

# FONDS DE RÉDUCTION DU RISQUE CANADA VIE

## Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2021

### Aperçu du portefeuille

#### Répartition effective du portefeuille

|  | % de la valeur liquidative |
|--|----------------------------|
| Actions                                | 89,8                       |
| Actions                                | 89,2                       |
| Options achetées*                      | 1,1                        |
| Options vendues*                       | (0,5)                      |
| Autres éléments d'actif (de passif)    | 7,6                        |
| Trésorerie et placements à court terme | 2,6                        |

#### Répartition régionale effective

|  | % de la valeur liquidative |
|--|----------------------------|
| États-Unis                             | 89,8                       |
| Autres éléments d'actif (de passif)    | 7,6                        |
| Trésorerie et placements à court terme | 2,6                        |

#### Répartition sectorielle effective

|  | % de la valeur liquidative |
|--|----------------------------|
| Technologie de l'information           | 24,5                       |
| Soins de santé                         | 11,6                       |
| Consommation discrétionnaire           | 10,9                       |
| Services financiers                    | 10,1                       |
| Services de communication              | 9,9                        |
| Produits industriels                   | 7,6                        |
| Autres éléments d'actif (de passif)    | 7,6                        |
| Consommation courante                  | 5,2                        |
| Trésorerie et placements à court terme | 2,6                        |
| Énergie                                | 2,5                        |
| Matières                               | 2,3                        |
| Immobilier                             | 2,3                        |
| Services publics                       | 2,2                        |
| Autre                                  | 0,7                        |

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

Les placements en devises du Fonds n'étaient pas couverts à la fin de la période.

### Les 25 principales positions acheteur

| Émetteur/Fonds sous-jacent   | % de la valeur liquidative |
|--|----------------------------|
| SPDR S&P 500 ETF Trust   | 89,4                       |
| Trésorerie et placements à court terme                                 | 2,3                        |
| Indice S&P 500 – option de vente souscrite @ 3 750,00 éch. 17-06-2022* | 0,6                        |
| Indice S&P 500 – option de vente souscrite @ 3 500,00 éch. 18-03-2022* | 0,3                        |
| Indice S&P 500 – option de vente souscrite @ 3 350,00 éch. 18-03-2022* | 0,1                        |
| Indice S&P 500 – option de vente souscrite @ 3 100,00 éch. 17-12-2021* | 0,1                        |
| Indice S&P 500 – option de vente souscrite @ 3 500,00 éch. 17-09-2021* | 0,0                        |
| Indice S&P 500 – option de vente souscrite @ 3 100,00 éch. 17-09-2021* | 0,0                        |

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **92,8**

### Les 25 principales positions vendeur

| Émetteur  | % de la valeur liquidative |
|---|----------------------------|
| Indice S&P 500 – option d'achat souscrite @ 4 280,00 éch. 23-07-2021* | (0,2)                      |
| Indice S&P 500 – option d'achat souscrite @ 4 290,00 éch. 16-07-2021* | (0,2)                      |
| Indice S&P 500 – option d'achat souscrite @ 4 350,00 éch. 09-07-2021* | (0,1)                      |
| Indice S&P 500 – option d'achat souscrite @ 4 330,00 éch. 02-07-2021* | (0,0)                      |

Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **(0,5)**

Valeur liquidative totale du Fonds **72,6 millions \$**

\* Les valeurs théoriques représentent 56,2 % de la valeur liquidative des options achetées et -79,5 % de la valeur liquidative des options vendues.

Pour le prospectus et d'autres renseignements concernant le ou les fonds sous-jacents du portefeuille, veuillez consulter l'adresse suivante : [www.sedar.com](http://www.sedar.com). Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 30 juin 2021 en raison des opérations de portefeuille continues du Fonds. 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.