columbia Care Inc. 6,00 % 29-06-2025, conv.	Canada	Sociétés – Convertibles	5 000 USD	6	7
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	8 016	8	7
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-09-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	8 050	8	7
Corus Entertainment Inc. 5,00 % 11-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	6 000	6	5
Covis Finco SARL, prêt à terme B de premier rang, taux variable 14-02-2027	Luxembourg	Prêts à terme	11 850 USD	14	13
CPPIB Capital Inc. 1,95 % 30-09-2029	Canada	Gouvernement fédéral	30 000	30	26
Creation Technologies Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 24-09-2028	Canada	Prêts à terme	15 960 USD	20	18
Fonds de placement immobilier Crombie 3,92 % 21-06-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 000	5	5
Fonds de placement immobilier Crombie 3,21 % 09-10-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000	123	100
Fonds de placement immobilier Crombie 3,13 % 12-08-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	8 000	8	6
Curaleaf Holdings Inc. 8,00 % 15-12-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000 USD	26	25
République fédérale d'Allemagne, obligations indexées sur l'inflation, 0,10 % 15-04-2046	Allemagne	Gouvernements étrangers	100 000 EUR	232	168
Dollarama inc. 1,51 % 20-09-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 000	5	4
Domtar Corp. 6,75 % 01-10-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000 USD	13	11
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 1,66 % 22-12-2025 (A)	Canada	Sociétés – Non convertibles	135 000	135	120
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,54 % 07-12-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	12 000	12	11
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,06 % 17-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	13 000	13	11
Electronic Arts Inc. 2,95 % 15-02-2051	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	58 000 USD	55	53
Empire Communities Corp. 7,38 % 15-12-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	9
L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie 3,63 % 17-04-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 000	1	1
Enbridge Inc. 3,10 % 21-09-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	27 000	27	22
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000	47	46
Enbridge Inc., taux variable 12-04-2078, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	19
Énergir inc. 2,10 % 16-04-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	9
Énergir S.E.C. 4,67 % 27-09-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	14 000	14	14
EPCOR Utilities Inc. 3,11 % 08-07-2049, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	15
EPCOR Utilities Inc. 4,73 % 02-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	19 000	19	19
The Estée Lauder Cos. Inc. 1,95 % 15-03-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	14 000 USD	18	15
Exxon Mobil Corp. 3,10 % 16-08-2049	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	116 000 USD	119	112

# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N <sup>bre</sup> d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,23 % 14-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	9
Fairfax Financial Holdings Ltd. 3,95 % 03-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	35 000	35	30
Flynn America LP, prêt à terme B de premier rang, taux variable 23-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	13 738 USD	17	17
Compagnie Crédit Ford du Canada 2,96 % 16-09-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	9 000	9	8
Ford Motor Credit Co. LLC 6,78 % 15-09-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	33 000	33	33
Fortified Trust 2,34 % 23-01-2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	110 000	110	109
Fortified Trust 3,76 % 23-06-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	29 000	29	28
Fortified Trust 1,96 % 23-10-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	37 000	37	33
Fortis Inc. 4,43 % 31-05-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	24 000	24	23
Foxtrot Escrow Issuer LLC 12,25 % 15-11-2026, rachetables 2022	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	8 000 USD	10	9
FXI Holdings Inc. 7,88 % 01-11-2024, rachetables 2022	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	89 000 USD	109	97
GFL Environmental Inc. 3,50 % 01-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 USD	13	12
Gibson Energy Inc. 3,60 % 17-09-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	15 000	15	13
Gibson Energy Inc., taux variable 22-12-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	15 000	15	13
The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 30-11-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	36 000	36	32
The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 28-02-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	40 000	40	34
Gouvernement de l'Argentine 1,00 % 09-07-2029 SEDOL BLN8K52	Argentine	Gouvernements étrangers	146 USD	–	–
Gouvernement de l'Argentine, taux variable 09-07-2035	Argentine	Gouvernements étrangers	260 000 USD	111	66
Gouvernement de l'Argentine 0,13 % 09-07-2035	Argentine	Gouvernements étrangers	3 906 USD	–	1
Gouvernement de l'Australie 1,75 % 21-06-2051	Australie	Gouvernements étrangers	400 000 AUD	216	216
Gouvernement de la Belgique 0,80 % 22-06-2028	Belgique	Gouvernements étrangers	100 000 EUR	149	124
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2029	Brésil	Gouvernements étrangers	50 000 BRL	168	118
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2031	Brésil	Gouvernements étrangers	50 000 BRL	149	116
Gouvernement du Canada 0,50 % 01-12-2030	Canada	Gouvernement fédéral	118 000	95	95
Gouvernement du Canada 1,50 % 01-06-2031	Canada	Gouvernement fédéral	35 000	34	31
Gouvernement du Canada 1,75 % 01-12-2053	Canada	Gouvernement fédéral	1 473 000	1 212	1 082
Gouvernement de l'Allemagne 0 % 15-08-2052	Allemagne	Gouvernements étrangers	500 000 EUR	547	367
Gouvernement du Mexique 5,75 % 05-03-2026	Mexique	Gouvernements étrangers	1 000 000 MXN	61	60
Gouvernement du Mexique 2,66 % 24-05-2031	Mexique	Gouvernements étrangers	300 000 USD	362	317
Gouvernement du Mexique 7,75 % 29-05-2031	Mexique	Gouvernements étrangers	2 300 000 MXN	170	140
Gouvernement du Mexique 8,00 % 07-11-2047	Mexique	Gouvernements étrangers	4 000 000 MXN	294	232
Fiducie de placement immobilier Granite 2,19 % 30-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	17
Gray Television Inc. 5,38 % 15-11-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	15 000 USD	19	16
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 2,73 % 03-04-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000	128	108
Fonds de placement immobilier H&R 2,91 % 02-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	9
Fonds de placement immobilier H&R 2,63 % 19-02-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	18
Hadrian Merger Sub Inc. 8,50 % 01-05-2026, rachetables 2022	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	30 000 USD	38	38
Hadrian Merger Sub Inc. 8,50 % 01-05-2026, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	30 000 USD	38	38
Heathrow Funding Ltd. 2,69 % 13-10-2027	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	26 000	26	23
Heathrow Funding Ltd. 3,79 % 04-09-2030, rachetables 2030	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	200 000	197	179
Heathrow Funding Ltd. 3,73 % 13-04-2033	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	13 000	13	11
Compagnie Home Trust 5,32 % 13-06-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	20
Honda Canada Finance Inc., taux variable 26-02-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	24 000	24	24
Honda Canada Finance Inc. 1,34 % 17-03-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	9
Honda Canada Finance Inc. 1,65 % 25-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	17
Hunter Douglas Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 09-02-2029	Pays-Bas	Prêts à terme	21 000 USD	26	24
Hydro One Inc. 1,69 % 16-01-2031, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	95 000	92	76
Hydro One Inc. 2,23 % 17-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	71 000	71	59
Hydro One Ltd. 1,41 % 15-10-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	9
iA Société financière inc., taux variable 25-02-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000	40	37
L'Ordre Indépendant des Forestiers, taux variable 15-10-2035, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	8
Indy US Bidco LLC, prêt à terme B3 de premier rang, taux variable 05-03-2028	États-Unis	Prêts à terme	9 850 USD	13	12
INEOS Enterprises Holdings US Finco LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 03-09-2026	États-Unis	Prêts à terme	7 972 USD	10	10
Intact Corporation financière 5,46 % 22-09-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000 USD	13	13
Intact Corporation financière, taux variable 31-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 000	5	4
Inter Pipeline Ltd. 3,48 % 16-12-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	9	9
Inter Pipeline Ltd. 4,23 % 01-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000	42	38



# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N <sup>bre</sup> d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Inter Pipeline Ltd. 3,98 % 25-11-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	110 000	110	95
Inter Pipeline Ltd. 5,85 % 18-05-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	21 000	21	21
Inter Pipeline Ltd., taux variable 26-03-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	9
Inter Pipeline Ltd., taux variable 19-11-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	19
Société Financière Internationale 7,00 % 20-07-2027	Supranationales	s.o.	400 000 MXN	28	25
Société Financière Internationale 7,50 % 18-01-2028	Supranationales	s.o.	1 000 000 MXN	71	62
ION Trading Finance Ltd., prêt à terme B de premier rang, taux variable 26-03-2028	Irlande	Prêts à terme	9 875 EUR	15	12
Ivanhoe Cambridge II Inc. 2,91 % 27-06-2023, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	80 000	79	79
Ivanhoe Cambridge II Inc. 2,30 % 12-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	9
Jadex Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 12-02-2028	États-Unis	Prêts à terme	19 552 USD	25	25
JPMorgan Chase & Co. 1,90 % 05-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	41 000	41	36
Keyera Corp. 3,96 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000	130	107
Keyera Corp., taux variable 13-06-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	10
Keyera Corp., taux variable 10-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	16 000	16	14
Knight Health Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 17-12-2028	États-Unis	Prêts à terme	12 935 USD	15	13
KP Germany Erste GmbH, prêt à terme B de premier rang, taux variable 04-02-2026	Allemagne	Prêts à terme	10 000 EUR	15	12
Produits Kruger S.E.C. 5,38 % 09-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 000	3	3
LABL Escrow Issuer LLC 6,75 % 15-07-2026, rachetables 2022	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	6 000 USD	8	8
Liberty Utilities (Canada) LP 3,32 % 14-02-2050, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	7
Les Compagnies Loblaw Itée 4,49 % 11-12-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	11	10
Les Compagnies Loblaw Itée 2,28 % 07-05-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	17
Les Compagnies Loblaw Itée 5,01 % 13-09-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	17 000	17	17
Les Compagnies Loblaw Itée 5,34 % 13-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	13 000	13	13
LogMeln Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 14-08-2027	États-Unis	Prêts à terme	9 825 USD	13	9
Lower Mattagami Energy LP 2,43 % 14-05-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	17 000	17	15
LSF10 XL Bidco SCA, prêt à terme B de premier rang, taux variable 30-03-2028	Luxembourg	Prêts à terme	8 535 EUR	13	9
Banque Manuvie du Canada 1,54 % 14-09-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	26 000	26	23
Société Financière Manuvie, taux variable 19-03-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	16
Société Financière Manuvie, taux variable 19-06-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	22 000	22	22
Mastercard Inc. 1,90 % 15-03-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	8 000 USD	10	9
Mav Acquisition Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 21-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	7 845 USD	10	10
Microsoft Corp. 2,53 % 01-06-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	300 000 USD	289	272
Minerva Merger Sub Inc. 6,50 % 15-02-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000 USD	13	11
Mozart Debt Merger Sub Inc. 3,88 % 01-04-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	29 000 USD	37	32
Mozart Debt Merger Sub Inc. 5,25 % 01-10-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	11 000 USD	14	12
National Grid Electricity Transmission PLC 2,30 % 22-06-2029	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	28 000	28	24
Natural Resource Partners LP 9,13 % 30-06-2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	90 000 USD	115	127
NAV CANADA 2,06 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	8
Nestlé Holdings Inc. 2,19 % 26-01-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	17
Nexstar Escrow Inc. 5,63 % 15-07-2027, rachetables 2022	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	6 000 USD	8	8
Nine Energy Service Inc. 8,75 % 01-11-2023, rachetables 2022 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	73 000 USD	64	78
North West Redwater Partnership 2,80 % 01-06-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	38 000	38	32
Nova Scotia Power Inc. 3,57 % 05-04-2049, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	8
NVIDIA Corp. 3,50 % 01-04-2050, rachetables 2049	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	58 000 USD	64	59
OMERS Finance Trust 2,60 % 14-05-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	18
Ontario Power Generation Inc. 2,98 % 13-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	9 000	9	8
Ontario Teachers' Finance Trust 1,10 % 19-10-2027	Canada	Gouvernements provinciaux	10 000	10	9
Corporation Parkland du Canada 3,88 % 16-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	48 000	48	43
Corporation Parkland 4,38 % 26-03-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 000	5	4
Corporation Pétroles Parkland 6,00 % 23-06-2028, rachetables 2023	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	19
PayPal Holdings Inc. 2,65 % 01-10-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000 USD	13	13
PayPal Holdings Inc. 2,30 % 01-06-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000 USD	14	11
Pembina Pipeline Corp. 4,02 % 27-03-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000	33	28
Pembina Pipeline Corp. 3,62 % 03-04-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	18
Pembina Pipeline Corp. 3,31 % 01-02-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	110 000	116	96
Pembina Pipeline Corp., taux variable 25-01-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	17
Petróleos Mexicanos 5,95 % 28-01-2031 144A	Mexique	Sociétés – Non convertibles	126 000 USD	147	118

# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N <sup>bre</sup> d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Petróleo Mexicanos 6,70 % 16-02-2032	Mexique	Sociétés – Non convertibles	99 000 USD	125	97
Pioneer Natural Resources Co. 2,15 % 15-01-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	58 000 USD	63	62
Plaze Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 03-08-2026	États-Unis	Prêts à terme	9 825 USD	13	12
Pluto Acquisition I Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 20-06-2026	États-Unis	Prêts à terme	12 870 USD	16	16
Province de l'Alberta 1,65 % 01-06-2031	Canada	Gouvernements provinciaux	20 000	19	17
Province de l'Alberta 3,10 % 01-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	89 000	90	74
Province de l'Ontario 3,75 % 02-06-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	217 000	213	215
Province de Québec 3,65 % 20-05-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	39 000	39	38
Province de Québec 3,10 % 01-12-2051	Canada	Gouvernements provinciaux	4 000	4	3
PSP Capital Inc. 2,05 % 15-01-2030	Canada	Gouvernement fédéral	4 000	4	4
PSP Capital Inc. 2,60 % 01-03-2032	Canada	Gouvernement fédéral	30 000	30	27
Quasar Intermediate Holdings Ltd., prêt à terme B de premier rang, taux variable 20-01-2029	États-Unis	Prêts à terme	15 000 USD	19	15
Reliance LP 2,68 % 01-12-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	9
Reliance LP 2,67 % 01-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	18 000	18	15
Rogers Communications Inc. 3,10 % 15-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	9
Rogers Communications Inc. 3,75 % 15-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	47 000	47	43
Rogers Communications Inc. 5,25 % 15-04-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	9 000	9	8
Rogers Communications Inc., taux variable 15-03-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	9 000 USD	11	11
R.R. Donnelley & Sons Co. 6,13 % 01-11-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	5 000 USD	6	6
Sagen MI Canada Inc. 3,26 % 05-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	15 000	15	12
Sagen MI Canada Inc., taux variable 24-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	11 000	11	9
Saputo inc. 2,88 % 19-11-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	10
Saputo inc. 1,42 % 19-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	17
Saputo inc. 2,24 % 16-06-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	15 000	15	13
Saputo inc. 2,30 % 22-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	4 000	4	3
Shaw Communications Inc. 2,90 % 09-12-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	58 000	59	48
Sienna Senior Living Inc. 3,11 % 04-11-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 000	5	5
Sienna Senior Living Inc. 3,45 % 27-02-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	9
Sienna Senior Living Inc. 2,82 % 31-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000	125	107
Signal Parent Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-04-2028	États-Unis	Prêts à terme	9 875 USD	12	10
Silgan Holdings Inc. 4,13 % 01-02-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	5 000 USD	7	6
Sinclair Television Group Inc. 5,13 % 15-02-2027, rachetables 2022	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000 USD	12	11
SmartCentres Real Estate Investment Trust 3,19 % 11-06-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	9
SmartCentres Real Estate Investment Trust 3,83 % 21-12-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	7 000	7	6
South Coast British Columbia Transportation Authority 1,60 % 03-07-2030	Canada	Administrations municipales	20 000	20	17
Spa US HoldCo Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 12-03-2028	États-Unis	Prêts à terme	9 876 USD	12	13
Specialty Pharma III Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 24-02-2028	États-Unis	Prêts à terme	9 900 USD	12	13
Stitch Acquisition Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 27-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	11 880 USD	14	14
Summit Industrial Income Real Estate Investment Trust 1,82 % 01-04-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	9
Summit Industrial Income Real Estate Investment Trust 2,25 % 12-01-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	9
Summit Industrial Income Real Estate Investment Trust 2,44 % 14-07-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	129 000	130	110
Financière Sun Life inc., taux variable 21-11-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	36 000	36	31
Financière Sun Life inc., taux variable 10-08-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	22 000	22	21
Financière Sun Life inc., taux variable 01-10-2035	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	16
Financière Sun Life inc., taux variable 30-06-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	21 000	21	17
Suncor Énergie Inc. 3,10 % 24-05-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	18
Suncor Énergie Inc. 3,75 % 04-03-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	58 000 USD	61	57
Suncor Énergie Inc. 3,95 % 04-03-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	7 000	7	5
Sunset Debt Merger Sub Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 17-09-2028	États-Unis	Prêts à terme	23 940 USD	30	26
Suzano SA 3,75 % 15-01-2031	Brésil	Sociétés – Non convertibles	10 000 USD	14	11

# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N <sup>bre</sup> d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Target Corp. 2,25 % 15-04-2025, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000 USD	14	13
TELUS Corp. 2,35 % 27-01-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	9
TELUS Corp. 3,30 % 02-05-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	7 000	7	6
TELUS Corp. 3,15 % 19-02-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	17
TELUS Corp. 2,05 % 07-10-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	8
TELUS Corp. 5,25 % 15-11-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	33 000	33	33
Teranet Holdings LP 3,72 % 23-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000	40	36
Thevelia (US) LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 10-02-2029	États-Unis	Prêts à terme	9 000 USD	11	12
Thomson Reuters Corp. 2,24 % 14-05-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	19
Timber Servicios Empresariales SA, prêt à terme B de premier rang, taux variable 17-02-2029	Espagne	Prêts à terme	7 000 EUR	10	8
T-Mobile USA Inc. 3,50 % 15-04-2025, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000 USD	14	13
T-Mobile USA Inc. 3,75 % 15-04-2027, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	50 000 USD	71	64
T-Mobile USA Inc. 2,55 % 15-02-2031, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000 USD	14	11
T-Mobile USA Inc. 2,25 % 15-11-2031, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000 USD	26	21
T-Mobile USA Inc. 5,20 % 15-01-2033	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000 USD	26	26
Groupe TMX Ltée 2,02 % 12-02-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	9 000	9	7
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-10-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	33 000	33	33
Tourmaline Oil Corp. 2,53 % 12-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	9
Crédit Toyota Canada Inc. 1,18 % 23-02-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	33 000	32	29
Toyota Motor Corp. 1,34 % 25-03-2026	Japon	Sociétés – Non convertibles	10 000 USD	13	12
TransCanada PipeLines Ltd. 3,80 % 05-04-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	20 000	22	19
TransCanada PipeLines Ltd. 4,18 % 03-07-2048, rachetables 2048	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 000	3	2
TransCanada PipeLines Ltd. 4,20 % 04-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	37 000	37	30
TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000	200	180
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2023	États-Unis	Gouvernements étrangers	600 000 USD	995	1 055
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,50 % 15-04-2024	États-Unis	Gouvernements étrangers	600 000 USD	906	948
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-10-2026	États-Unis	Gouvernements étrangers	1 200 000 USD	1 718	1 678
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-04-2027	États-Unis	Gouvernements étrangers	600 000 USD	787	767
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,38 % 15-07-2027	États-Unis	Gouvernements étrangers	400 000 USD	627	626
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,25 % 15-07-2029	États-Unis	Gouvernements étrangers	700 000 USD	1 064	1 011
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2031	États-Unis	Gouvernements étrangers	900 000 USD	1 341	1 237
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2032	États-Unis	Gouvernements étrangers	800 000 USD	1 122	1 022
Obligations du Trésor des États-Unis 2,75 % 15-08-2032	États-Unis	Gouvernements étrangers	23 000 USD	29	29
Obligations du Trésor des États-Unis 2,38 % 15-02-2042	États-Unis	Gouvernements étrangers	47 000 USD	53	50
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,25 % 15-02-2050	États-Unis	Gouvernements étrangers	190 000 USD	313	199
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2051	États-Unis	Gouvernements étrangers	90 000 USD	143	88
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052	États-Unis	Gouvernements étrangers	700 000 USD	887	649
Obligations du Trésor des États-Unis 2,25 % 15-02-2052	États-Unis	Gouvernements étrangers	38 000 USD	44	38
Obligations du Trésor des États-Unis 3,00 % 15-08-2052	États-Unis	Gouvernements étrangers	11 000 USD	13	13
Ventas Canada Finance Ltd. 2,45 % 04-01-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	13 000	13	12
Ventas Canada Finance Ltd. 3,30 % 01-12-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	17 000	17	14
Ventas Inc. 2,80 % 12-04-2024, rachetables 2024	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	20 000	20	19
Veregy, prêt à terme de premier rang, taux variable 03-11-2027	États-Unis	Prêts à terme	9 825 USD	13	13
Verizon Communications Inc., taux variable 20-03-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	12 000 USD	15	16
Verizon Communications Inc. 2,38 % 22-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	32 000	32	28
Verizon Communications Inc. 2,50 % 16-05-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	16 000	16	13
Verizon Communications Inc. 2,55 % 21-03-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	19 000 USD	23	21
Vidéotron Itée 3,63 % 15-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	24 000	24	20
Vidéotron Itée 4,50 % 15-01-2030, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000	30	26
Visa Inc. 2,00 % 15-08-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	116 000 USD	99	93

# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

au 30 septembre 2022

	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N <sup>bre</sup> d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Walgreens Boots Alliance Inc. 3,20 % 15-04-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000 USD	14	12
Weatherford International Ltd. 8,63 % 30-04-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	120 000 USD	149	145
Wells Fargo & Co. 2,57 % 01-05-2026, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	10 000	10	9
Wells Fargo & Co. 2,98 % 19-05-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	5 000	5	5
Wells Fargo & Co., taux variable 15-03-2169	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	7 000 USD	9	8
WireCo WorldGroup Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 29-10-2028	États-Unis	Prêts à terme	10 639 USD	13	14
Groupe WSP Global Inc. 2,41 % 19-04-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	21 000	21	18
<b>Total des obligations</b>				<b>23 195</b>	<b>20 959</b>
<b>ACTIONS</b>					
BCE Inc., priv., série AA	Canada	Services de communication	404	6	7
BCE Inc., priv., série AI	Canada	Services de communication	59	1	1
BCE Inc. 4,54 %, à div. cumulatif, rachetables, priv. de premier rang, série R, rachetables	Canada	Services de communication	403	7	6
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 46	Canada	Biens immobiliers	223	6	5
Brookfield Renewable Partners L.P., priv., série 13	Canada	Services publics	187	5	4
Cenovus Energy Inc., priv., série 3	Canada	Énergie	100	2	2
Cenovus Energy Inc., priv., série 7	Canada	Énergie	1 100	22	22
Emera Inc., priv., série L	Canada	Services publics	370	9	7
Intelsat Jackson Holdings SA, A, bons de souscription éch. 05-12-2025	Luxembourg	Services de communication	70	–	1
Intelsat Jackson Holdings SA, B, bons de souscription éch. 05-12-2025	Luxembourg	Services de communication	70	–	–
Intelsat Jackson Holdings SA	Luxembourg	Services de communication	676	29	31
Les Compagnies Loblaw Itée 5,30 %, à div. cumulatif, rachetables, priv. de second rang, série B	Canada	Consommation de base	58	2	1
TransAlta Corp., priv., Série A	Canada	Services publics	243	3	3
TransAlta Corp. 4,60 %, perpétuelles, priv., rachetables 2022, série C	Canada	Services publics	110	2	2
<b>Total des actions</b>				<b>94</b>	<b>92</b>
<b>OPTIONS</b>					
Options achetées (se reporter au tableau des options achetées)				6	4
<b>Total des options</b>				<b>6</b>	<b>4</b>
<b>FONDS/BILLETS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>					
<sup>1</sup> FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	6 238	612	457
<b>Total des fonds/billets négociés en bourse</b>				<b>612</b>	<b>457</b>
Coûts de transaction				(3)	–
<b>Total des placements</b>				<b>23 904</b>	<b>21 512</b>
Instruments dérivés (se reporter au tableau des instruments dérivés)					(859)
Trésorerie et équivalents de trésorerie					1 848
Autres éléments d'actif moins le passif					204
<b>Actif net attribuable aux porteurs de titres</b>					<b>22 705</b>

<sup>1</sup> Ce fonds négocié en bourse est géré par une société affiliée à GPCV.

# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## APERÇU DU PORTEFEUILLE

30 SEPTEMBRE 2022

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	94,4
<i>Obligations</i>	92,3
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)</i>	1,4
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)</i>	0,7
Trésorerie et placements à court terme	6,7
Fonds/billets négociés en bourse	2,0
Actions	0,4
Options sur devises achetées	–
Autres éléments d'actif (de passif)	(3,5)

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	56,6
Canada	27,6
Trésorerie et placements à court terme	6,7
Mexique	4,5
Allemagne	2,4
Royaume-Uni	1,1
Brésil	1,1
Australie	1,0
Autre	0,7
Norvège	0,6
Belgique	0,5
Argentine	0,3
Luxembourg	0,2
Pays-Bas	0,1
Irlande	0,1
Autres éléments d'actif (de passif)	(3,5)

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations d'État étrangères	51,8
Obligations de sociétés	32,4
Trésorerie et placements à court terme	6,7
Obligations fédérales	5,6
Fonds/billets négociés en bourse	2,0
Prêts à terme	1,8
Obligations provinciales	1,6
Autre	0,7
Obligations supranationales	0,4
Services financiers	0,3
Services de communication	0,1
Obligations municipales	0,1
Autres éléments d'actif (de passif)	(3,5)

31 MARS 2022

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	79,7
<i>Obligations</i>	77,5
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)</i>	1,4
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)</i>	0,8
<i>Options achetées</i>	0,0
Trésorerie et placements à court terme	13,8
Autres éléments d'actif (de passif)	3,7
Fonds/billets négociés en bourse	2,2
Actions	0,6
Options sur devises achetées	0,0

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	48,7
Canada	21,6
Trésorerie et placements à court terme	13,8
Mexique	4,5
Autres éléments d'actif (de passif)	3,7
Autre	1,2
Royaume-Uni	1,1
Brésil	1,0
Bahamas	0,9
Allemagne	0,9
Luxembourg	0,7
Norvège	0,6
Belgique	0,6
Argentine	0,4
Russie	0,3

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations d'État étrangères	47,1
Obligations de sociétés	24,4
Trésorerie et placements à court terme	13,8
Prêts à terme	4,2
Autres éléments d'actif (de passif)	3,7
Fonds/billets négociés en bourse	2,2
Obligations provinciales	1,5
Obligations fédérales	1,3
Autre	0,8
Services financiers	0,5
Obligations supranationales	0,3
Services de communication	0,1
Obligations municipales	0,1

# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## TABLEAU DES OPTIONS ACHETÉES

au 30 septembre 2022

Élément sous-jacent	Nombre de contrats	Type d'option	Date d'échéance	Prix d'exercice \$	Prime payée (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
Option de vente sur devises JPY/MXN	17 600 000	Vente	4 janvier 2023	5,95 JPY	6	4
<b>Total des options</b>					<b>6</b>	<b>4</b>

# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS

au 30 septembre 2022

### Tableau des contrats à terme standardisés

Type de contrat	Nombre de contrats	Date d'échéance	Prix moyen des contrats (\$)	Montant notionnel* (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
Contrats à terme standardisés sur obligations Euro-Bobl, décembre 2022	(12)	8 décembre 2022	122,59 EUR	(1 947)	46	–
Contrats à terme standardisés sur euro-obligations à long terme du gouvernement italien (BTP), décembre 2022	(6)	8 décembre 2022	117,50 EUR	(910)	45	–
Contrats à terme standardisés sur obligations Euro-Schatz, décembre 2022	(16)	8 décembre 2022	108,05 EUR	(2 323)	19	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans, décembre 2022	(5)	13 décembre 2022	148,34 JPY	(7 080)	2	–
Contrats à terme standardisés à très long terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans, décembre 2022	2	20 décembre 2022	125,71 USD	328	–	(20)
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor américain à 5 ans, décembre 2022	(9)	20 décembre 2022	111,23 USD	(1 338)	46	–
<b>Total des contrats à terme standardisés</b>				<b>(13 270)</b>	<b>158</b>	<b>(20)</b>

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

### Tableau des contrats de change à terme de gré à gré

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	13 AUD	(7) USD	4 octobre 2022	9	8	–	(1)
A	6 USD	(13) AUD	4 octobre 2022	(8)	(8)	–	–
A	287 CAD	(158) USD	4 octobre 2022	(208)	(224)	–	(16)
A	151 USD	(287) CAD	4 octobre 2022	208	210	2	–
A	50 CHF	(37) USD	4 octobre 2022	51	50	–	(1)
A	37 USD	(50) CHF	4 octobre 2022	(51)	(51)	–	–
A	48 EUR	(35) USD	4 octobre 2022	48	46	–	(2)
A	34 USD	(48) EUR	4 octobre 2022	(47)	(47)	–	–
A	126 GBP	(106) USD	4 octobre 2022	147	139	–	(8)
A	102 USD	(126) GBP	4 octobre 2022	(141)	(141)	–	–
A	67 USD	(12 800) JPY	4 octobre 2022	(93)	(87)	6	–
A	12 800 JPY	(64) USD	4 octobre 2022	88	88	–	–
A	88 USD	(1 200) NOK	4 octobre 2022	(121)	(106)	15	–
A	1 200 NOK	(80) USD	4 octobre 2022	110	110	–	–
A	41 USD	(93) NZD	4 octobre 2022	(57)	(50)	7	–
A	93 NZD	(38) USD	4 octobre 2022	53	52	–	(1)
A	75 USD	(1 090) SEK	4 octobre 2022	(103)	(97)	6	–
A	1 090 SEK	(71) USD	4 octobre 2022	98	98	–	–
A	146 CAD	(110) EUR	21 octobre 2022	(146)	(149)	–	(3)
A	20 EUR	(26) CAD	21 octobre 2022	26	27	1	–
A	20 EUR	(26) CAD	21 octobre 2022	26	27	1	–
A	24 EUR	(32) CAD	21 octobre 2022	32	33	1	–
A	10 EUR	(13) CAD	21 octobre 2022	13	13	–	–
A	500 CAD	(8 025) MXN	21 octobre 2022	(500)	(549)	–	(49)
A	11 CAD	(173) MXN	21 octobre 2022	(11)	(12)	–	(1)
A	355 MXN	(24) CAD	21 octobre 2022	24	24	–	–
A	129 CAD	(1 000) NOK	21 octobre 2022	(129)	(127)	2	–
A	487 CAD	(375) USD	21 octobre 2022	(487)	(518)	–	(31)
A	5 154 CAD	(4 000) USD	21 octobre 2022	(5 154)	(5 526)	–	(372)
AA	210 USD	(285) CAD	21 octobre 2022	285	290	5	–
A	10 USD	(14) CAD	21 octobre 2022	14	14	–	–
A	230 USD	(316) CAD	21 octobre 2022	316	317	1	–
A	28 CAD	(22) USD	28 octobre 2022	(28)	(30)	–	(2)
AA	201 USD	(260) CAD	28 octobre 2022	260	278	18	–

# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

au 30 septembre 2022

### Tableau des contrats de change à terme de gré à gré (suite)

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
AA	103 CAD	(80) USD	28 octobre 2022	(103)	(110)	–	(7)
A	215 AUD	(100) USD	2 novembre 2022	138	137	–	(1)
A	300 CAD	(158) USD	2 novembre 2022	(217)	(218)	–	(1)
A	127 USD	(172) CHF	2 novembre 2022	(175)	(175)	–	–
A	82 USD	(116) EUR	2 novembre 2022	(114)	(114)	–	–
A	113 GBP	(91) USD	2 novembre 2022	126	126	–	–
A	97 USD	(19 400) JPY	2 novembre 2022	(134)	(134)	–	–
A	1 USD	(10) NOK	2 novembre 2022	(1)	(1)	–	–
A	4 USD	(10) NZD	2 novembre 2022	(6)	(6)	–	–
A	97 USD	(1 480) SEK	2 novembre 2022	(134)	(134)	–	–
A	449 CAD	(340) EUR	4 novembre 2022	(449)	(461)	–	(12)
AA	379 CAD	(293) USD	4 novembre 2022	(379)	(405)	–	(26)
AA	1 042 CAD	(805) USD	4 novembre 2022	(1 042)	(1 112)	–	(70)
A	36 CAD	(40) AUD	9 novembre 2022	(36)	(36)	–	–
A	222 CAD	(250) AUD	9 novembre 2022	(222)	(221)	1	–
A	100 000 COP	(16) USD	9 novembre 2022	22	21	–	(1)
A	3 900 INR	(35) USD	9 novembre 2022	48	47	–	(1)
A	12 USD	(80) PLN	9 novembre 2022	(17)	(16)	1	–
A	290 ZAR	(12) USD	9 novembre 2022	17	16	–	(1)
AA	13 CAD	(10) EUR	18 novembre 2022	(13)	(13)	–	–
AA	241 CAD	(182) EUR	18 novembre 2022	(241)	(247)	–	(6)
AA	30 EUR	(40) CAD	18 novembre 2022	40	41	1	–
AA	30 EUR	(41) CAD	18 novembre 2022	41	41	–	–
A	107 CAD	(83) USD	18 novembre 2022	(107)	(115)	–	(8)
A	3 690 CAD	(2 872) USD	18 novembre 2022	(3 690)	(3 965)	–	(275)
AA	2 461 CAD	(1 870) USD	13 janvier 2023	(2 461)	(2 580)	–	(119)
A	1 646 CAD	(1 230) USD	20 janvier 2023	(1 646)	(1 696)	–	(50)
<b>Total des contrats de change à terme de gré à gré</b>						<b>68</b>	<b>(1 065)</b>
<b>Total des actifs dérivés</b>							<b>226</b>
<b>Total des passifs dérivés</b>							<b>(1 085)</b>



# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## NOTES ANNEXES

### 1. Périodes comptables et renseignements généraux

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

Le Fonds a été constitué en fiducie de fonds commun de placement à capital variable en vertu des lois de la province de l'Ontario aux termes d'une déclaration de fiducie qui a été modifiée et mise à jour de temps à autre. Le siège social du Fonds est situé au 255, avenue Dufferin, London (Ontario) Canada. Le Fonds est autorisé à émettre un nombre illimité de parts (désignées en tant que « titre » ou « titres ») de séries multiples. Les séries du Fonds sont offertes à la vente aux termes d'un prospectus simplifié ou aux termes d'options de distribution avec dispense de prospectus.

Gestion de placements Canada Vie limitée (« GPCV ») est le gestionnaire du Fonds et appartient à cent pour cent à La Compagnie d'Assurance du Canada sur la Vie (« Canada Vie »), filiale de Power Corporation du Canada. GPCV a conclu une convention d'administration de fonds avec Corporation Financière Mackenzie (« Mackenzie »), une filiale de Power Corporation du Canada. Les placements du Fonds dans des sociétés du groupe de sociétés Power sont identifiés dans le tableau des placements.

### 2. Base d'établissement et mode de présentation

Les présents états financiers intermédiaires non audités (les « états financiers ») ont été préparés conformément aux Normes internationales d'information financière (« IFRS »), y compris la Norme comptable internationale 34 (« IAS »), *Information financière intermédiaire*, telles qu'elles ont été publiées par l'International Accounting Standards Board (l'« IASB »). Ces états financiers ont été préparés selon les mêmes méthodes comptables, les mêmes jugements comptables critiques et les mêmes estimations que ceux qui ont été utilisés pour la préparation des états financiers annuels audités les plus récents du Fonds, soit ceux de l'exercice clos le 31 mars 2022. La note 3 présente un résumé des principales méthodes comptables du Fonds en vertu des IFRS.

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

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

### 3. Principales méthodes comptables

#### a) Instruments financiers

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

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

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

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

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

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

Les titres rachetables du Fonds confèrent aux porteurs le droit de faire racheter leur participation dans le Fonds contre un montant de trésorerie égal à leur part proportionnelle de la valeur liquidative du Fonds, entre autres droits contractuels. Les titres rachetables du Fonds satisfont aux critères de classement à titre de passifs financiers conformément à IAS 32, *Instruments financiers : Présentation*. L'obligation du Fonds à l'égard de l'actif net attribuable aux porteurs de titres est présentée au prix de rachat.

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

# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## NOTES ANNEXES

### 3. Principales méthodes comptables (suite)

#### b) Évaluation de la juste valeur

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

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

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

Le Fonds peut avoir recours à des instruments dérivés (comme les options souscrites, les contrats à terme standardisés ou de gré à gré, les swaps ou les instruments dérivés synthétiques) en guise de couverture contre les pertes occasionnées par des fluctuations des cours des titres, des taux d'intérêt ou des taux de change.

Le Fonds peut également avoir recours à des instruments dérivés à des fins autres que de couverture afin d'effectuer indirectement des placements dans des titres ou des marchés financiers, de s'exposer à d'autres devises, de chercher à générer des revenus supplémentaires ou à toute autre fin considérée comme appropriée par le ou les portefeuillistes du Fonds, pourvu que cela soit compatible avec les objectifs de placement du Fonds. Les instruments dérivés doivent être utilisés conformément à la législation canadienne sur les organismes de placement collectif, sous réserve des dispenses accordées au Fonds par les organismes de réglementation, le cas échéant.

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

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

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

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

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

Se reporter au tableau des instruments dérivés et au tableau des options achetées/vendues, le cas échéant, compris dans le tableau des placements pour la liste des instruments dérivés et des options au 30 septembre 2022.

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

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

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

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

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

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

# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## NOTES ANNEXES

### 3. Principales méthodes comptables (suite)

#### b) Évaluation de la juste valeur (suite)

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

Voir la note 10 pour le classement de la juste valeur du Fonds.

#### c) Comptabilisation des produits

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

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

#### d) Commissions et autres coûts de transaction liés au portefeuille

Les commissions et autres coûts de transaction liés au portefeuille sont des charges engagées en vue d'acquérir, d'émettre ou de céder des actifs ou des passifs financiers. Ils comprennent les honoraires et les commissions versés aux agents, aux bourses, aux courtiers et autres intermédiaires. Tous les courtages engagés par le Fonds en lien avec les opérations de portefeuille pour les périodes, ainsi que les autres frais d'opérations, sont présentés dans les états du résultat global. Les activités de courtage sont attribuées aux courtiers en fonction du meilleur résultat net pour le Fonds. Sous réserve de ces critères, des commissions peuvent être versées à des sociétés de courtage qui offrent certains services (ou les paient), outre l'exécution des ordres, y compris la recherche, l'analyse et les rapports sur les placements, et les bases de données et les logiciels à l'appui de ces services. Le cas échéant et lorsqu'elle est vérifiable, la valeur des services fournis par des tiers qui ont été payés par les courtiers au cours des périodes est présentée à la note 10. La valeur de certains services exclusifs fournis par des courtiers ne peut être estimée raisonnablement.

#### e) Opérations de prêt, de mise en pension et de prise en pension de titres

Le Fonds est autorisé à effectuer des opérations de prêt, de mise en pension et de prise en pension de titres, tel qu'il est défini dans le prospectus simplifié du Fonds. Ces opérations s'effectuent par l'échange temporaire de titres contre des biens donnés en garantie comportant l'engagement de rendre les mêmes titres à une date ultérieure.

Le revenu tiré de ces opérations se présente sous forme de frais réglés par la contrepartie et, dans certains cas, sous forme d'intérêts sur les espèces ou les titres détenus en garantie. Le revenu tiré de ces opérations est présenté à l'état du résultat global et constaté lorsqu'il est gagné. Les opérations de prêts de titres sont gérées par la Banque Canadienne Impériale de Commerce et The Bank of New York Mellon. La valeur des espèces ou des titres détenus en garantie doit équivaloir à au moins 102 % de la juste valeur des titres prêtés, vendus ou achetés.

La note 10 résume les détails relatifs aux titres prêtés et aux biens reçus en garantie à la fin de la période, et présente un rapprochement des revenus de prêt de titres durant la période, le cas échéant. Les biens reçus en garantie se composent de titres de créance du gouvernement du Canada et d'autres pays, d'administrations municipales, de gouvernements provinciaux et d'institutions financières du Canada.

#### f) Compensation

Les actifs et les passifs financiers sont compensés et le solde net est comptabilisé dans l'état de la situation financière seulement s'il existe un droit exécutoire de compenser les montants comptabilisés et qu'il y a intention soit de régler le montant net, soit de réaliser l'actif et de régler le passif simultanément. Dans le cours normal des activités, le Fonds conclut diverses conventions-cadres de compensation ou ententes similaires qui ne satisfont pas aux critères de compensation dans l'état de la situation financière, mais qui permettent tout de même de déduire les montants dans certaines circonstances, comme une faillite ou une résiliation de contrat. La note 10 résume les détails de la compensation, le cas échéant, qui fait l'objet d'une convention-cadre de compensation ou d'autres conventions semblables et l'incidence nette sur les états de la situation financière si la totalité des droits à compensation était exercée.

Les produits et les charges ne sont pas compensés à l'état du résultat global, à moins qu'une norme comptable présentée de manière spécifique dans les méthodes IFRS adoptées par le Fonds l'exige ou le permette.

#### g) Devise

Le dollar canadien est la monnaie fonctionnelle et la monnaie de présentation du Fonds. Les acquisitions et les ventes de placements en devises ainsi que les dividendes, le revenu d'intérêts et les intérêts débiteurs en devises ont été convertis en dollars canadiens au taux de change en vigueur au moment de l'opération.

Les profits (pertes) de change à l'achat ou à la vente de devises sont comptabilisé(e)s dans l'état du résultat global au poste Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets – Profit (perte) net(te) réalisé(e).

La juste valeur des placements ainsi que des autres actifs et passifs libellés en devises a été convertie en dollars canadiens au taux de change en vigueur chaque jour ouvrable.

#### h) Actif net attribuable aux porteurs de titres, par titre

L'actif net attribuable aux porteurs de titres par titre est calculé au moyen de la division de l'actif net attribuable aux porteurs de titres d'une série de titres un jour ouvrable donné, par le nombre total de titres de la série en circulation ce jour-là.

# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## NOTES ANNEXES

### 3. Principales méthodes comptables (suite)

#### i) Valeur liquidative par titre

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

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

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

#### k) Fusions

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

#### l) Modifications comptables futures

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

### 4. Estimations et jugements comptables critiques

La préparation de ces états financiers exige de la direction qu'elle fasse des estimations et qu'elle pose des hypothèses ayant principalement une incidence sur l'évaluation des placements. Les estimations et les hypothèses sont révisées de façon continue. Les résultats réels peuvent différer de ces estimations.

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

Voici à la suite les estimations et les jugements comptables les plus importants utilisés pour la préparation des états financiers :

#### Utilisation d'estimations

##### *Juste valeur des titres non cotés sur un marché actif*

Le Fonds peut détenir des instruments financiers qui ne sont pas cotés sur un marché actif et qui sont évalués au moyen de méthodes d'évaluation fondées sur des données observables, dans la mesure du possible. Diverses techniques d'évaluation sont utilisées, selon un certain nombre de facteurs, notamment la comparaison avec des instruments similaires pour lesquels des prix de marché observables existent et l'examen de transactions récentes réalisées dans des conditions de concurrence normale. Les données d'entrée et les hypothèses clés utilisées sont propres à chaque société et peuvent comprendre les taux d'actualisation estimés et la volatilité prévue des prix. Des changements de données d'entrée clés peuvent entraîner une variation de la juste valeur présentée de ces instruments financiers détenus par le Fonds.

#### Utilisation de jugements

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

Lors du classement et de l'évaluation des instruments financiers détenus par le Fonds, GPCV doit exercer des jugements importants afin de déterminer le classement le plus approprié selon IFRS 9. GPCV a évalué le modèle d'affaires du Fonds, sa façon de gérer l'ensemble des instruments financiers ainsi que sa performance globale sur la base de la juste valeur, et elle a conclu que la comptabilisation à la juste valeur par le biais du résultat net conformément à IFRS 9 constitue la méthode d'évaluation et de présentation la plus appropriée pour les instruments financiers du Fonds.

##### *Monnaie fonctionnelle*

Le dollar canadien est la monnaie fonctionnelle et la monnaie de présentation du Fonds, étant considéré comme la monnaie qui représente le plus fidèlement les effets économiques des transactions, événements et conditions sous-jacents du Fonds, compte tenu de la manière dont les titres sont émis et rachetés et dont le rendement et la performance du Fonds sont évalués.

##### *Entités structurées et entreprises associées*

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

### 5. Impôts sur les bénéficiaires

Le Fonds est admissible à titre de fiduciaire de fonds commun de placement en vertu des dispositions de la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada). Par conséquent, il est assujéti à l'impôt pour ce qui est de ses bénéficiaires, y compris le montant net des gains en capital réalisés pour l'année d'imposition, qui ne sont ni payés ni à payer à ses porteurs de titres à la fin de l'année d'imposition. 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 bénéficiaires autre que les impôts étrangers retenus à la source, le cas échéant.

# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## NOTES ANNEXES

### 5. Impôts sur les bénéfices (suite)

Les pertes du Fonds ne peuvent être attribuées aux investisseurs et sont conservées par le Fonds pour des exercices futurs. Les pertes autres qu'en capital peuvent être reportées jusqu'à 20 ans afin de réduire le bénéfice imposable et les gains en capital réalisés au cours d'exercices futurs. Les pertes en capital peuvent être reportées prospectivement indéfiniment afin de réduire les gains en capital réalisés au cours d'exercices futurs. Se reporter à la note 10 pour les reports prospectifs de pertes du Fonds.

### 6. Frais de gestion et frais d'exploitation

GPCV a utilisé les frais de gestion pour la gestion du portefeuille de placements, l'analyse des placements, la formulation de recommandations et la prise de décisions quant aux placements, ainsi que pour la prise de dispositions de courtage pour l'achat et la vente de titres en portefeuille et la conclusion d'ententes avec des courtiers inscrits pour l'achat et la vente de titres du Fonds par des investisseurs. Les frais de gestion sont calculés pour chaque série de titres du Fonds en tant que pourcentage annuel fixe de la valeur liquidative quotidienne de la série.

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

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

GPCV peut renoncer aux frais de gestion et d'administration ou les absorber à son gré et supprimer la renonciation ou l'absorption de ces frais en tout temps, sans préavis. Se reporter à la note 10 pour les taux des frais de gestion et d'administration imputés à chaque série de titres.

### 7. Capital du Fonds

Le capital du Fonds, qui comprend l'actif net attribuable aux porteurs de titres, est réparti entre les différentes séries, lesquelles comportent chacune un nombre illimité de titres. Les titres en circulation du Fonds aux 30 septembre 2022 et 2021 ainsi que les titres qui ont été émis, réinvestis et rachetés au cours de ces périodes sont présentés dans l'état de l'évolution de la situation financière. GPCV gère le capital du Fonds conformément aux objectifs de placement décrits à la note 10.

### 8. Risques découlant des instruments financiers

#### i. Exposition au risque et gestion du risque

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

GPCV cherche à atténuer les éventuelles répercussions néfastes de ces risques sur le rendement du Fonds par l'embauche de conseillers en portefeuille professionnels et expérimentés, par la surveillance quotidienne des positions du Fonds et des événements du marché ainsi que par la diversification du portefeuille de placements en respectant les contraintes des objectifs de placement du Fonds; elle peut aussi, le cas échéant, avoir recours à des instruments dérivés à titre de couverture de certains risques. Pour faciliter la gestion des risques, GPCV maintient également une structure de gouvernance, dont le rôle consiste à superviser les activités de placement du Fonds et à s'assurer de la conformité avec la stratégie de placement établie du Fonds, les directives internes et la réglementation des valeurs mobilières.

#### ii. Risque de liquidité

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

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

#### iii. Risque de change

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

# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## NOTES ANNEXES

### 8. Risques découlant des instruments financiers (suite)

#### iii. Risque de change (suite)

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

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

#### iv. Risque de taux d'intérêt

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

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

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

#### v. Autre risque de prix

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

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

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

#### vi. Risque de crédit

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

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

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

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

#### vii. Fonds sous-jacents

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

# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## NOTES ANNEXES

### 9. Autres renseignements

#### Abréviations

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

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

# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## NOTES ANNEXES

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

#### a) Constitution du Fonds et renseignements sur les séries

Date de constitution : 12 octobre 2018

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 de série A sont offerts aux investisseurs qui investissent un minimum de 500 \$.

Les titres de série F 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 titres de série I sont offerts aux investisseurs qui investissent un minimum de 25 000 \$, qui participent au Programme de portefeuilles gérés Canada Vie Constellation et qui ont conclu une entente avec GPCV et Quadrus en vue de la mise sur pied d'un compte de série I, laquelle précise les frais qui s'appliquent à ce compte.

Les titres de série N sont offerts aux investisseurs qui investissent un minimum de 500 \$, qui satisfont aux exigences de placement minimales de 500 000 \$ et qui ont conclu une entente avec GPCV et Quadrus en vue de la mise sur pied d'un compte de série N.

Les titres de série QF 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 titres de série QFW sont offerts aux investisseurs à valeur nette élevée qui investissent un minimum de 500 \$ et qui satisfont aux exigences de placement minimales de 500 000 \$. Les investisseurs doivent négocier leurs honoraires de service du conseiller, lesquels ne peuvent dépasser 1,25 %, avec leur conseiller financier.

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

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

Les titres de série W sont offerts aux investisseurs qui investissent un minimum de 500 \$ et qui satisfont aux exigences de placement minimales de 500 000 \$.

Le 16 septembre 2022, les titres de série FW ont été renommés titres de série F.

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<sup>†</sup>, le mode de souscription avec frais modérés<sup>†</sup> 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 GPCV 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.

Série	Date d'établissement/ de rétablissement	Frais de gestion	Frais d'administration
Série A	22 octobre 2018	1,55 %	0,20 %
Série F	22 octobre 2018	0,85 % <sup>3)</sup>	0,15 %
Série FW	Aucun titre émis <sup>4)</sup>	0,85 %	0,15 %
Série I	22 octobre 2018	— <sup>1)</sup>	— <sup>1)</sup>
Série N	28 octobre 2019	— <sup>1)</sup>	— <sup>1)</sup>
Série QF	28 octobre 2019	1,05 %	0,20 %
Série QFW	28 octobre 2019	0,85 %	0,15 %
Série R	9 septembre 2020	s.o.	s.o.
Série S	21 mai 2019	— <sup>2)</sup>	0,02 %
Série W	22 octobre 2018	1,35 %	0,15 %

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

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

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

3) Avant le 22 juillet 2022, les frais de gestion pour la série F étaient imputés au Fonds au taux de 1,05 %.

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

#### b) Reports prospectifs de pertes

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



# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## NOTES ANNEXES

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

#### c) Prêt de titres

	30 septembre 2022		31 mars 2022	
	(\$)		(\$)	
Valeur des titres prêtés	162		–	
Valeur des biens reçus en garantie	171		–	

  

	30 septembre 2022		30 septembre 2021	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
Revenus de prêts de titres bruts	1	100,0	–	–
Impôt retenu à la source	–	–	–	–
	1	100,0	–	–
Paiements à l'agent de prêt de titres	–	–	–	–
Revenu tiré du prêt de titres	1	100,0	–	–

#### d) Commissions

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

#### e) Risques découlant des instruments financiers

##### i. Exposition au risque et gestion du risque

Le Fonds vise un revenu et une croissance du capital à long terme en investissant principalement dans des titres à revenu fixe émis par des sociétés ou des gouvernements de toute envergure, partout dans le monde. Le Fonds répartit ses actifs en fonction de la qualité du crédit, des structures, des secteurs, des devises et des pays. Le Fonds peut investir jusqu'à 25 % de son actif dans des obligations ayant une note inférieure à « BBB » et il peut investir dans des titres de créance qui ne sont pas notés.

##### ii. Risque de change

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

Devise	30 septembre 2022				Incidence sur l'actif net			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Renforcement de 5 %		Affaiblissement de 5 %	
					(\$)	%	(\$)	%
BRL	234	–	–	234				
AUD	251	1	(120)	132				
GBP	–	–	124	124				
INR	–	–	47	47				
CNY	–	38	–	38				
COP	–	–	21	21				
ZAR	–	–	16	16				
NOK	126	–	(124)	2				
NZD	–	–	(4)	(4)				
PLN	–	–	(16)	(16)				
MXN	519	–	(537)	(18)				
EUR	700	(139)	(693)	(132)				
SEK	–	–	(133)	(133)				
JPY	4	(16)	(131)	(143)				
CHF	–	–	(176)	(176)				
USD	12 984	1 829	(15 135)	(322)				
Total	14 818	1 713	(16 861)	(330)				
% de l'actif net	65,3	7,5	(74,3)	(1,5)				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					17	0,1	(17)	(0,1)

# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## NOTES ANNEXES

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

#### e) Risques découlant des instruments financiers (suite)

##### ii. Risque de change (suite)

Devise	31 mars 2022				Incidence sur l'actif net			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Renforcement de 5 %		Affaiblissement de 5 %	
					(\$)	%	(\$)	%
USD	12 505	3 936	(13 852)	2 589				
EUR	476	(80)	773	1 169				
BRL	243	–	(21)	222				
AUD	38	(1)	160	197				
NZD	–	–	144	144				
THB	–	–	109	109				
GBP	–	1	77	78				
SGD	–	–	65	65				
PLN	–	–	44	44				
CNY	–	39	–	39				
MXN	523	–	(522)	1				
NOK	143	–	(151)	(8)				
ZAR	–	–	(18)	(18)				
RUB	8	–	(34)	(26)				
PEN	–	–	(27)	(27)				
COP	–	–	(30)	(30)				
KOR	–	–	(48)	(48)				
IDR	–	–	(85)	(85)				
SEK	–	–	(140)	(140)				
EGP	–	–	(189)	(189)				
JPY	–	–	(189)	(189)				
CHF	–	–	(359)	(359)				
PHP	–	–	(1 500)	(1 500)				
INR	–	–	(1 750)	(1 750)				
Total	13 936	3 895	(17 543)	288				
% de l'actif net	56,5	15,8	(71,1)	1,2				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					(16)	(0,1)	43	0,2

\* Comprend les instruments financiers monétaires et non monétaires.

##### iii. Risque de taux d'intérêt

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

30 septembre 2022	Obligations (\$)	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
			Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
			(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	1 243	(13 270)				
1 an à 5 ans	6 027	–				
5 ans à 10 ans	8 231	–				
Plus de 10 ans	5 458	–				
Total	20 959	(13 270)				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt			(1 039)	(4,6)	1 039	4,6

# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## NOTES ANNEXES

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

#### e) Risques découlant des instruments financiers (suite)

##### iii. Risque de taux d'intérêt (suite)

31 mars 2022	Obligations (\$)	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
			Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
			(\$)	(%)	(\$)	(%)
Moins de 1 an	1 244	(10 888)				
1 an à 5 ans	3 872	–				
5 ans à 10 ans	9 667	–				
Plus de 10 ans	4 336	–				
<b>Total</b>	<b>19 119</b>	<b>(10 888)</b>				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt			(1 331)	(5,4)	1 331	5,4

##### iv. Autre risque de prix

Au 30 septembre 2022 et au 31 mars 2022, le Fonds n'avait aucune exposition importante à l'autre risque de prix.

##### v. Risque de crédit

Pour ce Fonds, la plus forte concentration du risque de crédit se trouve dans les titres de créance, tels que les obligations. La juste valeur des titres de créance tient compte de la solvabilité de l'émetteur de ces titres. L'exposition maximale à tout émetteur de titres de créance au 30 septembre 2022 était de 41,4 % de l'actif net du Fonds (38,0 % au 31 mars 2022).

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

Note des obligations*	30 septembre 2022	31 mars 2022
	% de l'actif net	% de l'actif net
AAA	11,0	3,0
AA	46,1	35,0
A	4,9	4,3
BBB	17,1	15,0
Inférieure à BBB	7,6	11,0
Sans note	5,6	9,2
<b>Total</b>	<b>92,3</b>	<b>77,5</b>

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

#### f) Classement de la juste valeur

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 2022				31 mars 2022			
	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	–	20 959	–	20 959	–	19 111	8	19 119
Actions	60	1	31	92	108	–	28	136
Options	–	4	–	4	–	4	–	4
Fonds/billets négociés en bourse	457	–	–	457	547	–	–	547
Actifs dérivés	158	68	–	226	211	362	–	573
Passifs dérivés	(20)	(1 065)	–	(1 085)	(18)	(66)	–	(84)
Placements à court terme	–	–	–	–	–	3 161	–	3 161
<b>Total</b>	<b>655</b>	<b>19 967</b>	<b>31</b>	<b>20 653</b>	<b>848</b>	<b>22 572</b>	<b>36</b>	<b>23 456</b>

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.

Aucun transfert n'a eu lieu entre le niveau 1 et le niveau 2.

# FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES DE BASE PLUS PARCOURS CANADA VIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2022

## NOTES ANNEXES

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

#### f) Classement de la juste valeur (suite)

Le tableau ci-après présente un rapprochement des instruments financiers évalués à la juste valeur à l'aide de données non observables (niveau 3) pour les périodes closes le 30 septembre 2022 et le 31 mars 2022 :

	30 septembre 2022			31 mars 2022		
	Actions (\$)	Obligations (\$)	Total (\$)	Actions (\$)	Obligations (\$)	Total (\$)
Solde, à l'ouverture	28	8	36	–	–	–
Achats	–	–	–	29	111	140
Ventes	–	(132)	(132)	–	–	–
Transferts entrants	–	–	–	–	7	7
Transferts sortants	–	–	–	–	–	–
Profits (pertes) au cours de la période :						
Réalisé(e)s	–	(331)	(331)	–	–	–
Latent(e)s	3	455	458	(1)	–	(1)
Solde, à la clôture	31	–	31	28	8	36
Variation des profits (pertes) latent(e)s au cours de la période attribuables aux titres détenus à la clôture de la période	3	–	3	(1)	(455)	(456)

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

#### g) Placements détenus par le gestionnaire et des sociétés affiliées

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

	30 septembre 2022	31 mars 2022
	(\$)	(\$)
Gestionnaire	–	–
Autres fonds gérés par le gestionnaire	1	1
Fonds gérés par des sociétés affiliées au gestionnaire	10 060	10 443

#### h) Compensation d'actifs et de passifs financiers

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

	30 septembre 2022			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	199	(61)	–	138
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(851)	61	–	(790)
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	(652)	–	–	(652)

  

	31 mars 2022			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	416	(38)	–	378
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(38)	38	262	262
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	378	–	262	640