

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements

Au 31 décembre 2022

(en milliers de dollars canadiens)

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 31 décembre 2022

Description			Valeur nominale \$	Coût \$	Juste valeur \$
Obligations (48,8%)					
Obligations fédérales et garanties (23,5 %)					
Fiducie du Canada pour l'habitation	2029-09-15	2,10 %	3 200	2 943	2 896
	2031-03-15	1,10 %	37 375	33 413	30 460
Gouvernement du Canada	2023-03-01	1,75 %	275	275	275
	2028-03-01	3,50 %	23 500	23 363	23 621
	2030-12-01	0,50 %	47 350	38 504	38 188
	2032-06-01	2,00 %	4 300	3 898	3 850
	2032-12-01	2,50 %	16 850	16 084	15 716
	2041-06-01	4,00 %	3 900	4 714	4 232
	2045-12-01	3,50 %	2 500	2 941	2 563
	2048-12-01	2,75 %	6 200	5 936	5 600
	2051-12-01	2,00 %	628	527	477
	2053-12-01	1,75 %	5 699	4 357	4 013
Total obligations fédérales et garanties			151 777	136 955	131 891
Obligations provinciales, municipales ou garanties (25,3 %)					
Hydro-Québec	2060-02-15	2,10 %	3 300	2 169	1 986
Omers Finance Trust	2029-05-14	2,60 %	800	800	734
Province de la Colombie-Britannique	2031-06-18	1,55 %	7 600	7 256	6 277
	2044-06-18	3,20 %	1 200	1 082	1 012
	2050-06-18	2,95 %	4 500	4 185	3 550
Province de la Nouvelle-Écosse	2031-12-01	2,40 %	2 500	2 491	2 190
Province de la Saskatchewan	2042-02-03	3,40 %	1 400	1 312	1 224
	2046-12-02	2,75 %	9 600	8 567	7 310
	2048-06-02	3,30 %	2 400	2 100	2 015
Province de l'Alberta	2033-12-01	3,90 %	1 810	1 720	1 766
	2043-12-01	3,45 %	235	274	206
	2050-06-01	3,10 %	4 325	3 896	3 502
Province de l'Ontario	2026-06-02	2,40 %	1	1	1
	2029-11-01	1,55 %	9 297	8 110	7 983
	2030-12-02	1,35 %	12 995	10 731	10 686
	2039-06-02	4,60 %	5 500	5 422	5 665
	2043-06-02	3,50 %	8 200	7 395	7 260
	2045-06-02	3,45 %	3 400	3 054	2 966
	2046-12-02	2,90 %	13 000	11 932	10 232
	2048-06-02	2,80 %	8 000	6 786	6 133
	2049-06-02	2,90 %	4 350	3 567	3 387
	2051-12-02	1,90 %	10 375	6 824	6 323
	2052-12-02	2,55 %	10 325	8 004	7 362
	2053-12-02	3,75 %	1 620	1 539	1 485
Province de Québec	2032-09-01	3,25 %	10 300	9 939	9 661
	2045-12-01	3,50 %	5 185	4 663	4 564
	2048-12-01	3,50 %	1 600	1 451	1 400
	2051-12-01	3,10 %	11 000	10 561	8 908
	2053-12-01	2,85 %	800	642	611
Province de Terre-Neuve-et-Labrador	2031-06-02	2,05 %	7 500	7 331	6 361
	2050-10-17	2,65 %	1 000	989	690
Province du Manitoba	2030-06-02	2,05 %	3 000	2 999	2 629
	2043-03-05	3,35 %	2 425	2 200	2 069
	2048-09-05	3,40 %	1 850	1 616	1 559
	2052-09-05	2,05 %	527	341	325
Province du Nouveau-Brunswick	2030-06-03	2,50 %	1 775	1 476	1 312
Translink	2030-07-03	1,60 %	800	800	674
Ville de Toronto	2039-09-24	2,60 %	200	199	153
Total obligations provinciales, municipales ou garanties			174 695	154 424	142 171
Total obligations			326 472	291 379	274 062

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 31 décembre 2022

Description			Valeur nominale \$	Coût \$	Juste valeur \$
Instruments de marché monétaire (0,1 %)					
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2023-01-16	4,35 %	59	58	58
Banque de Montréal	2023-01-31	4,27 %	100	100	100
Banque Nationale du Canada	2023-02-15	4,36 %	100	99	99
Banque Royale du Canada	2023-01-16	4,25 %	100	100	100
Banque Scotia	2023-01-16	4,35 %	100	100	100
Banque Toronto-Dominion	2023-01-31	4,30 %	100	100	100
Gouvernement du Canada	2023-09-14	4,15 %	25	24	24
Province de l'Ontario	2023-03-15	4,35 %	100	99	99
Province de Terre-Neuve-et-Labrador	2023-01-12	3,97 %	100	100	100
Total instruments de marché monétaire			<u>784</u>	<u>780</u>	<u>780</u>
Contrats de change (0,1 %)					
Fédération des caisses Desjardins du Québec	2023-03-31, 1,35865\$ CA/\$ US		80 012	—	456
	2023-03-31, 1,45229\$ CA/\$ €		18 700	—	(87)
Total contrats de change				<u>—</u>	<u>369</u>

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 31 décembre 2022

Description	Nombre de parts	Coût \$	Juste valeur \$
Fonds d'actions canadiennes (10,3 %)			
Fiducie institutionnelle Fidelity Actions canadiennes à faible volatilité	1 734 887	26 259	29 341
FNB BMO d'actions canadiennes à faible volatilité	848 543	25 441	28 341
Total fonds d'actions canadiennes		51 700	57 682
Fonds de stratégies d'actions neutres au marché (12,9 %)			
Fonds CC&L Q Marché neutre	292 008	71 747	72 465
Total fonds de stratégies d'actions neutres au marché		71 747	72 465
Fonds immobilier (22,6 %)			
Fonds CORE Fiera Immobilier	62 577	79 810	92 930
Fonds nourricier immobilier direct mondial Invesco	21 814	32 138	33 947
Total fonds immobiliers		111 948	126 877
Fonds infrastructures (5,2 %)			
Fonds DGIA Infrastructures privées mondiales	1	27 311	28 877
Total fonds Infrastructures		27 311	28 877
Total autres investissements (100,0 %)		554 865	561 112