

## **Capital régional et coopératif Desjardins**

Relevé des autres investissements

**Au 31 décembre 2021**

(en milliers de dollars canadiens)

**Relevé des autres investissements (non audité)**  
**Au 31 décembre 2021**

| Description                                                        |            |        | Valeur nominale<br>\$ | Coût<br>\$     | Juste valeur<br>\$ |
|--------------------------------------------------------------------|------------|--------|-----------------------|----------------|--------------------|
| <b>Obligations (43,2 %)</b>                                        |            |        |                       |                |                    |
| <b>Obligations fédérales et garanties (25,7%)</b>                  |            |        |                       |                |                    |
| Fiducie du Canada pour l'habitation                                | 2027-06-15 | 2,35 % | 11 480                | 11 923         | 11 923             |
|                                                                    | 2028-03-15 | 2,35 % | 1 800                 | 1 911          | 1 874              |
|                                                                    | 2028-12-15 | 2,65 % | 10 150                | 11 099         | 10 790             |
|                                                                    | 2029-09-15 | 2,10 % | 12 000                | 12 126         | 12 322             |
|                                                                    | 2030-06-15 | 1,75 % | 11 215                | 11 198         | 11 187             |
|                                                                    | 2031-03-15 | 1,10 % | 15 400                | 14 346         | 14 443             |
| Gouvernement du Canada                                             | 2027-03-01 | 1,25 % | 61 500                | 60 912         | 61 364             |
|                                                                    | 2030-12-01 | 0,50 % | 66 455                | 62 000         | 61 536             |
|                                                                    | 2031-12-01 | 1,50 % | 1 000                 | 994            | 1 002              |
|                                                                    | 2045-12-01 | 3,50 % | 1 000                 | 1 424          | 1 361              |
|                                                                    | 2053-12-01 | 1,75 % | 1 000                 | 982            | 1 009              |
| <b>Total obligations fédérales et garanties</b>                    |            |        | <b>193 000</b>        | <b>188 915</b> | <b>188 811</b>     |
| <b>Obligations provinciales, municipales ou garanties (17,5 %)</b> |            |        |                       |                |                    |
| Omers Finance Trust                                                | 2029-05-14 | 2,60 % | 800                   | 800            | 834                |
| Province de la Nouvelle-Écosse                                     | 2028-06-01 | 1,10 % | 3 000                 | 2 997          | 2 878              |
|                                                                    | 2031-12-01 | 2,40 % | 5 000                 | 4 980          | 5 126              |
| Province de la Saskatchewan                                        | 2030-06-02 | 2,20 % | 10 215                | 10 148         | 10 405             |
|                                                                    | 2031-06-02 | 2,15 % | 5 000                 | 4 994          | 5 042              |
| Province de l'Alberta                                              | 2030-06-01 | 2,05 % | 6 650                 | 6 493          | 6 678              |
|                                                                    | 2031-06-01 | 1,65 % | 7 000                 | 6 770          | 6 741              |
|                                                                    | 2043-12-01 | 3,45 % | 235                   | 275            | 270                |
|                                                                    | 2050-06-01 | 3,10 % | 1 400                 | 1 550          | 1 554              |
| Province de l'Ontario                                              | 2028-12-02 | 1,70 % | 18 000                | 16 008         | 15 821             |
|                                                                    | 2030-12-02 | 1,35 % | 13 550                | 13 266         | 12 851             |
|                                                                    | 2031-06-02 | 2,15 % | 3 030                 | 3 018          | 3 061              |
|                                                                    | 2031-12-02 | 2,25 % | 5 000                 | 4 989          | 5 072              |
|                                                                    | 2051-12-02 | 1,90 % | 470                   | 460            | 415                |
|                                                                    | 2052-12-02 | 2,55 % | 1 000                 | 992            | 1 022              |
| Province de Québec                                                 | 2031-09-01 | 1,50 % | 11 000                | 10 408         | 10 514             |
| Province de Terre-Neuve-et-Labrador                                | 2029-06-02 | 2,85 % | 500                   | 519            | 529                |
|                                                                    | 2031-06-02 | 2,05 % | 5 500                 | 5 490          | 5 423              |
|                                                                    | 2050-10-17 | 2,65 % | 1 000                 | 989            | 962                |
| Province du Manitoba                                               | 2030-06-02 | 2,05 % | 3 000                 | 2 999          | 3 020              |
| Province du Nouveau-Brunswick                                      | 2027-08-14 | 2,35 % | 2 500                 | 2 433          | 2 583              |
|                                                                    | 2030-06-03 | 2,50 % | 1 775                 | 1 439          | 1 486              |
| Translink                                                          | 2030-07-03 | 1,60 % | 800                   | 800            | 772                |
| Ville de Toronto                                                   | 2039-09-24 | 2,60 % | 200                   | 199            | 200                |
| <b>Total obligations provinciales, municipales ou garanties</b>    |            |        | <b>132 686</b>        | <b>128 527</b> | <b>128 793</b>     |
| <b>Total obligations</b>                                           |            |        | <b>325 686</b>        | <b>317 442</b> | <b>317 604</b>     |
| <b>Instruments de marché monétaire (1,1 %)</b>                     |            |        |                       |                |                    |
| AltaLink                                                           | 2022-01-31 | 0,26 % | 750                   | 749            | 749                |
| Énergir                                                            | 2022-01-05 | 0,26 % | 750                   | 750            | 750                |
| Gouvernement du Canada                                             | 2022-12-08 | 0,77 % | 900                   | 894            | 894                |
| Intact Corporation financière                                      | 2022-01-11 | 0,27 % | 500                   | 500            | 500                |
|                                                                    | 2022-01-25 | 0,28 % | 250                   | 250            | 250                |
| Province de l'Alberta                                              | 2022-01-04 | 0,14 % | 1 000                 | 1 000          | 1 000              |
| Province de l'Ontario                                              | 2022-01-26 | 0,15 % | 830                   | 830            | 830                |
| Province de Terre-Neuve-et-Labrador                                | 2022-03-01 | 0,60 % | 500                   | 500            | 500                |
| Province du Manitoba                                               | 2022-03-02 | 0,18 % | 2 100                 | 2 099          | 2 099              |
| Société de Transport de Montréal                                   | 2022-02-22 | 0,25 % | 750                   | 750            | 750                |
| <b>Total instruments de marché monétaire</b>                       |            |        | <b>8 330</b>          | <b>8 322</b>   | <b>8 322</b>       |

**Relevé des autres investissements (non audité)**

Au 31 décembre 2021

| Description                                 |            |                     | Valeur nominale<br>\$ | Coût<br>\$ | Juste valeur<br>\$ |
|---------------------------------------------|------------|---------------------|-----------------------|------------|--------------------|
| <b>Contrats de change (0,3 %)</b>           |            |                     |                       |            |                    |
| Fédération des caisses Desjardins du Québec | 2022-06-30 | 1,28485 \$ CA/\$ US | 114 000               | —          | 2 192              |
|                                             | 2022-06-30 | 1,45550 \$ CA/\$ €  | 15 832                | —          | 148                |
| <b>Total contrats de change</b>             |            |                     |                       | —          | 2 340              |

**Relevé des autres investissements (non audité)**

Au 31 décembre 2021

| Description                                                               | Nombre de parts | Coût<br>\$     | Juste valeur<br>\$ |
|---------------------------------------------------------------------------|-----------------|----------------|--------------------|
| <b>Fonds d'actions canadiennes (13,8 %)</b>                               |                 |                |                    |
| Fiducie institutionnelle Fidelity Actions canadiennes à faible volatilité | 2 962           | 41 282         | 51 260             |
| FNB BMO d'actions canadiennes à faible volatilité                         | 1 499           | 42 678         | 50 054             |
| <b>Total fonds d'actions canadiennes</b>                                  |                 | <b>83 960</b>  | <b>101 314</b>     |
| <b>Fonds d'actions mondiales (8,4%)</b>                                   |                 |                |                    |
| Fonds Desjardins Mondial de dividendes                                    | 2 898           | 58 535         | 61 938             |
| <b>Total fonds d'actions mondiales</b>                                    |                 | <b>58 535</b>  | <b>61 938</b>      |
| <b>Fonds de stratégies d'actions neutres au marché (22,4 %)</b>           |                 |                |                    |
| Fonds CC&L Q Marché neutre                                                | 373             | 88 307         | 98 000             |
| Fonds DGIA Marché neutre                                                  | 6 384           | 67 707         | 66 874             |
| <b>Total fonds de stratégies d'actions neutres au marché</b>              |                 | <b>156 014</b> | <b>164 874</b>     |
| <b>Fonds immobiliers (10,8 %)</b>                                         |                 |                |                    |
| Fonds CORE Fiera Immobilier                                               | 57              | 71 343         | 79 192             |
| <b>Total fonds immobiliers</b>                                            |                 | <b>71 343</b>  | <b>79 192</b>      |
| <b>Total autres investissements (100,0 %)</b>                             |                 | <b>695 616</b> | <b>735 584</b>     |