

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements

Au 31 décembre 2023

(en milliers de dollars canadiens)

Relevé des autres investissements non audité (en milliers de dollars canadiens)

Au 31 décembre 2023

Description			Valeur nominale \$	Coût \$	Juste valeur \$
Obligations (45,7 %)					
Obligations fédérales ou garanties (19,6 %)					
Fiducie du Canada pour l'habitation	2031-03-15	1,10 %	30 500	27 200	25 987
Gouvernement du Canada	2030-12-01	0,50 %	51 425	43 008	43 187
	2045-12-01	3,50 %	2 500	2 927	2 668
	2048-12-01	2,75 %	6 200	5 943	5 882
	2053-12-01	1,75 %	45 239	34 405	33 970
	2053-12-01	1,75 %	16 260	12 292	12 210
	2055-12-01	2,75 %	1 929	1 655	1 818
Total obligations fédérales et garanties			154 053	127 430	125 722
Obligations provinciales, municipales ou garanties (25,8 %)					
Fair Hydro Trust	2037-11-15	3,52 %	900	791	834
Hydro-Québec	2060-02-15	2,10 %	3 300	2 183	2 171
Province de la Colombie-Britannique	2031-06-18	1,55 %	3 100	2 975	2 678
	2044-06-18	3,20 %	1 200	1 085	1 060
	2050-06-18	2,95 %	4 500	4 192	3 738
Province de la Saskatchewan	2042-02-03	3,40 %	1 400	1 315	1 279
	2046-12-02	2,75 %	9 600	8 596	7 715
	2048-06-02	3,30 %	2 400	2 107	2 119
Province de l'Alberta	2043-12-01	3,45 %	235	272	215
	2050-06-01	3,10 %	4 325	3 906	3 671
Province de l'Ontario	2026-06-02	2,40 %	1	1	1
	2039-06-02	4,60 %	3 000	2 959	3 215
	2041-06-02	4,65 %	2 300	2 217	2 477
	2043-06-02	3,50 %	11 470	10 205	10 642
	2045-06-02	3,45 %	3 400	3 064	3 116
	2046-12-02	2,90 %	39 000	33 890	32 455
	2048-06-02	2,80 %	30 000	24 290	24 367
	2049-06-02	2,90 %	12 255	9 917	10 112
	2050-12-02	2,65 %	9 506	6 616	7 443
	2051-12-02	1,90 %	14 875	9 506	9 810
	2052-12-02	2,55 %	9 475	7 145	7 234
	2054-12-02	4,15 %	1 000	978	1 041
Province de Québec	2045-12-01	3,50 %	10 685	9 793	9 861
	2048-12-01	3,50 %	1 600	1 454	1 474
	2051-12-01	3,10 %	11 000	10 570	9 446
	2053-12-01	2,85 %	800	644	652
Province de Terre-Neuve-et-Labrador	2050-10-17	2,65 %	1 000	989	734
Province du Manitoba	2043-03-05	3,35 %	2 425	2 207	2 158
	2048-09-05	3,40 %	1 850	1 621	1 632
	2052-09-05	2,05 %	527	344	346
Province du Nouveau-Brunswick	2030-06-03	2,50 %	1 775	1 513	1 405
Translink	2030-07-03	1,60 %	800	800	707
Ville de Toronto	2039-09-24	2,60 %	200	199	164
Total obligations provinciales, municipales ou garanties			199 904	168 344	165 972
Obligations d'institutions financières (0,3 %)					
Banque Royale du Canada	2024-11-15	5,49 % *	1 750	1 750	1 750
Total obligations d'institutions financières			1 750	1 750	1 750
Total obligations			355 707	297 524	293 444

* Taux variable

Relevé des autres investissements non audité (en milliers de dollars canadiens)
Au 31 décembre 2023

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste valeur \$
Instruments de marché monétaire (6,5 %)				
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2024-01-03 5,30 %	750	749	749
	2024-01-04 5,31 %	2 000	1 998	1 998
	2024-01-31 5,31 %	1 513	1 506	1 506
Banque de Montréal	2024-01-08 5,28 %	750	749	749
	2024-01-15 5,26 %	1 750	1 746	1 746
	2024-02-29 5,17 %	375	372	372
	2024-03-01 5,16 %	4 000	3 965	3 965
Banque Manuvie	2024-02-01 5,32 %	2 800	2 786	2 786
	2024-04-30 5,42 %	1 500	1 473	1 472
Banque Nationale du Canada	2024-01-17 5,31 %	1 750	1 745	1 745
	2024-03-20 5,18 %	1 198	1 184	1 184
	2024-01-23 5,30 %	1 250	1 245	1 246
Banque Royale du Canada	2024-03-18 5,20 %	1 000	989	989
	2024-01-29 5,34 %	1 500	1 493	1 493
Banque Scotia	2024-01-15 5,31 %	3 000	2 993	2 993
	2024-03-26 5,35 %	1 033	1 020	1 020
Banque Toronto Dominion	2024-01-08 5,35 %	800	799	799
	2024-02-08 5,22 %	1 500	1 491	1 491
	2024-01-16 5,35 %	1 750	1 745	1 746
	2024-07-25 5,70 %	100	97	97
Gouvernement du Canada	2024-06-06 4,98 %	750	734	734
Honda Canada Finance	2024-02-12 5,33 %	4 040	4 014	4 014
Intact Corporation financière	2024-01-11 5,16 %	1 000	998	998
Province de l'Île-du-Prince-Édouard	2024-03-05 5,12 %	2 000	1 981	1 981
Société de Transport de Montréal	2024-01-22 5,14 %	4 000	3 987	3 986
Total instruments de marché monétaire		42 109	41 859	41 859
Contrats de change (0,1 %)				
Fédération des caisses Desjardins du Québec	2024-06-28, 1,32728\$ CA/\$ US	58 086 \$ US	—	548
	2024-06-28, 1,44904\$ CA/\$ €	18 668 €	—	33
Total contrats de change			—	581
Nombre de parts				
Fonds d'actions canadiennes (8,8 %)				
Fiducie institutionnelle Fidelity Actions canadiennes à faible volatilité		1 593 125	24 363	29 213
FNB BMO d'actions canadiennes à faible volatilité		777 023	23 391	27 066
Total fonds d'actions canadiennes			47 754	56 279
Fonds immobiliers (16,5 %)				
Fonds CORE Fiera Immobilier		54 390	70 050	75 817
Fonds nourricier immobilier direct mondial Invesco		22 112	32 968	30 338
Total fonds immobiliers			103 018	106 155
Fonds infrastructures (9,9 %)				
Fonds DGIA Infrastructures privées mondiales		1	60 000	63 923
Total fonds infrastructures			60 000	63 923
Fonds de stratégies d'actions neutres au marché (12,5 %)				
Fonds CC&L Q Marché neutre		331 109	82 781	80 387
Total fonds de stratégies d'actions neutres au marché			82 781	80 387

Relevé des autres investissements non audité (en milliers de dollars canadiens)

Au 31 décembre 2023

Description	Nombre d'actions	Coût \$	Juste valeur \$
Stratégie neutre au marché (0,0%)			
Actions cotées (2.4%)			
Air Canada	10 049	189	188
Alimentation Couche-Tard inc. Catégorie A	4 660	348	364
Alphabet Inc. Class C	323	61	60
Amazon.com Inc.	894	178	180
ARC Resources Ltd.	14 341	308	282
Arch Capital Group Ltd.	1 871	215	184
AtkinsRéalis Canada inc.	26 148	1 025	1 115
ATS Corporation	5 321	287	304
Banque de Montréal	466	56	61
Banque Nationale du Canada	3 041	281	307
Banque Royale du Canada	2 286	261	306
Bombardier inc. Catégorie B Actions à vote subalterne	3 769	187	201
Brookfield Corporation	5 614	304	298
Brookfield Infrastructure Partners L.P.	4 426	181	185
Cameco Corporation	4 891	286	279
Cameco Corporation US	8 850	479	505
Canadian Natural Resources Limited	4 847	426	421
Crescent Point Energy Corp.	37 365	364	343
Dollarama Inc.	1 703	158	163
Financière Manuvie	10 873	308	318
Finning International Inc.	8 360	309	320
FirstService Corporation	2 445	488	525
Five Below Inc.	1 161	303	328
Franco-Nevada Corporation	2 025	300	297
General Motors Company	10 230	446	487
Groupe WSP Global inc.	2 270	424	422
Howmet Aerospace Inc.	2 564	169	184
iShares Russell 2000	1 378	356	366
Marathon Petroleum Corporation	304	64	60
Mastercard Incorporated A	751	389	424
McKesson Corporation	400	248	245
Meta Platforms Inc.	260	110	122
NextEra Energy, Inc.	3 713	316	299
NVIDIA Corporation	715	454	469
O'Reilly Automotive, Inc.	45	60	57
PACCAR Inc.	1 421	176	184
Pembina Pipeline Corporation	12 307	527	554
Prologis, Inc.	1 027	180	182
RB Global, Inc.	11 414	892	1 012
RB Global, Inc. (US)	5 908	494	524
Restaurant Brands International Inc.	617	57	64
Restaurant Brands International Inc. (US)	3 234	269	271
Rogers Communications Inc. Class B Non-voting Shares	989	61	61
TFI International Inc.	1 351	216	244
The Descartes Systems Group Inc.	2 920	306	325
The Progressive Corporation	1 376	285	290
Waste Connections	4 467	812	884
Wheaton Precious Metals Corp.	2 771	175	181
Total actions cotées		14 788	15 445

Relevé des autres investissements non audité (en milliers de dollars canadiens)

Au 31 décembre 2023

Description	Nombre d'actions	Coût \$	Juste valeur \$
Engagements afférents à des titres vendus à découvert (-2.4%)			
Apple Inc.	(242)	(63)	(62)
Banque Toronto Dominion	(3 635)	(298)	(311)
BCE Inc.	(2 839)	(153)	(148)
Canadian Tire Corporation, Limited Class A Non-Voting Shares	(431)	(59)	(61)
Chubb Limited	(986)	(302)	(295)
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	(1 923)	(300)	(320)
Consumer Discretionary Select Sector SPDR Fund **	(1 274)	(293)	(302)
Consumer Staples Select Sector SPDR Fund	(2 827)	(269)	(270)
Costco Wholesale Corporation	(205)	(176)	(179)
Cummins Inc.	(567)	(173)	(180)
Energy Select Sector SPDR Fund **	(538)	(62)	(60)
Financial Select Sector SPDR Fund **	(6 125)	(305)	(305)
FINB BMO équilibré banques	(8 752)	(266)	(310)
Fortis Inc.	(5 477)	(300)	(299)
Fox Corporation Class B	(3 314)	(123)	(121)
Global X Uranium ETF	(13 677)	(487)	(502)
Great-West Lifeco Inc.	(1 403)	(61)	(62)
Hydro One Limited	(4 736)	(186)	(188)
Industrial Select Sector SPDR Fund **	(4 701)	(680)	(710)
Invesco QQQ Trust Series ***	(680)	(365)	(369)
iShares S&P/TSX 60 Index ETF ***	(171 664)	(5 195)	(5 497)
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF ***	(21 771)	(364)	(338)
Johnson & Johnson Inc.	(1 219)	(250)	(253)
Magna International Inc.	(6 993)	(517)	(547)
Nestle S.A. (US)	(1 217)	(185)	(186)
Real Estate Select Sector SPDR Fund **	(3 452)	(185)	(183)
Royal Gold Inc.	(1 852)	(300)	(297)
TC Énergie	(13 505)	(708)	(699)
Technology Select Sector SPDR Fund **	(1 833)	(461)	(467)
TELUS Corporation	(5 190)	(127)	(122)
Thomson Reuters Corporation	(2 206)	(412)	(427)
Tourmaline Oil Corp.	(4 586)	(305)	(273)
U.S. Global JETS ETF	(7 360)	(189)	(186)
Utility Select Sector SPDR Fund **	(3 596)	(321)	(302)
VanEck Junior Gold Miners	(3 554)	(179)	(178)
VISA INC.	(1 234)	(401)	(426)
Total engagements afférents à des titres vendus à découvert		<u>(15 020)</u>	<u>(15 435)</u>
Total stratégie neutre au marché		<u>(232)</u>	<u>10</u>
Total autres investissements (100,0 %)		<u>632 704</u>	<u>642 638</u>

** Émetteur: State Street Global Advisors

*** Émetteur: BlackRock