

## **Capital régional et coopératif Desjardins**

Relevé des autres investissements  
**Au 30 juin 2020**

**Relevé des autres investissements (non audité)**  
**Au 30 juin 2020**

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
<b>Obligations (62,1 %)</b>				
<b>Obligations fédérales et garanties (23,5 %)</b>				
Fiducie du Canada pour l'habitation	2020-09-15, 0,53 %	4 000	4 002	4 002
	2025-06-15, 0,95 %	20 300	20 253	20 575
	2025-12-15, 2,25 %	10 000	10 158	10 821
	2026-09-15, 1,90 %	37 600	36 869	40 191
	2027-06-15, 2,35 %	1 480	1 622	1 634
	2028-03-15, 2,35 %	11 800	12 696	13 112
	2028-12-15, 2,65 %	4 250	4 823	4 858
	2029-09-15, 2,10 %	12 000	12 148	13 239
Gouvernement du Canada	2025-03-01, 1,25 %	825	858	859
	2025-09-01, 0,50 %	16 482	16 553	16 595
	2026-06-01, 1,50 %	8 625	9 162	9 195
	2027-06-01, 1,00 %	30 367	30 084	31 585
	2028-06-01, 2,00 %	12 000	13 205	13 450
	2029-06-01, 2,25 %	3 660	4 195	4 226
	2030-06-01, 1,25 %	18 770	19 956	20 080
	2041-06-01, 4,00 %	1 344	1 974	2 126
	2045-12-01, 3,50 %	2 000	2 892	3 128
	2048-12-01, 2,75 %	1 000	1 333	1 435
	2050-12-01, 0,50 %	392	412	461
<b>Total obligations fédérales et garanties</b>		<b>196 895</b>	<b>203 195</b>	<b>211 572</b>
<b>Obligations provinciales, municipales ou garanties (23,9 %)</b>				
Hydro-Québec	2028-08-15, 1,65 %	9 500	8 315	8 497
	2029-02-15, 1,93 %	18 000	15 256	15 934
	2030-02-15, 2,07 %	23 000	18 865	19 868
Municipal Finance Authority of British Columbia	2025-10-02, 2,65 %	3 000	3 005	3 257
Omers Finance Trust	2029-05-14, 2,60 %	800	799	865
OPB Finance Trust	2026-10-25, 2,98 %	3 330	3 329	3 649
Province de la Nouvelle-Écosse	2027-06-01, 2,10 %	3 500	3 401	3 721
	2030-09-01, 2,00 %	3 000	2 982	3 161
Province de la Saskatchewan	2026-06-02, 2,55 %	7 985	8 042	8 677
	2028-12-02, 3,05 %	6 500	6 693	7 393
	2030-06-02, 2,20 %	16 215	16 093	17 333
	2046-12-02, 2,75 %	750	724	835
Province de l'Alberta	2026-06-01, 2,20 %	1 500	1 498	1 594
	2027-06-01, 2,55 %	4 400	4 329	4 776
	2030-06-01, 2,05 %	6 650	6 469	6 939
	2043-12-01, 3,45 %	235	277	286
	2050-06-01, 3,10 %	1 400	1 555	1 676
Province de l'Ontario	2026-06-02, 2,40 %	10 004	9 962	10 828
	2028-12-02, 1,70 %	28 000	24 272	24 873
	2040-06-02, 2,43 %	9 450	5 845	6 241
Province de Québec	2025-09-01, 2,75 %	3 700	3 684	4 058
	2026-09-01, 2,50 %	9 400	9 272	10 260
	2028-12-01, 2,04 %	6 100	5 143	5 419
Province de Terre-Neuve-et-Labrador	2029-06-02, 2,85 %	3 000	3 134	3 278
	2050-10-17, 2,65 %	1 500	1 483	1 516

**Relevé des autres investissements (non audité)  
Au 30 juin 2020**

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
<b>Obligations provinciales, municipales ou garanties (suite)</b>				
Province du Manitoba	2027-06-02, 2,60 %	10 000	9 757	10 957
	2028-06-02, 3,00 %	10 400	10 266	11 744
	2030-06-02, 2,05 %	5 000	4 997	5 286
	2046-09-05, 2,85 %	1 250	1 228	1 423
Province du Nouveau-Brunswick	2027-08-14, 2,35 %	2 500	2 417	2 696
	2030-06-03, 2,50 %	1 775	1 387	1 501
Translink	2030-07-03, 1,60 %	800	800	804
Ville de Montréal	2029-09-01, 2,30 %	3 500	3 499	3 735
	2030-09-01, 1,75 %	2 000	1 993	2 035
Ville de Toronto	2030-12-02, 1,60 %	500	500	504
	2039-09-24, 2,60 %	200	199	211
<b>Total obligations provinciales, municipales ou garanties</b>		<b>218 844</b>	<b>201 470</b>	<b>215 830</b>
<b>Obligations d'institutions financières (6,8 %)</b>				
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2025-04-17, 2,00 %	916	915	936
Banque de Montréal	2021-03-31, 1,88 %	2 750	2 774	2 776
	2026-12-09, 2,70 %	8 300	8 077	9 014
Banque Royale du Canada	2021-03-15, 2,03 %	2 000	2 004	2 020
	2024-07-25, 2,74 %	450	450	465
	2025-05-01, 1,94 %	1 333	1 333	1 361
	2025-06-30, 2,09 %	825	825	827
	2025-07-16, 4,93 %	1 500	1 621	1 772
	2027-01-28, 2,33 %	2 430	2 430	2 536
Banque Scotia	2025-02-03, 2,16 %	6 760	6 758	6 964
	2026-12-02, 2,62 %	5 500	5 556	5 953
Banque Toronto-Dominion	2025-03-13, 1,94 %	1 000	1 000	1 023
	2025-04-22, 3,11 %	500	500	526
	2027-01-26, 3,06 %	3 640	3 639	3 853
bcIMC Realty	2026-12-31, 3,00 %	600	600	654
Brookfield Properties Partners	2026-11-15, 3,93 %	174	174	170
CI Financial	2027-06-27, 3,90 %	350	341	354
Crombie Real Estate Investment Trust	2027-04-21, 3,92 %	273	273	280
Fairfax Financial Holdings	2027-09-06, 4,25 %	1 900	1 874	1 953
Fiducie de placement immobilier Allied Properties	2029-11-21, 3,12 %	150	150	150
Fiducie de placement immobilier Canadian Tire	2026-03-01, 3,29 %	750	742	767
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix	2027-03-21, 2,85 %	726	726	744
	2029-03-11, 3,53 %	1 910	1 910	2 032
	2029-12-04, 2,98 %	348	348	354
	2049-09-04, 3,83 %	29	29	28
First Capital Realty	2027-04-12, 3,75 %	800	800	790
Fonds de placement immobilier RioCan	2027-01-10, 2,36 %	479	479	460
Fonds de placement immobilier SmartCentres	2027-09-21, 3,83 %	1 500	1 469	1 584
	2029-09-20, 3,53 %	430	430	438
Great-West Lifeco	2027-11-28, 3,34 %	500	496	558
HCN Canadian Holdings-1 LP	2026-11-15, 2,95 %	180	180	178
IA Groupe Financier	2026-09-24, 3,07 %	413	413	433
Intact Corporation financière	2027-03-07, 2,85 %	1 600	1 600	1 706
John Deere Canada Funding	2020-07-13, 1,60 %	2 242	2 242	2 243
John Deere Finance	2026-10-16, 2,58 %	740	740	787
OMERS Realty	2027-07-04, 3,24 %	2 500	2 488	2 780
Société financière IGM	2026-10-26, 3,44 %	600	591	635
Toyota Credit Canada	2020-07-24, 0,78 %	1 000	1 000	1 000
<b>Total obligations d'institutions financières</b>		<b>58 098</b>	<b>57 977</b>	<b>61 104</b>

**Relevé des autres investissements (non audité)  
Au 30 juin 2020**

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
<b>Obligations de sociétés (7,9 %)</b>				
407 International	2027-02-04, 2,43 %	1 650	1 567	1 743
	2049-09-07, 2,84 %	668	667	698
Aéroports de Montréal	2049-10-21, 3,03 %	60	60	65
Alectra	2027-02-17, 2,49 %	1 000	956	1 066
Algonquin Power & Utilities	2028-10-29, 4,60 %	2 900	2 899	3 274
AltaGas	2025-05-10, 2,16 %	761	761	767
AltaLink	2026-02-28, 2,75 %	1 360	1 344	1 468
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto	2029-01-03, 2,73 %	1 180	1 171	1 264
	2039-04-17, 2,75 %	507	506	520
Bell Canada	2029-06-10, 2,90 %	900	846	957
	2030-02-14, 2,50 %	7 476	7 463	7 662
	2050-03-30, 3,50 %	484	484	504
BMW Canada	2021-06-15, 1,83 %	1 000	1 004	1 004
Brookfield Asset Management	2026-12-16, 3,80 %	2 950	2 834	3 165
Brookfield Infrastructure Partners	2029-07-09, 3,41 %	1 650	1 650	1 696
Brookfield Renewable Energy Partners	2049-05-05, 4,29 %	1 250	1 248	1 403
Bruce Power	2030-03-21, 4,00 %	524	524	587
Canadian Utilities	2049-03-07, 2,96 %	595	595	637
Compagnies Loblaw	2028-09-11, 4,49 %	1 100	1 119	1 316
	2030-02-07, 2,28 %	605	605	616
Enbridge	2026-05-10, 3,00 %	1 000	971	1 059
	2027-09-27, 5,38 %	1 700	1 700	1 707
	2028-04-12, 6,63 %	750	750	811
	2028-11-22, 3,52 %	800	800	880
	2029-05-09, 2,37 %	500	498	528
	2029-07-03, 2,99 %	1 899	1 898	1 984
	2030-01-01, 2,90 %	326	326	357
Enbridge Gas Distribution	2025-06-11, 3,31 %	2 000	2 004	2 189
Énergir	2027-02-16, 2,10 %	338	338	350
EPCOR Utilities	2049-11-19, 2,90 %	151	151	160
FortisAlberta	2046-03-21, 3,34 %	50	49	57
FortisBC Energy	2026-01-08, 2,58 %	975	955	1 040
Hydro One	2025-11-26, 2,77 %	3 150	3 120	3 385
	2029-11-28, 2,16 %	2 300	2 240	2 393
	2049-08-28, 2,71 %	630	629	648
Lower Mattagami Energy	2026-10-21, 2,31 %	1 300	1 275	1 371
Metro	2027-09-06, 3,39 %	470	470	520
	2050-02-28, 3,41 %	162	162	167
NAV Canada	2030-02-28, 2,06 %	482	482	496
	2051-03-29, 2,92 %	12	12	13
North West Redwater Partnership	2027-03-01, 2,80 %	2 543	2 470	2 655
Ontario Power Generation	2030-01-08, 3,22 %	152	152	167
Pembina Pipeline	2026-05-11, 3,71 %	1 150	1 169	1 241
	2027-03-15, 4,24 %	2 300	2 336	2 557
	2029-01-03, 3,62 %	807	832	863
	2048-10-03, 4,54 %	200	212	217
	2049-11-28, 4,67 %	7	7	8
Reliance	2026-01-15, 3,75 %	370	369	383
Rogers Communications	2027-01-31, 3,65 %	333	331	369
	2029-02-01, 3,25 %	1 000	991	1 094
Saputo	2027-04-15, 2,24 %	626	626	632
Shaw Communications	2026-12-01, 3,80 %	500	491	552
	2030-09-09, 2,90 %	915	913	942
	2049-06-29, 4,25 %	25	25	27
Suncor Énergie inc.	2029-02-24, 3,10 %	500	468	517
	2030-01-09, 5,00 %	80	80	94

**Relevé des autres investissements (non audité)**  
**Au 30 juin 2020**

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
<b>Obligations de sociétés (suite)</b>				
TELUS	2026-05-08, 2,75 %	1 120	1 119	1 181
	2027-11-27, 2,35 %	250	249	256
	2027-12-01, 3,63 %	1 500	1 475	1 668
Toromont Industries	2027-07-27, 3,84 %	750	750	821
Toronto Hydro	2029-09-11, 2,43 %	380	380	409
TransCanada PipeLines	2027-02-05, 3,80 %	700	699	772
	2048-01-03, 4,18 %	286	295	316
Transcanada Trust	2027-05-18, 4,65 %	1 000	912	983
Union Gas	2025-06-17, 3,19 %	1 000	997	1 090
	2027-08-22, 2,88 %	1 000	976	1 090
<b>Total obligations de sociétés</b>		<b>67 109</b>	<b>66 457</b>	<b>71 431</b>
<b>Total obligations</b>		<b>540 946</b>	<b>529 099</b>	<b>559 937</b>
<b>Instruments de marché monétaire (2,4 %)</b>				
Alectra	2020-07-17, 0,31 %	2 750	2 750	2 750
AltaLink	2020-07-29, 0,41 %	2 500	2 499	2 499
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2020-07-20, 1,81 %	1 500	1 499	1 499
Banque Nationale du Canada	2020-08-05, 0,38 %	2 331	2 330	2 330
Banque Royale du Canada	2020-09-03, 0,32 %	1 000	999	999
Banque Scotia	2020-07-13, 0,55 %	1 500	1 500	1 500
	2020-09-03, 0,33 %	500	500	500
	2020-09-16, 0,28 %	750	750	750
Banque Toronto-Dominion	2020-09-04, 1,24 %	1 500	1 497	1 497
Groupe TMX	2020-07-16, 0,31 %	3 000	3 000	3 000
Province de l'Ontario	2020-09-09, 0,24 %	2 250	2 247	2 247
Province de Québec	2020-08-14, 0,24 %	2 000	1 999	1 999
<b>Total instruments de marché monétaire</b>		<b>21 581</b>	<b>21 570</b>	<b>21 570</b>
<b>Contrats de change (0,1 %)</b>				
Fédération des caisses Desjardins du Québec	2020-09-30, 1,36935 \$ CA/\$ US	37 800	0	451
	2020-09-30, 1,543775 \$ CA/ €	8 278	0	129
<b>Total contrats de change</b>			<b>0</b>	<b>580</b>
			<b>Nombre de parts</b>	
<b>Fonds d'actions canadiennes (4,9 %)</b>				
Fiducie institutionnelle Fidelity Actions canadiennes à faible volatilité		1 652	20 671	22 762
FNB BMO d'actions canadiennes à faible volatilité		913	21 654	21 817
<b>Total fonds d'actions canadiennes</b>			<b>42 325</b>	<b>44 579</b>
<b>Fonds d'actions mondiales (11,4 %)</b>				
Fonds Desjardins IBrix Actions mondiales à faible volatilité		4 310	50 764	53 227
Fonds Desjardins Mondial de dividendes		2 567	51 075	49 214
<b>Total fonds d'actions mondiales</b>			<b>101 839</b>	<b>102 441</b>

**Relevé des autres investissements (non audité)**  
**Au 30 juin 2020**

(en milliers de dollars)

<b>Description</b>	<b>Nombre de parts</b>	<b>Coût \$</b>	<b>Juste Valeur \$</b>
<b>Fonds de stratégies d'actions neutres au marché (6,9 %)</b>			
Fonds CC&L Q Marché neutre	192	40 320	41 304
Fonds DGIA Marché neutre	2 012	21 007	21 023
<b>Total fonds de stratégies d'actions neutres au marché</b>		<b>61 327</b>	<b>62 327</b>
<b>Fonds immobiliers (12,2 %)</b>			
Fonds CORE Fiera Immobilier	44	52 919	51 934
Fonds immobilier canadien de prestige de Bentall Kennedy	7 135	57 201	58 324
<b>Total fonds immobiliers</b>		<b>110 120</b>	<b>110 258</b>
<b>Total autres investissements (100,0 %)</b>		<b>866 280</b>	<b>901 692</b>