

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements

Au 30 juin 2022

(en milliers de dollars canadiens)

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 30 juin 2022

Description			Valeur nominale \$	Coût \$	Juste valeur \$
Obligations (40,1%)					
Obligations fédérales et garanties (14,8%)					
Fiducie du Canada pour l'habitation	2030-06-15	1,75 %	14 295	13 766	12 462
	2031-03-15	1,10 %	40 275	35 958	32 645
	2031-12-15	1,60 %	18 200	15 457	15 191
Gouvernement du Canada	2030-12-01	0,50 %	12 000	9 413	9 605
	2031-12-01	1,50 %	100	88	86
	2033-06-01	5,75 %	3 000	3 899	3 677
	2041-06-01	4,00 %	8 000	9 705	8 864
	2045-12-01	3,50 %	10 000	11 794	10 467
	2048-12-01	2,75 %	1 500	1 458	1 386
	2051-12-01	2,00 %	2 061	1 861	1 604
	2053-12-01	1,75 %	6 000	5 039	4 337
Total obligations fédérales et garanties			115 431	108 438	100 324
Obligations provinciales, municipales ou garanties (25,3%)					
Fiducie financière des enseignantes et des enseignants de l'Ontario	2027-10-19	1,10 %	5 000	4 989	4 360
Hydro-Québec	2060-02-15	2,10 %	3 300	2 163	2 016
Omers Finance Trust	2029-05-14	2,60 %	800	800	734
Province de la Colombie-Britannique	2031-06-18	1,55 %	10 600	10 095	8 700
	2032-06-18	3,20 %	5 000	4 988	4 678
	2050-06-18	2,95 %	4 500	4 181	3 597
Province de la Nouvelle-Écosse	2031-12-01	2,40 %	5 000	4 981	4 364
Province de la Saskatchewan	2031-06-02	2,15 %	5 000	4 994	4 316
	2046-12-02	2,75 %	9 600	8 553	7 423
Province de l'Alberta	2030-06-01	2,05 %	450	440	394
	2031-06-01	1,65 %	7 000	6 781	5 805
	2033-06-01	4,15 %	3 000	2 999	3 027
	2043-12-01	3,45 %	235	275	211
	2050-06-01	3,10 %	1 400	1 548	1 161
Province de l'Ontario	2030-06-02	2,05 %	5 100	4 428	4 457
	2030-12-02	1,35 %	9 925	7 942	8 097
	2031-12-02	2,25 %	15 000	14 145	12 957
	2032-06-02	3,75 %	5 000	4 994	4 889
	2046-12-02	2,90 %	31 500	28 877	25 103
	2048-06-02	2,80 %	5 000	4 477	3 884
	2049-06-02	2,90 %	2 850	2 400	2 250
	2051-12-02	1,90 %	470	460	289
	2052-12-02	2,55 %	7 875	6 217	5 686
Province de Québec	2031-09-01	1,50 %	16 300	14 243	13 262
	2032-09-01	3,25 %	20 300	19 952	19 060
	2051-12-01	3,10 %	11 000	10 556	9 033
Province de Terre-Neuve-et-Labrador	2031-06-02	2,05 %	7 500	7 322	6 345
	2050-10-17	2,65 %	1 000	989	706
Province du Manitoba	2030-06-02	2,05 %	3 000	2 999	2 616
Province du Nouveau-Brunswick	2030-06-03	2,50 %	1 775	1 457	1 287
Translink	2030-07-03	1,60 %	800	800	669
Ville de Toronto	2039-09-24	2,60 %	200	199	155
Total obligations provinciales, municipales ou garanties			205 480	190 244	171 531
Obligations d'institutions financières (0,0%)					
Honda Canada Finance	2022-09-19	2,81 % *	100	100	100
Total obligations d'institutions financières			100	100	100
Total obligations			321 011	298 782	271 955

*Taux variable

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 30 juin 2022

Description			Valeur nominale \$	Coût \$	Juste valeur \$
Instruments de marché monétaire (0,1%)					
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto	2022-07-21	1,82 %	100	100	100
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2022-07-13	1,35 %	100	100	100
Banque de Montréal	2022-09-06	2,35 %	100	100	100
Banque Royale du Canada	2022-07-15	1,39 %	40	40	40
Banque Scotia	2022-08-04	1,68 %	100	100	100
Banque Toronto-Dominion	2022-08-29	1,97 %	100	100	100
BCI QuadReal Realty	2022-07-06	1,50 %	100	100	100
Gouvernement du Canada	2022-12-08	0,77 %	300	298	298
Total instruments de marché monétaire			940	938	938
Contrats de change (0,1%)					
Fédération des caisses Desjardins du Québec	2022-12-30	1,28865\$ CA/\$ US	124 559	—	277
	2022-12-30	1,37285\$ CA/\$ €	18 678	—	103
Total contrats de change				—	380

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 30 juin 2022

Description	Nombre de parts	Coût \$	Juste valeur \$
Fonds d'actions canadiennes (8,1%)			
Fiducie institutionnelle Fidelity Actions canadiennes à faible volatilité	1 709 596	25 796	27 527
FNB BMO d'actions canadiennes à faible volatilité	848 543	25 393	27 216
Total fonds d'actions canadiennes		51 189	54 743
Fonds d'actions mondiales (8,3%)			
Fonds Desjardins Mondial de dividendes	2 897 702	58 672	56 398
Total fonds d'actions mondiales		58 672	56 398
Fonds de stratégies d'actions neutres au marché (22,0%)			
Fonds CC&L Q Marché neutre	319 161	75 941	89 521
Fonds DGIA Marché neutre	5 666 621	60 455	59 297
Total fonds de stratégies d'actions neutres au marché		136 396	148 818
Fonds immobiliers (18,8%)			
Fonds CORE Fiera Immobilier	62 577	79 430	95 202
Fonds nourricier immobilier direct mondial Invesco	21 483	31 336	32 196
Total fonds immobiliers		110 766	127 398
Fonds infrastructures (2,5%)			
Fonds DGIA Infrastructures privées mondiales	1	16 858	16 858
Total fonds Infrastructures		16 858	16 858
Total autres investissements (100,0 %)		673 601	677 488