

## **Capital régional et coopératif Desjardins**

Relevé des autres investissements

**Au 30 juin 2023**

(en milliers)

**Relevé des autres investissements (non audité)**
**Au 30 juin 2023**

Description			Valeur nominale \$	Coût \$	Juste valeur \$
<b>Obligations (49,2 %)</b>					
<b>Obligations fédérales et garanties (23,6 %)</b>					
Fiducie du Canada pour l'habitation	2031-03-15	1,10 %	44 075	38 870	36 313
Gouvernement du Canada	2030-12-01	0,50 %	66 425	54 902	54 034
	2031-06-01	1,50 %	2 000	1 786	1 745
	2032-06-01	2,00 %	18 020	16 366	16 214
	2032-12-01	2,50 %	6 500	6 088	6 089
	2033-06-01	2,75 %	1 975	1 889	1 890
	2041-06-01	4,00 %	3 900	4 697	4 307
	2045-12-01	3,50 %	2 500	2 934	2 627
	2048-12-01	2,75 %	6 200	5 939	5 787
	2051-12-01	2,00 %	1 628	1 292	1 288
	2053-12-01	1,75 %	6 699	5 155	4 940
	2055-12-01	2,75 %	500	454	464
<b>Total obligations fédérales et garanties</b>			<b>160 422</b>	<b>140 372</b>	<b>135 698</b>
<b>Obligations provinciales, municipales ou garanties (25,6 %)</b>					
Hydro-Québec	2060-02-15	2,10 %	3 300	2 176	2 111
Province de la Colombie-Britannique	2031-06-18	1,55 %	3 100	2 967	2 591
	2033-06-18	3,55 %	7 750	7 467	7 489
	2044-06-18	3,20 %	1 200	1 083	1 043
	2050-06-18	2,95 %	4 500	4 188	3 687
Province de la Nouvelle-Écosse	2031-12-01	2,40 %	2 500	2 491	2 214
Province de la Saskatchewan	2033-06-02	3,90 %	2 000	1 994	1 985
	2042-02-03	3,40 %	1 400	1 314	1 256
	2046-12-02	2,75 %	9 600	8 581	7 563
	2048-06-02	3,30 %	2 400	2 104	2 087
Province de l'Alberta	2033-12-01	3,90 %	1 810	1 724	1 786
	2043-12-01	3,45 %	235	273	211
	2050-06-01	3,10 %	4 325	3 901	3 612
Province de l'Ontario	2026-06-02	2,40 %	1	1	1
	2029-11-01	1,55 %	5 797	5 105	5 019
	2030-12-02	1,35 %	10 995	9 184	9 159
	2033-06-02	3,65 %	5 110	5 031	4 978
	2039-06-02	4,60 %	5 500	5 424	5 786
	2043-06-02	3,50 %	8 200	7 407	7 492
	2045-06-02	3,45 %	3 400	3 059	3 069
	2046-12-02	2,90 %	13 000	11 945	10 633
	2049-06-02	2,90 %	12 350	9 922	10 031
	2051-12-02	1,90 %	10 375	6 858	6 688
	2052-12-02	2,55 %	7 325	5 693	5 488
	2053-12-02	3,75 %	1 620	1 540	1 552
Province de Québec	2032-09-01	3,25 %	7 050	6 814	6 661
	2033-09-01	3,60 %	3 650	3 585	3 541
	2045-12-01	3,50 %	5 185	4 670	4 713
	2048-12-01	3,50 %	1 600	1 453	1 453
	2051-12-01	3,10 %	11 000	10 566	9 309
	2053-12-01	2,85 %	800	643	641
Province de Terre-Neuve-et-Labrador	2031-06-02	2,05 %	7 500	7 341	6 433
	2050-10-17	2,65 %	1 000	989	718
Province du Manitoba	2043-03-05	3,35 %	2 425	2 204	2 129
	2048-09-05	3,40 %	1 850	1 619	1 616
	2052-09-05	2,05 %	527	343	341
Province du Nouveau-Brunswick	2030-06-03	2,50 %	1 775	1 494	1 345
Translink	2030-07-03	1,60 %	800	800	683
Ville de Toronto	2039-09-24	2,60 %	200	199	158
<b>Total obligations provinciales, municipales ou garanties</b>			<b>173 155</b>	<b>154 152</b>	<b>147 272</b>
<b>Total obligations</b>			<b>333 577</b>	<b>294 524</b>	<b>282 970</b>

**Relevé des autres investissements (non audité)**
**Au 30 juin 2023**

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste valeur \$
<b>Instruments de marché monétaire (0,2 %)</b>				
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2023-09-01 5,02 %	100	99	99
Banque de Montréal	2023-08-29 4,80 %	100	99	99
Banque Nationale du Canada	2023-08-04 4,94 %	100	100	100
Banque Royale du Canada	2023-08-14 4,99 %	100	99	99
Banque Scotia	2023-07-31 4,75 %	100	100	100
Banque Toronto-Dominion	2023-07-17 4,79 %	100	100	100
Gouvernement du Canada	2023-10-26 4,54 %	285	280	280
Intact Corporation financière	2023-07-20 4,99 %	100	100	100
OPB Finance Trust	2023-07-05 4,51 %	100	100	100
<b>Total instruments de marché monétaire</b>		<b>1 085</b>	<b>1 077</b>	<b>1 077</b>
<b>Contrats de change (0,0 %)</b>				
Fédération des caisses Desjardins du Québec	2023-12-29, 1,32150\$ CA/\$ US	66 477 \$ US	—	53
	2023-12-29, 1,44899\$ CA/\$ €	22 261 €	—	(124)
<b>Total contrats de change</b>			<b>—</b>	<b>(71)</b>
<b>Nombre de parts</b>				
<b>Fonds d'actions canadiennes (9,7 %)</b>				
Fiducie institutionnelle Fidelity Actions canadiennes à faible volatilité		1 536 532	23 294	27 910
FNB BMO d'actions canadiennes à faible volatilité		777 023	23 345	27 814
<b>Total fonds d'actions canadiennes</b>			<b>46 639</b>	<b>55 724</b>
<b>Fonds de stratégies d'actions neutres au marché (12,9 %)</b>				
Fonds CC&L Q Marché neutre		292 008	72 048	74 384
<b>Total fonds de stratégies d'actions neutres au marché</b>			<b>72 048</b>	<b>74 384</b>
<b>Fonds immobilier (19,4 %)</b>				
Fonds CORE Fiera Immobilier		54 390	69 707	79 724
Fonds nourricier immobilier direct mondial Invesco		22 112	32 776	31 978
<b>Total fonds immobiliers</b>			<b>102 483</b>	<b>111 702</b>
<b>Fonds infrastructures (8,6 %)</b>				
Fonds DGIA Infrastructures privées mondiales		1	47 383	50 341
<b>Total fonds infrastructures</b>			<b>47 383</b>	<b>50 341</b>

**Relevé des autres investissements (non audité)**  
**Au 30 juin 2023**

Description	Nombre d'actions	Coût \$	Juste valeur \$
<b>Stratégie neutre au marché (0,0%)</b>			
<b>Actions cotées (3.3%)</b>			
AECOM	5 573	627	625
Arch Capital Group Ltd.	4 404	418	437
Bombardier Inc. Class B Subordinate Voting Shares	5 672	338	370
Brookfield Corporation	11 102	475	495
Brookfield Renewable Partners L.P.	7 562	300	296
Cameco Corporation	7 289	303	302
Canadian Pacific Kansas City Limited	2 903	303	311
Colliers International Group Inc. Subordinate Voting Shares	4 799	608	624
Dollar General Corporation	1 325	300	298
Dollarama Inc.	5 698	448	511
FedEx Corporation	1 546	490	508
FirstService Corporation	1 521	300	310
GE HealthCare Technologies Inc.	2 886	311	311
Hydro One Limited	8 099	299	307
iA Financial Corporation Inc.	3 662	301	330
Imperial Oil Limited	9 202	608	624
Invesco S&P 500 Low Volatility ETF	5 500	455	458
Loblaw Companies Limited	7 516	907	912
Meta Platforms Inc.	1 286	482	489
Netflix Inc.	509	297	297
NVIDIA Corporation	837	475	469
Open Text Corporation	5 385	289	297
PepsiCo Inc.	1 214	298	298
Power Corporation of Canada	23 122	834	825
Quebecor Inc. Class B Subordinate Voting Shares	14 106	445	461
RB Global Inc.	7 852	604	624
RB Global Inc. (US)	7 831	606	622
Restaurant Brands International Inc.	5 936	603	610
Rogers Communications Inc. Class B Non-voting Shares	9 545	616	576
S&P Global Inc.	912	476	484
Shopify Inc.	3 482	300	298
SNC-Lavalin Group Inc.	12 969	437	451
SPDR S&P Homebuilders ETF *	2 911	305	310
TC Énergie	11 353	611	608
Teck Resources Limited	10 783	620	601
The Progressive Corporation	2 348	426	412
The Sherwin-Williams Company	1 363	421	478
Thomson Reuters Corporation	5 330	913	953
Tourmaline Oil Corp.	4 859	300	303
WSP Global Inc.	3 024	534	529
<b>Total actions cotées</b>		<b>18 683</b>	<b>19 024</b>

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

**Au 30 juin 2023**

Description	Nombre d'actions	Coût \$	Juste valeur \$
<b>Engagements afférents à des titres vendus à découvert (-3.3%)</b>			
3M Company	(1 321)	(192)	(175)
BHP Group Limited	(7 376)	(572)	(583)
Brookfield Infrastructure Partners L.P.	(6 064)	(297)	(294)
Canadian National Railway Company	(3 822)	(603)	(613)
Canadian Tire Corporation Limited Class A Non-Voting Shares	(4 926)	(868)	(892)
CBRE Group Inc.	(5 943)	(604)	(635)
Chubb Limited	(1 590)	(408)	(406)
Enbridge Inc.	(12 496)	(624)	(615)
Financial Select Sector SPDR Fund *	(9 670)	(419)	(432)
FINB BMO équilibré banques	(15 861)	(543)	(533)
Global X Uranium ETF	(10 449)	(301)	(300)
Great-West Lifeco Inc.	(21 630)	(805)	(832)
Industrial Select Sector SPDR Fund *	(9 781)	(1 326)	(1 390)
Invesco QQQ Trust Series **	(1 571)	(762)	(769)
Invesco S&P 500 Equal Weight ETF	(2 442)	(472)	(484)
iShares S&P/TSX 60 Index ETF **	(151 113)	(4 610)	(4 644)
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF **	(21 176)	(298)	(307)
Materials Select Sector SPDR Fund *	(4 304)	(443)	(473)
Real Estate Select Sector SPDR Fund *	(6 206)	(302)	(309)
SPDR S&P 500 ETF Trust *	(2 360)	(1 352)	(1 386)
Suncor Energy Inc.	(15 947)	(605)	(620)
Technology Select Sector SPDR Fund *	(3 396)	(779)	(782)
TELUS Corporation	(39 201)	(1 042)	(1 011)
United Parcel Service Inc. Class B	(2 148)	(487)	(510)
<b>Total engagements afférents à des titres vendus à découvert</b>		<u>(18 714)</u>	<u>(18 995)</u>
<b>Total stratégie neutre au marché</b>		<u>(31)</u>	<u>29</u>
<b>Total autres investissements (100,0 %)</b>		<u><b>564 123</b></u>	<u><b>576 156</b></u>

\* Émetteur: State Street Global Advisors

\*\* Émetteur: BlackRock