

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements
Au 30 juin 2021

Relevé des autres investissements (non audité)
Au 30 juin 2021

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
Obligations (35,0 %)				
Obligations fédérales et garanties (13,5 %)				
Fiducie du Canada pour l'habitation	2026-09-15, 1,90 %	18 100	17 801	18 669
	2027-06-15, 2,35 %	1 480	1 602	1 563
	2028-03-15, 2,35 %	1 800	1 920	1 902
	2028-03-15, 2,65 %	6 500	6 965	6 993
	2028-12-15, 2,65 %	4 250	4 758	4 579
	2029-09-15, 2,10 %	12 000	12 133	12 434
	2030-06-15, 1,75 %	6 215	6 252	6 235
Gouvernement du Canada	2023-02-01, 0,25 %	6 000	5 989	5 987
	2027-06-01, 1,00 %	15 600	15 518	15 519
	2028-06-01, 2,00 %	5 700	5 993	6 019
	2029-06-01, 2,25 %	9 000	9 648	9 688
	2030-06-01, 1,25 %	14 170	13 895	14 065
	2030-12-01, 0,50 %	12 255	11 224	11 297
	2041-06-01, 4,00 %	1 344	1 948	1 861
	2045-12-01, 3,50 %	2 000	2 862	2 673
	2048-12-01, 2,75 %	1 000	1 323	1 200
	2050-12-01, 0,50 %	405	424	449
	2051-12-01, 2,00 %	1 000	1 024	1 036
Total obligations fédérales et garanties		118 819	121 279	122 169
Obligations provinciales, municipales ou garanties (12,9 %)				
Fiducie financière des enseignantes et des enseignants de l'Ontario	2027-10-19, 1,10 %	5 000	4 988	4 841
Omers Finance Trust	2029-05-14, 2,60 %	800	799	841
Ontario Hydro	2021-10-15, 0,28 %	1 000	999	999
OPB Finance Trust	2026-10-25, 2,98 %	3 330	3 329	3 561
Province de la Colombie-Britannique	2031-06-18, 1,55 %	9 600	9 204	9 228
Province de la Nouvelle-Écosse	2028-06-01, 1,10 %	3 000	2 997	2 897
Province de la Saskatchewan	2030-06-02, 2,20 %	10 215	10 145	10 455
	2046-12-02, 2,75 %	750	724	771
Province de l'Alberta	2027-06-01, 2,55 %	4 400	4 338	4 658
	2030-06-01, 2,05 %	6 650	6 485	6 700
	2031-06-01, 1,65 %	7 000	6 759	6 728
	2043-12-01, 3,45 %	235	276	267
	2050-06-01, 3,10 %	1 400	1 552	1 503
Province de l'Ontario	2028-12-02, 1,70 %	18 000	15 872	15 741
	2030-12-02, 1,35 %	13 550	13 251	12 820
	2031-06-02, 2,15 %	16 000	15 932	16 152
	2051-12-02, 1,90 %	470	460	398
Province de Québec	2031-05-27, 2,10 %	1 484	1 479	1 507
Province de Terre-Neuve-et-Labrador	2029-06-02, 2,85 %	3 000	3 120	3 199
	2050-10-17, 2,65 %	1 000	989	932
Province du Manitoba	2027-06-02, 2,60 %	3 500	3 426	3 717
	2030-06-02, 2,05 %	3 000	2 999	3 031
	2046-09-05, 2,85 %	1 250	1 229	1 301
Province du Nouveau-Brunswick	2027-08-14, 2,35 %	2 500	2 428	2 618
	2030-06-03, 2,50 %	1 775	1 421	1 471
Translink	2030-07-03, 1,60 %	800	800	774
Ville de Toronto	2039-09-24, 2,60 %	200	199	200
Total obligations provinciales, municipales ou garanties		119 909	116 200	117 310

Relevé des autres investissements (non audité)
Au 30 juin 2021

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
Obligations d'institutions financières (3,9 %)				
Banque de Montréal	2022-02-16, 0,35 % *	750	750	750
	2026-12-09, 2,70 %	855	835	905
Banque Royale du Canada	2022-02-10, 0,32 % *	750	750	750
	2027-01-28, 2,33 %	1 220	1 220	1 254
	2028-01-28, 1,67 %	535	535	518
Banque Scotia	2022-04-27, 1,83 %	3 574	3 618	3 618
	2026-12-02, 2,62 %	2 990	3 016	3 155
	2027-11-01, 1,40 %	3 420	3 408	3 317
Banque Toronto-Dominion	2027-01-26, 3,06 %	3 110	3 109	3 277
	2028-03-08, 1,89 %	855	852	853
BCI QuadReal Realty	2030-04-24, 1,75 %	99	99	95
bcIMC Realty	2026-12-31, 3,00 %	515	515	548
Crombie Real Estate Investment Trust	2027-04-21, 3,92 %	233	233	252
Fairfax Financial Holdings	2027-09-06, 4,25 %	985	973	1 070
	2030-12-03, 3,95 %	593	594	612
Fiducie de placement immobilier Allied Properties	2029-11-21, 3,12 %	130	130	131
Fiducie de placement immobilier Canadian Tire	2030-10-06, 2,37 %	162	162	155
Fiducie de placement immobilier Granite	2030-09-18, 2,38 %	680	680	659
Fiducie de placement immobilier H&R	2027-01-19, 2,63 %	110	110	109
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix	2027-03-21, 2,85 %	191	191	198
	2029-12-04, 2,98 %	298	298	304
	2049-09-04, 3,83 %	24	24	23
Financière Sun Life	2030-10-01, 2,06 %	538	538	518
First Capital Realty	2027-04-12, 3,75 %	685	685	723
Fonds de placement immobilier RioCan	2027-01-10, 2,36 %	324	324	323
Fonds de placement immobilier SmartCentres	2027-09-21, 3,83 %	425	417	457
	2029-09-20, 3,53 %	370	370	386
Great-West Lifeco	2027-11-28, 3,34 %	425	422	461
	2050-01-08, 2,98 %	27	27	25
Groupe TMX	2030-11-12, 2,02 %	25	25	24
Honda Canada Finance	2028-02-25, 1,65 %	1 110	1 110	1 089
Intact Corporation financière	2027-03-07, 2,85 %	1 370	1 370	1 438
	2030-09-16, 1,93 %	675	675	647
	2050-06-16, 2,95 %	13	13	12
John Deere Finance	2026-10-16, 2,58 %	630	630	658
	2027-09-08, 1,34 %	2 055	2 055	1 992
OMERS Realty	2027-07-04, 3,24 %	2 135	2 126	2 305
Société financière IGM	2026-10-26, 3,44 %	515	509	554
Toyota Credit Canada	2026-02-23, 1,18 %	1 597	1 597	1 569
Total obligations d'institutions financières		34 998	34 995	35 734
Obligations de sociétés (4,7 %)				
407 International	2027-02-04, 2,43 %	1 410	1 349	1 461
	2049-09-07, 2,84 %	573	572	536
Administration de l'aéroport de Vancouver	2030-06-20, 1,76 %	330	330	318
Aéroports de Montréal	2049-10-21, 3,03 %	50	50	49
Alectra	2030-11-11, 1,75 %	1 070	1 070	1 026
Algonquin Power & Utilities	2028-10-29, 4,60 %	2 050	2 049	2 369
	2031-04-15, 2,85 %	250	250	254

* Taux variable

Relevé des autres investissements (non audité)
Au 30 juin 2021

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
Obligations de sociétés (suite)				
AltaLink	2030-06-11, 1,51 %	855	855	806
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto	2028-03-03, 1,54 %	1 070	1 035	1 046
	2029-01-03, 2,73 %	1 010	1 003	1 058
	2039-04-17, 2,75 %	432	431	417
Bell Canada	2027-06-16, 1,65 %	846	846	822
	2028-03-29, 2,20 %	492	491	492
	2030-02-14, 2,50 %	836	835	827
	2030-12-17, 3,00 %	425	425	434
	2050-03-30, 3,50 %	329	329	308
Brookfield Asset Management	2026-12-16, 3,80 %	2 520	2 434	2 756
Brookfield Infrastructure Partners	2029-07-09, 3,41 %	1 195	1 195	1 257
	2032-06-01, 2,86 %	59	59	58
Brookfield Renewable Energy Partners	2049-05-05, 4,29 %	745	744	840
	2050-02-13, 3,33 %	359	359	344
Bruce Power	2030-03-21, 4,00 %	449	449	498
Canadian Utilities	2049-03-07, 2,96 %	510	510	489
Capital Power Corporation	2032-07-01, 3,15 %	683	683	671
Cenovus Energy	2027-12-07, 3,50 %	1 358	1 342	1 422
Compagnies Loblaw	2030-02-07, 2,28 %	515	515	506
Enbridge	2027-09-27, 5,38 %	1 455	1 455	1 531
	2028-04-12, 6,63 %	640	640	724
	2028-11-22, 3,52 %	685	685	741
	2029-05-09, 2,37 %	425	424	434
	2029-07-03, 2,99 %	1 624	1 623	1 674
	2030-01-01, 2,90 %	281	281	296
Énergir	2027-02-16, 2,10 %	288	288	293
EPCOR Utilities	2049-11-19, 2,90 %	131	131	124
FortisAlberta	2046-03-21, 3,34 %	45	44	46
FortisBC Energy	2050-01-13, 2,54 %	14	14	12
Hydro One	2029-11-28, 2,16 %	1 965	1 919	1 962
	2049-08-28, 2,71 %	540	540	496
Lower Mattagami Energy	2026-10-21, 2,31 %	1 110	1 091	1 151
Metro	2050-02-28, 3,41 %	137	137	130
NAV Canada	2030-02-28, 2,06 %	412	412	410
	2051-03-29, 2,92 %	7	7	7
North West Redwater Partnership	2027-03-01, 2,80 %	1 573	1 534	1 633
Ontario Power Generation	2030-01-08, 3,22 %	132	132	141
	2050-08-21, 2,95 %	181	181	168
Pembina Pipeline	2027-03-15, 4,24 %	1 110	1 125	1 225
	2029-01-03, 3,62 %	692	711	739
	2048-10-03, 4,54 %	170	180	177
	2049-11-28, 4,67 %	2	2	2
Reliance	2027-10-01, 2,68 %	528	528	535
Rogers Communications	2029-02-01, 3,25 %	855	848	894
Shaw Communications	2030-09-09, 2,90 %	780	779	780
	2049-06-29, 4,25 %	20	20	20
Suncor Énergie inc.	2029-02-24, 3,10 %	425	400	444
	2030-01-09, 5,00 %	70	70	82
	2050-09-04, 3,95 %	41	40	41
TELUS	2027-11-27, 2,35 %	215	214	217
Toromont Industries	2027-07-27, 3,84 %	640	640	696
Toronto Hydro	2029-09-11, 2,43 %	325	325	335
TransCanada PipeLines	2027-02-05, 3,80 %	600	599	651
	2048-01-03, 4,18 %	246	254	252

Relevé des autres investissements (non audité)
Au 30 juin 2021

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
Obligations de sociétés (suite)				
Transcanada Trust	2027-05-18, 4,65 %	855	789	885
Union Gas	2027-08-22, 2,88 %	855	837	907
WSP Global	2028-02-19, 2,41 %	339	339	341
Total obligations de sociétés		40 834	40 448	42 260
Total obligations		314 560	312 922	317 473
Instruments de marché monétaire (13,9 %)				
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto	2021-09-14, 0,22 %	500	500	500
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2021-08-25, 0,18 %	1 775	1 775	1 775
	2021-09-02, 0,18 %	4 583	4 582	4 582
Banque de Montréal	2021-08-03, 0,17 %	11 250	11 248	11 248
Banque Nationale du Canada	2021-09-01, 0,18 %	2 495	2 494	2 494
Banque Royale du Canada	2021-07-29, 0,20 %	4 332	4 331	4 331
	2021-08-06, 0,18 %	3 000	2 999	2 999
	2021-10-21, 0,32 %	1 504	1 503	1 503
Banque Scotia	2021-07-29, 0,18 %	2 750	2 750	2 750
	2021-08-04, 0,18 %	5 000	4 999	4 999
Banque Toronto-Dominion	2021-07-14, 0,18 %	7 000	7 000	7 000
	2021-07-28, 0,18 %	5 000	4 999	4 999
BCI QuadReal Realty	2021-09-02, 0,22 %	3 500	3 499	3 499
Honda Canada Finance	2021-07-29, 0,26 %	7 750	7 748	7 748
	2021-10-12, 0,34 %	3 000	2 997	2 997
Province de l'Île-du-Prince-Édouard	2021-08-10, 0,18 %	1 000	1 000	1 000
Province de l'Ontario	2021-07-07, 0,18 %	1 000	1 000	1 000
	2021-07-21, 0,15 %	5 750	5 750	5 750
	2021-08-04, 0,16 %	4 250	4 249	4 249
	2021-09-01, 0,16 %	18 010	18 004	18 004
Province de Québec	2021-07-09, 0,15 %	2 467	2 467	2 467
	2021-07-09, 0,16 %	500	500	500
	2021-07-23, 0,15 %	6 265	6 264	6 264
	2021-09-24, 0,17 %	1 000	1 000	1 000
Province de Terre-Neuve-et-Labrador	2021-07-13, 0,21 %	1 000	1 000	1 000
	2021-08-05, 0,19 %	1 725	1 725	1 725
	2021-08-16, 0,19 %	2 390	2 389	2 389
	2021-09-29, 0,20 %	9 300	9 295	9 295
Province du Manitoba	2021-08-04, 0,17 %	700	700	700
	2021-08-25, 0,15 %	1 250	1 250	1 250
Société de Transport de Montréal	2021-08-12, 0,20 %	3 000	2 999	2 999
Toyota Credit Canada	2021-11-26, 0,27 %	3 500	3 496	3 496
Total instruments de marché monétaire		126 546	126 512	126 512
Contrats de change (0,0 %)				
Fédération des caisses Desjardins du Québec	2021-09-29, 1,23732 \$ CA/\$ US	105 900	-	(250)
	2021-09-29, 1,47410 \$ CA/€	11 603	-	16
Total contrats de change			-	(234)

Relevé des autres investissements (non audité)
Au 30 juin 2021

(en milliers de dollars)

Description	Nombre de parts	Coût \$	Juste Valeur \$
Fonds d'actions canadiennes (10,3 %)			
Fiducie institutionnelle Fidelity Actions canadiennes à faible volatilité	2 759	37 722	47 086
FNB BMO d'actions canadiennes à faible volatilité	1 499	39 181	46 758
Total fonds d'actions canadiennes		76 903	93 844
Fonds d'actions mondiales (14,9 %)			
Fonds Desjardins IBrix Actions mondiales à faible volatilité	5 691	68 555	75 542
Fonds Desjardins Mondial de dividendes	2 658	53 244	59 510
Total fonds d'actions mondiales		121 799	135 052
Fonds de stratégies d'actions neutres au marché (12,6 %)			
Fonds CC&L Q Marché neutre	192	40 733	47 211
Fonds DGIA Marché neutre	6 348	66 948	67 047
Total fonds de stratégies d'actions neutres au marché		107 681	114 258
Fonds immobiliers (13,3 %)			
Fonds CORE Fiera Immobilier	45	53 816	57 464
Fonds Immobilier Canadien de Prestige de BentallGreenOak Partnerships	7 480	60 032	62 928
Total fonds immobiliers		113 848	120 392
Total autres investissements (100,0 %)		859 665	907 297