

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE II CANADA VIE

(Auparavant Fonds de revenu mensuel Canada Vie)

## Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2022

### Aperçu du portefeuille du Fonds sous-jacent\*

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Actions	50,2
Obligations	48,1
Obligations	47,7
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)**	0,4
Options achetées†	–
Options vendues†	–
Trésorerie et placements à court terme	1,4
Autres éléments d'actif (de passif)	0,3

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	43,8
États-Unis	38,7
Autre	4,5
Royaume-Uni	1,6
France	1,4
Trésorerie et placements à court terme	1,4
Pays-Bas	1,4
Allemagne	1,4
Japon	1,2
Mexique	1,1
Chine	0,7
Luxembourg	0,6
Danemark	0,5
Brésil	0,5
Espagne	0,5
Suisse	0,4
Autres éléments d'actif (de passif)	0,3

\* Le Fonds est actuellement entièrement investi dans le Fonds de revenu stratégique Canada Vie (le « Fonds sous-jacent »). Pour le prospectus et d'autres renseignements concernant le Fonds sous-jacent, veuillez consulter les adresses suivantes : [www.placementscanadavie.ca](http://www.placementscanadavie.ca) ou [www.sedar.com](http://www.sedar.com).

\*\* Les valeurs théoriques représentent –23,3 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

† Les valeurs théoriques représentent 0,3 % de la valeur liquidative des options achetées et –0,3 % de la valeur liquidative des options vendues.

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	36,3
Services financiers	14,2
Technologie de l'information	6,2
Énergie	5,8
Obligations d'État étrangères	5,3
Produits industriels	5,3
Soins de santé	4,2
Matériaux	4,1
Consommation de base	3,8
Obligations fédérales	2,9
Consommation discrétionnaire	2,8
Prêts à terme	2,5
Autre	1,9
Services de communication	1,9
Trésorerie et placements à court terme	1,4
Services publics	1,1
Autres éléments d'actif (de passif)	0,3

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

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE II CANADA VIE

(Auparavant Fonds de revenu mensuel Canada Vie)

## Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2022

### LES 25 PRINCIPALES POSITIONS

ACHETEUR DU FONDS SOUS-JACENT\* % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

Émetteur/Fonds sous-jacent	
SEC Mackenzie CL Revenu stratégique (Revenu fixe), série R	4,5
Banque Royale du Canada	2,3
FNB de revenu fixe à rendement élevé mondial Mackenzie	2,1
FNB de revenu à taux variable Mackenzie	1,9
La Banque Toronto-Dominion	1,5
Gouvernement du Canada 1,75 % 01-12-2053	1,4
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,3
Banque de Montréal	1,3
Financière Sun Life inc.	1,2
FINB Obligations toutes sociétés canadiennes Mackenzie	1,2
Trésorerie et placements à court terme	1,1
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée	1,0
FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	1,0
Gouvernement du Canada 1,50 % 01-06-2031	1,0
Microsoft Corp.	1,0
Intact Corporation financière	0,9
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	0,9
Société Financière Manuvie	0,8
Fonds à rendement absolu de titres de créance Mackenzie, série CL	0,8
Chevron Corp.	0,8
Canadian Natural Resources Ltd.	0,8
Suncor Énergie Inc.	0,8
Corporation TC Énergie	0,8
TELUS Corp.	0,7
Enbridge Inc.	0,7
<b>Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale</b>	<b>31,8</b>

### LES 25 PRINCIPALES POSITIONS

VENDEUR DU FONDS SOUS-JACENT\* % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

Émetteur	
Contrats à terme standardisés sur obligations américaines à 5 ans	—
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor américain à 2 ans	—
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF option de vente souscrite @ 64,00 \$ éch. 17-02-2023	—
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF option de vente souscrite @ 63,00 \$ éch. 20-01-2023	—
Contrats à terme standardisés sur obligations Euro-Schatz	—
Contrats à terme standardisés sur euro-obligations à long terme du gouvernement italien (BTP)	—
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans	0,2
Contrats à terme standardisés sur obligations Euro-Bobl	0,2
<b>Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale</b>	<b>0,4</b>
<b>Valeur liquidative totale du Fonds sous-jacent</b>	<b>2,0 milliards \$</b>
<b>Valeur liquidative totale du Fonds</b>	<b>111,7 millions \$</b>

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 31 décembre 2022 en raison des opérations de portefeuille continues du Fonds et du Fonds sous-jacent. Les mises à jour trimestrielles des titres sont disponibles dans les 60 jours suivant la fin de chaque trimestre, sauf pour le trimestre se terminant le 31 mars, date de clôture de l'exercice du Fonds, où elles sont disponibles dans les 90 jours.