

Account Number:H0000002

Start of Attribution Period : 2018-07-31

End of Attribution Period : 2018-08-31

Reconciliation to Sub-Indices

Index Name	Account Return	Account Weight	Index Return	Index Weight
Ratchet	0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
FixedFloater	0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Floater	0.00 %	0.00 %	-0.68 %	1.16 %
OpRet	0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
SplitShare	0.98 %	10.06 %	0.00 %	0.00 %
Interest-Bearing	0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
PerpetualPremium	0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Scraps	2.31 %	9.84 %	0.69 %	37.97 %
PerpetualDiscount	0.86 %	10.55 %	0.51 %	4.35 %
FixedReset - Discount	0.39 %	24.06 %	0.73 %	33.68 %
Deemed-Retractable	0.51 %	8.66 %	0.48 %	10.20 %
FloatingReset	0.00 %	0.00 %	1.55 %	2.71 %
FixedReset - Premium	0.00 %	0.00 %	0.04 %	3.54 %
FixedReset - Bank nonNVCC	0.00 %	0.00 %	0.15 %	4.69 %
FixedReset - Insurance nonNVCC	<u>0.39 %</u>	<u>36.84 %</u>	<u>0.58 %</u>	<u>2.23 %</u>
Average or Total	0.70 %	100.01 %	0.63 %	100.53 %
Projection Variance	-0.03 %		-0.04 %	
Actual Returns	<u>0.66 %</u>		<u>0.59 %</u>	

Index Return	0.63 %
Sector Allocation Increment	-0.08 %
Security Selection Increment	0.47 %
Cross Terms	<u>-0.33 %</u>
Account Projection	<u>0.70 %</u>

Floater

Ticker	Index Weight	Account Weight	Issue Total Return
BAM.PR.B	1.16 %	0.00 %	-0.68 %
Total Weight (Performance)	1.16 % [ -0.68 % ]		0.00 % [ 0.00 % ]

SplitShare

Ticker	Index Weight	Account Weight	Issue Total Return
EIT.PR.A	0.00 %	7.87 %	1.03 %
EIT.PR.B	0.00 %	2.19 %	0.80 %
Total Weight (Performance)	0.00 % [ 0.00 % ]		10.06 % [ 0.98 % ]

Scraps

Ticker	Index Weight	Account Weight	Issue Total Return
ALA.PR.I	1.72 %	0.00 %	0.12 %
AZP.PR.C	0.00 %	0.57 %	-0.28 %
BAM.PF.A	1.99 %	0.00 %	0.68 %
BAM.PF.D	1.15 %	0.00 %	1.07 %
BCE.PR.C	1.39 %	0.00 %	1.79 %
BCE.PR.E	1.29 %	0.00 %	0.20 %
BCE.PR.H	1.25 %	0.00 %	1.08 %
BCE.PR.J	1.12 %	0.00 %	0.64 %
BCE.PR.K	2.92 %	0.00 %	0.34 %
BPO.PR.C	1.39 %	0.00 %	0.84 %
BPO.PR.P	1.66 %	0.98 %	3.90 %
CF.PR.C	0.00 %	0.91 %	2.30 %
ECN.PR.C	0.00 %	1.02 %	1.64 %
EFN.PR.I	0.00 %	0.88 %	8.38 %
ENB.PR.B	2.30 %	1.18 %	-0.19 %
ENB.PR.D	2.37 %	0.00 %	0.46 %
ENB.PR.F	2.71 %	0.00 %	0.72 %
ENB.PR.N	2.51 %	0.00 %	1.32 %
FFH.PR.G	0.00 %	0.94 %	0.68 %
FFH.PR.M	1.56 %	0.00 %	0.83 %
FTS.PR.M	3.85 %	0.00 %	0.19 %
INE.PR.A	0.00 %	1.61 %	2.75 %

INE.PR.A	0.00 %	1.61 %	2.75 %
PPL.PR.E	1.65 %	0.00 %	1.10 %
PPL.PR.M	1.75 %	0.00 %	-0.19 %
RY.PR.N	1.00 %	0.00 %	0.85 %
SJR.PR.A	0.00 %	0.94 %	1.91 %
TA.PR.F	0.00 %	0.84 %	1.58 %
TRI.PR.B	0.78 %	0.00 %	-2.84 %
WN.PR.A	1.61 %	0.00 %	1.15 %
Total Weight (Performance)	37.97 % [ 0.69 % ]		9.84 % [ 2.31 % ]

PerpetualDiscount

Ticker	Index Weight	Account Weight	Issue Total Return
BAM.PF.C	0.00 %	3.79 %	0.14 %
BAM.PR.N	0.00 %	2.09 %	1.10 %
CU.PR.G	0.00 %	4.67 %	1.33 %
POW.PR.B	1.31 %	0.00 %	0.00 %
PWF.PR.F	1.27 %	0.00 %	1.18 %
PWF.PR.S	1.77 %	0.00 %	0.41 %
Total Weight (Performance)	4.35 % [ 0.51 % ]		10.55 % [ 0.86 % ]

FixedReset - Discount

Ticker	Index Weight	Account Weight	Issue Total Return
BAM.PF.F	2.01 %	0.00 %	-0.72 %
BAM.PR.T	0.00 %	3.17 %	1.32 %
BMO.PR.S	3.15 %	0.00 %	1.15 %
BMO.PR.T	2.48 %	0.00 %	0.61 %
CM.PR.O	2.51 %	0.00 %	1.62 %
CU.PR.C	2.51 %	3.62 %	0.49 %
HSE.PR.A	0.00 %	7.46 %	-0.61 %
NA.PR.S	2.19 %	0.00 %	1.33 %
RY.PR.H	3.17 %	0.00 %	0.64 %
RY.PR.Z	3.17 %	0.00 %	-0.21 %
TD.PF.A	3.18 %	0.00 %	1.71 %
TD.PF.B	3.17 %	0.00 %	0.51 %
TRP.PR.A	0.00 %	1.58 %	1.40 %
TRP.PR.B	0.98 %	0.02 %	1.97 %
TRP.PR.C	1.50 %	8.21 %	0.68 %
TRP.PR.D	3.66 %	0.00 %	0.40 %
Total Weight (Performance)	33.68 % [ 0.73 % ]		24.06 % [ 0.39 % ]

Deemed-Retractable

Total Weight (Performance)		33.68 % [ 0.73 % ]	24.06 % [ 0.39 % ]	
Deemed-Retractable				
Ticker	Index Weight		Account Weight	Issue Total Return
GWO.PR.G	1.93 %		0.00 %	0.60 %
GWO.PR.H	1.82 %		0.00 %	0.28 %
MFC.PR.B	2.06 %		0.00 %	1.16 %
MFC.PR.C	0.00 %		0.32 %	0.63 %
SLF.PR.A	2.41 %		0.00 %	-0.29 %
SLF.PR.B	1.98 %		0.00 %	0.75 %
SLF.PR.D	0.00 %		8.34 %	0.50 %
Total Weight (Performance)		10.20 % [ 0.48 % ]		8.66 % [ 0.51 % ]
FloatingReset				
Ticker	Index Weight		Account Weight	Issue Total Return
BNS.PR.B	1.00 %		0.00 %	0.36 %
TRP.PR.F	1.71 %		0.00 %	2.25 %
Total Weight (Performance)		2.71 % [ 1.55 % ]		0.00 % [ 0.00 % ]
FixedReset - Premium				
Ticker	Index Weight		Account Weight	Issue Total Return
BNS.PR.G	3.54 %		0.00 %	0.04 %
Total Weight (Performance)		3.54 % [ 0.04 % ]		0.00 % [ 0.00 % ]
FixedReset - Bank nonNVCC				
Ticker	Index Weight		Account Weight	Issue Total Return
BMO.PR.M	1.06 %		0.00 %	0.00 %
BNS.PR.Q	1.35 %		0.00 %	0.24 %
RY.PR.I	2.28 %		0.00 %	0.16 %
Total Weight (Performance)		4.69 % [ 0.15 % ]		0.00 % [ 0.00 % ]
FixedReset - Insurance nonNVCC				
Ticker	Index Weight		Account Weight	Issue Total Return
GWO.PR.N	0.00 %		10.02 %	1.14 %
IAG.PR.G	0.00 %		2.79 %	2.34 %
IFC.PR.A	0.00 %		8.76 %	0.45 %
IFC.PR.G	0.00 %		1.38 %	0.72 %
MFC.PR.F	0.00 %		9.64 %	-1.33 %
MFC.PR.M	2.23 %		0.00 %	0.58 %
SLF.PR.G	0.00 %		4.24 %	0.97 %
Total Weight (Performance)	0.00 %	2.23 % [ 0.58 % ]	-0.01 %	36.84 % [ 0.00 % ]