

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements

Au 31 décembre 2019

Relevé des autres investissements (non audité)
Au 31 décembre 2019

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
Obligations (54,0 %)				
Obligations fédérales ou garanties (21,2 %)				
Fiducie du Canada pour l'habitation	2025-12-15, 2,25 %	10 000	10 172	10 133
	2026-09-15, 1,90 %	48 575	47 558	48 153
	2029-09-15, 2,10 %	12 000	12 156	12 008
Gouvernement du Canada	2020-09-01, 0,75 %	750	745	745
	2027-06-01, 1,00 %	98 689	94 551	93 755
	2028-06-01, 2,00 %	18 783	19 512	19 193
	2029-06-01, 2,25 %	1 000	1 068	1 048
	2030-06-01, 1,25 %	8 300	8 065	7 935
	2041-06-01, 4,00 %	10 250	15 155	14 276
	2045-12-01, 3,50 %	1 000	1 391	1 357
	2048-12-01, 2,75 %	1 178	1 479	1 440
	2050-12-01, 0,50 %	394	414	411
Total obligations fédérales ou garanties		210 919	212 266	210 454
Obligations provinciales, municipales ou garanties (19,5 %)				
Municipal Finance Authority of British Columbia	2025-10-02, 2,65 %	3 000	3 005	3 077
Omers Finance Trust	2029-05-14, 2,60 %	800	799	809
OPB Finance Trust	2026-10-25, 2,98 %	6 330	6 327	6 555
Province de la Colombie-Britannique	2027-06-18, 2,55 %	1 500	1 487	1 536
	2028-12-18, 2,95 %	4 300	4 326	4 543
	2030-06-18, 2,20 %	6 490	6 485	6 434
Province de la Nouvelle-Écosse	2027-06-01, 2,10 %	3 500	3 395	3 461
Province de la Saskatchewan	2026-06-02, 2,55 %	7 985	8 046	8 151
	2028-12-02, 3,05 %	6 500	6 703	6 856
	2030-06-02, 2,20 %	2 215	2 185	2 174
Province de l'Alberta	2025-06-01, 2,35 %	1 800	1 764	1 819
	2026-06-01, 2,20 %	1 500	1 498	1 498
	2027-06-01, 2,55 %	4 400	4 324	4 471
	2043-12-01, 3,45 %	235	278	268
	2050-06-01, 3,10 %	1 400	1 557	1 543
Province de l'Ontario	2025-06-02, 2,60 %	20 800	20 518	21 335
	2026-06-02, 2,40 %	19 704	19 615	19 978
	2039-06-02, 4,60 %	1 000	1 326	1 313
	2040-06-02, 2,43 %	9 450	5 775	5 524
Province de Québec	2025-09-01, 2,75 %	30 000	29 854	31 057
	2026-09-01, 2,50 %	9 400	9 262	9 601
	2028-12-01, 2,04 %	6 100	5 092	4 927
Province de Terre-Neuve-et-Labrador	2025-06-02, 2,30 %	4 500	4 378	4 515
	2029-06-02, 2,85 %	3 000	3 141	3 075
	2050-10-17, 2,65 %	1 500	1 482	1 430
Province du Manitoba	2025-06-02, 2,45 %	7 600	7 516	7 721
	2027-06-02, 2,60 %	10 000	9 741	10 199
	2028-06-02, 3,00 %	10 400	10 259	10 904
	2029-06-02, 2,75 %	5 000	4 985	5 153
Province du Nouveau-Brunswick	2027-08-14, 2,35 %	2 500	2 412	2 500
	2030-06-03, 2,50 %	1 775	1 370	1 353
Ville de Toronto	2039-09-24, 2,60 %	200	199	194
Total obligations provinciales, municipales ou garanties		194 884	189 104	193 974

**Relevé des autres investissements (non audité)
Au 31 décembre 2019**

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
Obligations d'institutions financières (7,5 %)				
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2025-05-26, 3,30 %	6 530	6 586	6 849
Banque de Montréal	2026-12-09, 2,70 %	8 300	8 062	8 467
	2028-03-01, 3,19 %	4 900	4 875	5 165
	2029-09-17, 2,88 %	400	400	400
Banque Nationale du Canada	2024-07-12, 2,55 %	385	385	385
	2025-02-03, 2,58 %	3 217	3 217	3 217
Banque Royale du Canada	2020-02-11, 2,51 %	150	150	150
	2020-07-17, 1,92 %	5 100	4 849	5 099
	2024-07-25, 2,74 %	450	450	448
	2025-07-16, 4,93 %	1 500	1 632	1 702
Banque Scotia	2026-12-02, 2,62 %	5 500	5 560	5 585
	2028-02-02, 3,10 %	6 000	5 970	6 286
Banque Toronto-Dominion	2024-07-25, 3,22 %	3 150	3 124	3 207
	2027-01-26, 3,06 %	3 640	3 639	3 643
bcIMC Realty	2026-12-31, 3,00 %	600	600	618
Chartwell Résidences pour Retraités	2025-02-28, 4,21 %	200	200	210
CI Financial	2027-06-27, 3,90 %	350	340	354
Crombie Real Estate Investment Trust	2027-04-21, 3,92 %	273	273	274
Fairfax Financial Holdings	2027-09-06, 4,25 %	1 900	1 872	1 954
Fiducie de placement immobilier Canadian Tire	2026-03-01, 3,29 %	1 750	1 730	1 775
	2027-09-07, 3,87 %	750	750	780
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix	2027-12-08, 4,18 %	1 600	1 594	1 696
	2029-03-11, 3,53 %	1 910	1 910	1 930
Financière Manuvie	2024-08-20, 3,05 %	750	728	762
First Capital Realty	2027-04-12, 3,75 %	800	800	809
Fonds de placement immobilier RioCan	2025-01-12, 2,58 %	880	880	866
Fonds de placement immobilier SmartCentres	2027-09-21, 3,83 %	1 500	1 467	1 552
	2029-09-20, 3,53 %	430	430	432
Great-West Lifeco	2027-11-28, 3,34 %	500	495	526
Groupe TMX	2024-10-11, 3,00 %	250	250	255
HCN Canadian Holdings-1 LP	2026-11-15, 2,95 %	180	180	180
Honda Canada Finance	2025-05-23, 3,44 %	845	843	879
IA Groupe Financier	2026-09-24, 3,07 %	413	413	414
Intact Corporation financière	2027-03-07, 2,85 %	1 600	1 600	1 597
John Deere Finance	2026-10-16, 2,58 %	740	740	734
OMERS Realty	2027-07-04, 3,24 %	2 500	2 488	2 614
Société financière IGM	2026-10-26, 3,44 %	600	591	617
Toyota Credit Canada	2020-02-19, 1,80 %	1 265	1 265	1 265
	2020-07-24, 2,09 %	1 000	1 000	1 000
Total obligations d'institutions financières		72 808	72 338	74 696
Obligations de sociétés (5,8 %)				
407 International	2027-02-04, 2,43 %	1 650	1 561	1 654
Alectra	2027-02-17, 2,49 %	1 000	953	1 003
Algonquin Power & Utilities	2026-11-17, 4,09 %	400	393	422
	2028-10-29, 4,60 %	2 900	2 899	3 153
AltaLink	2026-02-28, 2,75 %	1 360	1 343	1 397
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto	2029-01-03, 2,73 %	580	580	591
	2039-04-17, 2,75 %	507	506	501
Bell Canada	2027-06-29, 3,60 %	2 000	1 949	2 082

Relevé des autres investissements (non audité)
Au 31 décembre 2019

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
Obligations de sociétés (suite)				
Brookfield Asset Management	2026-12-16, 3,80 %	2 950	2 826	3 072
Brookfield Infrastructure Partners	2028-06-11, 4,19 %	1 150	1 159	1 206
	2029-07-09, 3,41 %	1 650	1 650	1 623
Brookfield Renewable Energy Partners	2025-03-02, 3,75 %	750	750	783
	2049-05-05, 4,29 %	1 250	1 248	1 266
Canadian Utilities	2049-03-07, 2,96 %	595	595	583
Compagnies Loblaw	2028-09-11, 4,49 %	1 100	1 120	1 210
Enbridge	2024-11-19, 3,95 %	750	758	791
	2025-06-29, 3,45 %	250	248	261
	2026-05-10, 3,00 %	1 000	969	1 019
	2027-03-08, 3,20 %	1 000	970	1 016
	2027-09-27, 5,38 %	1 700	1 700	1 702
	2028-04-12, 6,63 %	750	750	812
	2028-11-22, 3,52 %	800	800	840
	2029-07-03, 2,99 %	1 899	1 898	1 870
Enbridge Gas Distribution	2025-06-11, 3,31 %	2 000	2 005	2 104
FortisBC Energy	2026-01-08, 2,58 %	975	953	990
Hydro One	2025-11-26, 2,77 %	3 150	3 117	3 228
Inter Pipeline	2024-12-24, 3,17 %	1 000	1 000	1 010
Lower Mattagami Energy	2026-10-21, 2,31 %	300	283	299
Metro	2027-09-06, 3,39 %	470	470	482
North West Redwater Partnership	2026-01-24, 3,20 %	2 000	1 981	2 057
	2027-03-01, 2,80 %	2 544	2 465	2 539
Pembina Pipeline	2026-05-11, 3,71 %	1 150	1 170	1 194
	2027-03-15, 4,24 %	2 300	2 339	2 460
	2048-10-03, 4,54 %	300	318	320
Reliance	2026-01-15, 3,75 %	370	369	378
Saputo	2025-06-14, 3,60 %	550	543	570
Shaw Communications	2026-12-01, 3,80 %	500	491	523
	2049-06-29, 4,25 %	25	25	25
TELUS	2025-12-10, 3,75 %	1 000	993	1 049
	2026-05-08, 2,75 %	1 120	1 119	1 111
	2027-12-01, 3,63 %	1 500	1 475	1 560
	2049-08-16, 3,95 %	100	99	99
Toromont Industries	2025-06-30, 3,71 %	300	307	313
	2027-07-27, 3,84 %	750	750	789
Toronto Hydro	2029-09-11, 2,43 %	380	380	377
TransCanada PipeLines	2048-01-03, 4,18 %	286	295	302
Transcanada Trust	2027-05-18, 4,65 %	1 000	907	970
Union Gas	2025-06-17, 3,19 %	1 000	997	1 046
	2027-08-22, 2,88 %	1 000	974	1 027
Westcoast Energy	2025-09-08, 3,77 %	1 160	1 161	1 229
Total obligations de sociétés		55 221	54 611	56 908
Total obligations		533 832	528 319	536 032
Instruments de marché monétaire (4,6 %)				
AltaLink	2020-01-29, 1,97 %	5 000	4 992	4 993
Banque de Montréal	2020-01-24, 1,98 %	1 457	1 455	1 455
	2020-01-30, 1,92 %	4 000	3 994	3 994
	2020-05-22, 2,00 %	1 000	992	992

Relevé des autres investissements (non audité)
Au 31 décembre 2019

(en milliers de dollars)

Description	Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
Instruments de marché monétaire (suite)			
Banque Nationale du Canada	2020-01-16, 1,90 % 5 300	5 296	5 296
Banque Scotia	2020-02-10, 1,83 % 5 250	5 239	5 239
Banque Toronto-Dominion	2020-03-30, 1,85 % 5 250	5 226	5 225
Énergir	2020-01-21, 1,85 % 5 250	5 244	5 244
Groupe TMX	2020-01-21, 1,86 % 1 250	1 249	1 249
	2020-02-05, 1,87 % 4 000	3 993	3 993
Province de Québec	2020-02-28, 1,83 % 2 505	2 498	2 498
Province du Manitoba	2020-03-25, 1,85 % 1 000	996	996
Société canadienne d'hypothèques et de logement	2020-02-14, 1,84 % 4 875	4 863	4 863
Total instruments de marché monétaire	46 137	46 037	46 037
Contrats de change (0,1 %)			
Fédération des caisses Desjardins du Québec	2020-03-31, 1,31417 \$ CA/\$ US 51 700	0	830
	2020-03-31, 1,46655 \$ CA/\$ € 8 600	0	20
Total contrats de change	60 300	0	850
	Nombre de parts		
Fonds d'actions canadiennes (6,3 %)			
Fiducie institutionnelle Fidelity Actions canadiennes à faible volatilité	2 149	26 852	31 161
FNB BMO d'actions canadiennes à faible volatilité	1 192	28 206	31 628
Total fonds d'actions canadiennes		55 058	62 789
Fonds d'actions mondiales (17,6 %)			
Fonds Desjardins IBrix Actions mondiales à faible volatilité	6 698	78 707	87 066
Fonds Desjardins Mondial de dividendes	4 029	79 935	87 016
Total fonds d'actions mondiales		158 642	174 082
Fonds de stratégies d'actions neutres au marché (6,1 %)			
Fonds CC&L Q Marché neutre	192	40 157	40 404
Fonds DGIA Marché neutre	2 005	20 822	20 490
Total fonds de stratégies d'actions neutres au marché		60 979	60 894
Fonds immobiliers (11,3 %)			
Fonds CORE Fiera Immobilier	43	51 331	52 425
Fonds immobilier canadien de prestige de Bentall Kennedy	7 078	56 715	59 637
Total fonds immobiliers		108 046	112 062
Total autres investissements (100,0 %)		957 081	992 746