

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements
Au 31 décembre 2020

Relevé des autres investissements (non audité)
Au 31 décembre 2020

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
Obligations (57,3 %)				
Obligations fédérales et garanties (20,1 %)				
Fiducie du Canada pour l'habitation	2025-12-15, 1,95 %	3 550	3 779	3 779
	2026-09-15, 1,90 %	33 100	32 504	35 312
	2027-06-15, 2,35 %	1 480	1 612	1 627
	2028-03-15, 2,35 %	11 800	12 641	13 046
	2028-12-15, 2,65 %	4 250	4 790	4 819
	2029-09-15, 2,10 %	12 000	12 141	13 135
Gouvernement du Canada	2026-03-01, 0,25 %	23 350	23 142	23 111
	2027-06-01, 1,00 %	21 029	21 090	21 745
	2028-06-01, 2,00 %	150	166	166
	2030-12-01, 0,50 %	57 500	56 663	56 249
	2041-06-01, 4,00 %	1 344	1 961	2 071
	2045-12-01, 3,50 %	2 000	2 877	3 021
	2048-12-01, 2,75 %	1 000	1 328	1 372
	2050-12-01, 0,50 %	397	416	496
PSP Capital	2026-06-15, 0,90 %	4 723	4 719	4 745
Total obligations fédérales et garanties		177 673	179 829	184 694
Obligations provinciales, municipales ou garanties (23,6 %)				
Fiducie financière des enseignantes et des enseignants de l'Ontario	2027-10-19, 1,10 %	5 000	4 987	4 998
Hydro-Québec	2028-08-15, 1,65 %	9 500	8 384	8 669
	2029-02-15, 1,93 %	18 000	15 405	16 220
	2030-02-15, 2,07 %	23 000	19 062	20 199
Omers Finance Trust	2029-05-14, 2,60 %	800	799	880
Ontario Hydro	2021-10-15, 0,28 %	1 000	998	997
OPB Finance Trust	2026-10-25, 2,98 %	3 330	3 329	3 687
Province de la Nouvelle-Écosse	2027-06-01, 2,10 %	3 500	3 408	3 752
	2030-09-01, 2,00 %	3 000	2 983	3 188
Province de la Saskatchewan	2026-06-02, 2,55 %	7 985	8 037	8 705
	2028-12-02, 3,05 %	6 500	6 683	7 434
	2030-06-02, 2,20 %	16 215	16 098	17 432
	2046-12-02, 2,75 %	750	724	833
Province de l'Alberta	2026-06-01, 2,20 %	1 500	1 498	1 608
	2027-06-01, 2,55 %	4 400	4 334	4 828
	2030-06-01, 2,05 %	6 650	6 477	7 028
	2043-12-01, 3,45 %	235	277	287
	2050-06-01, 3,10 %	1 400	1 554	1 656
Province de l'Ontario	2028-12-02, 1,70 %	28 000	24 482	25 370
	2030-12-02, 1,35 %	10 000	9 992	10 007
	2040-06-02, 2,43 %	9 450	5 916	6 296
	2051-12-02, 1,90 %	1 970	1 926	1 925
Province de Québec	2026-09-01, 2,50 %	9 400	9 281	10 282
	2028-12-01, 2,04 %	6 100	5 196	5 531
Province de Terre-Neuve-et-Labrador	2029-06-02, 2,85 %	3 000	3 127	3 356
	2050-10-17, 2,65 %	1 500	1 483	1 569
Province du Manitoba	2027-06-02, 2,60 %	10 000	9 773	11 020
	2028-06-02, 3,00 %	10 400	10 273	11 817
	2030-06-02, 2,05 %	5 000	4 997	5 310
	2046-09-05, 2,85 %	1 250	1 229	1 408

**Relevé des autres investissements (non audité)
Au 31 décembre 2020**

(en milliers de dollars)

Description	Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$	
Obligations provinciales, municipales ou garanties (suite)				
Province du Nouveau-Brunswick	2027-08-14, 2,35 % 2030-06-03, 2,50 %	2 500 1 775	2 422 1 404	2 714 1 525
Translink	2030-07-03, 1,60 %	800	800	815
Ville de Montréal	2029-09-01, 2,30 % 2030-09-01, 1,75 %	3 500 2 000	3 499 1 993	3 775 2 051
Ville de Toronto	2030-12-02, 1,60 % 2039-09-24, 2,60 %	500 200	500 199	509 217
Total obligations provinciales, municipales ou garanties		220 110	203 529	217 898
Obligations d'institutions financières (5,7 %)				
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2025-04-17, 2,00 %	916	915	955
Banque de Montréal	2026-12-09, 2,70 %	7 000	6 824	7 693
Banque Royale du Canada	2025-05-01, 1,94 % 2025-06-30, 2,09 % 2027-01-28, 2,33 %	1 333 825 2 430	1 333 825 2 430	1 389 854 2 590
Banque Scotia	2026-12-02, 2,62 % 2027-11-01, 1,40 %	5 500 5 000	5 552 4 982	6 013 5 026
Banque Toronto-Dominion	2025-03-13, 1,94 % 2027-01-26, 3,06 % 2030-04-22, 3,11 %	1 000 3 640 500	1 000 3 639 500	1 042 3 973 540
BCI QuadReal Realty	2030-04-24, 1,75 %	114	114	115
bclMC Realty	2026-12-31, 3,00 %	600	600	662
Brookfield Properties Partners	2026-11-15, 3,93 %	174	174	180
CI Financial	2027-06-27, 3,90 %	350	342	375
Crombie Real Estate Investment Trust	2027-04-21, 3,92 %	273	273	304
Fairfax Financial Holdings	2027-09-06, 4,25 %	1 900	1 876	2 072
Fiducie de placement immobilier Allied Properties	2029-11-21, 3,12 %	150	150	157
Fiducie de placement immobilier Canadian Tire	2026-03-01, 3,29 % 2030-10-06, 2,37 %	750 187	743 187	812 188
Fiducie de placement immobilier Granite	2030-09-18, 2,38 %	795	795	805
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix	2027-03-21, 2,85 % 2029-03-11, 3,53 % 2029-12-04, 2,98 % 2049-09-04, 3,83 %	726 1 910 348 29	726 1 910 348 29	775 2 119 370 30
Financière Sun Life	2030-10-01, 2,06 %	628	627	634
First Capital Realty	2027-04-12, 3,75 %	800	800	859
Fonds de placement immobilier RioCan	2027-01-10, 2,36 %	379	379	386
Fonds de placement immobilier SmartCentres	2027-09-21, 3,83 % 2029-09-20, 3,53 %	500 430	490 430	554 466
Great-West Lifeco	2027-11-28, 3,34 % 2050-01-08, 2,98 %	500 32	496 32	565 33
HCN Canadian Holdings-1 LP	2026-11-15, 2,95 %	180	180	190
Intact Corporation financière	2027-03-07, 2,85 % 2030-09-16, 1,93 % 2050-06-16, 2,95 %	1 600 790 18	1 600 790 18	1 733 796 18
John Deere Finance	2026-10-16, 2,58 % 2027-09-08, 1,34 %	740 2 405	740 2 405	802 2 425
OMERS Realty	2027-07-04, 3,24 %	2 500	2 489	2 817
Société financière IGM	2026-10-26, 3,44 %	600	592	665
Total obligations d'institutions financières		48 552	48 335	51 982

Relevé des autres investissements (non audité)
Au 31 décembre 2020

(en milliers de dollars)

Description	Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$	
Obligations de sociétés (7,9 %)				
407 International	2027-02-04, 2,43 % 2049-09-07, 2,84 %	1 650 668	1 572 667	1 780 703
Administration de l'aéroport de Vancouver	2030-06-20, 1,76 %	385	385	393
Aéroports de Montréal	2049-10-21, 3,03 %	60	60	66
Alectra	2027-02-17, 2,49 %	1 000	959	1 084
Algonquin Power & Utilities	2028-10-29, 4,60 %	2 900	2 899	3 441
AltaLink	2026-02-28, 2,75 % 2030-06-11, 1,51 %	360 1 000	356 1 000	392 1 003
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto	2029-01-03, 2,73 % 2039-04-17, 2,75 %	1 180 507	1 172 506	1 303 531
Bell Canada	2027-06-16, 1,65 % 2029-06-10, 2,90 % 2030-02-14, 2,50 % 2050-03-30, 3,50 %	991 500 7 476 484	991 472 7 463 484	1 002 542 7 826 509
BMW Canada	2021-06-15, 1,83 %	2 000	2 005	2 013
Brookfield Asset Management	2026-12-16, 3,80 %	2 950	2 842	3 312
Brookfield Infrastructure Partners	2029-07-09, 3,41 % 2032-06-01, 2,86 %	1 650 69	1 650 69	1 810 71
Brookfield Renewable Energy Partners	2049-05-05, 4,29 % 2050-02-13, 3,33 %	870 419	869 419	1 057 433
Bruce Power	2030-03-21, 4,00 %	524	524	605
Canadian Utilities	2049-03-07, 2,96 %	595	595	642
Capital Power Corporation	2032-07-01, 3,15 %	798	798	818
Compagnies Loblaw	2028-09-11, 4,49 % 2030-02-07, 2,28 %	900 605	915 605	1 086 626
Enbridge	2027-09-27, 5,38 % 2028-04-12, 6,63 % 2028-11-22, 3,52 % 2029-05-09, 2,37 % 2029-07-03, 2,99 % 2030-01-01, 2,90 %	1 700 750 800 500 1 899 326	1 700 750 800 498 1 898 326	1 797 855 903 539 2 047 364
Enbridge Gas Distribution	2025-06-11, 3,31 %	2 000	2 004	2 217
Énergir	2027-02-16, 2,10 %	338	338	358
EPCOR Utilities	2049-11-19, 2,90 %	151	151	162
FortisAlberta	2046-03-21, 3,34 %	50	49	57
FortisBC Energy	2026-01-08, 2,58 % 2050-01-13, 2,54 %	975 19	957 19	1 051 19
Husky Energy	2027-12-07, 3,50 %	1 588	1 568	1 617
Hydro One	2025-11-26, 2,77 % 2029-11-28, 2,16 % 2049-08-28, 2,71 %	3 150 2 300 630	3 123 2 243 629	3 426 2 440 654
Lower Mattagami Energy	2026-10-21, 2,31 %	1 300	1 276	1 398
Metro	2050-02-28, 3,41 %	162	162	170
NAV Canada	2030-02-28, 2,06 % 2051-03-29, 2,92 %	482 12	482 12	506 13
North West Redwater Partnership	2027-03-01, 2,80 %	2 543	2 475	2 727
Ontario Power Generation	2026-03-22, 1,17 % 2030-01-08, 3,22 %	430 152	430 152	434 172

**Relevé des autres investissements (non audité)
Au 31 décembre 2020**

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
Obligations de sociétés (suite)				
Pembina Pipeline	2026-05-11, 3,71 %	1 150	1 167	1 273
	2027-03-15, 4,24 %	2 300	2 332	2 617
	2029-01-03, 3,62 %	807	831	892
	2048-10-03, 4,54 %	200	212	224
	2049-11-28, 4,67 %	7	7	8
Reliance	2026-01-15, 3,75 %	370	369	405
	2027-10-01, 2,68 %	618	618	648
Rogers Communications	2029-02-01, 3,25 %	1 000	992	1 109
Shaw Communications	2026-12-01, 3,80 %	500	492	562
	2030-09-09, 2,90 %	915	913	972
	2049-06-29, 4,25 %	25	25	28
Suncor Énergie inc.	2029-02-24, 3,10 %	500	469	539
	2030-01-09, 5,00 %	80	80	98
	2027-11-27, 2,35 %	250	249	263
TELUS	2027-07-27, 3,84 %	750	750	839
Toromont Industries	2029-09-11, 2,43 %	380	380	414
TransCanada PipeLines	2027-02-05, 3,80 %	700	699	787
	2048-01-03, 4,18 %	286	295	319
Transcanada Trust	2027-05-18, 4,65 %	1 000	917	1 027
Union Gas	2025-06-17, 3,19 %	1 000	998	1 103
	2027-08-22, 2,88 %	1 000	977	1 111
Total obligations de sociétés		66 636	66 091	72 212
Total obligations		512 971	497 784	526 786
Instruments de marché monétaire (3,4 %)				
Alectra	2021-01-18, 0,27 %	2 000	2 000	2 000
AltaLink	2021-01-29, 0,27 %	2 000	2 000	2 000
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto	2021-02-09, 0,28 %	2 000	1 999	1 999
Banque de Montréal	2021-05-25, 0,30 %	2 000	1 998	1 998
Banque Royale du Canada	2021-01-04, 0,23 %	1 602	1 602	1 602
	2021-05-06, 0,42 %	573	572	572
Banque Scotia	2021-11-19, 0,35 %	2 000	1 994	1 994
Énergir	2021-02-01, 0,26 %	1 000	1 000	1 000
Groupe TMX	2021-01-11, 0,25 %	1 000	1 000	1 000
	2021-01-28, 0,23 %	1 000	1 000	1 000
Province de l'Ontario	2021-01-20, 0,16 %	1 000	1 000	1 000
	2021-03-03, 0,18 %	1 000	1 000	1 000
	2021-03-17, 0,18 %	4 500	4 496	4 496
Province de Québec	2021-01-15, 0,17 %	500	500	500
	2021-01-29, 0,16 %	2 500	2 500	2 500
	2021-03-19, 0,17 %	3 000	2 999	2 999
Société de Transport de Montréal	2021-04-20, 0,28 %	2 000	1 998	1 998
Toyota Credit Canada	2021-01-19, 0,41 %	1 850	1 850	1 850
Total instruments de marché monétaire		31 525	31 508	31 508

Relevé des autres investissements (non audité)
Au 31 décembre 2020

(en milliers de dollars)

Description	Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
Contrats de change (0,1 %)			
Fédération des caisses Desjardins du Québec	2021-03-31, 1,28198 \$ CA/\$ US 69 600	-	651
	2021-03-31, 1,56670 \$ CA/€ 7 564	-	68
Total contrats de change		-	719
		Nombre de parts	
Fonds d'actions canadiennes (7,3 %)			
Fiducie institutionnelle Fidelity Actions canadiennes à faible volatilité	2 237	29 670	33 974
FNB BMO d'actions canadiennes à faible volatilité	1 205	31 107	32 616
Total fonds d'actions canadiennes		60 777	66 590
Fonds d'actions mondiales (12,8 %)			
Fonds Desjardins IBrix Actions mondiales à faible volatilité	5 055	60 382	63 502
Fonds Desjardins Mondial de dividendes	2 659	53 081	54 111
Total fonds d'actions mondiales		113 463	117 613
Fonds de stratégies d'actions neutres au marché (6,9 %)			
Fonds CC&L Q Marché neutre	192	40 489	41 461
Fonds DGIA Marché neutre	2 072	21 758	21 502
Total fonds de stratégies d'actions neutres au marché		62 247	62 963
Fonds immobiliers (12,2 %)			
Fonds CORE Fiera Immobilier	45	53 577	54 111
Fonds immobilier canadien de prestige de Bentall Kennedy	7 135	57 201	57 624
Total fonds immobiliers		110 778	111 735
Total autres investissements (100,0 %)		876 557	917 914