

2016

**Renseignements
additionnels au
Rapport annuel**



Renseignements additionnels au Rapport annuel 2016

I. TABLEAUX DES RENDEMENTS

| | | |
|----|---|----|
| 1 | Rapport de l'auditeur indépendant sur la conformité | 5 |
| 2 | Rapport de l'auditeur indépendant | 6 |
| 3 | Notes générales | 8 |
| 4 | Obligations | 10 |
| 5 | Dettes immobilières | 12 |
| 6 | Valeurs à court terme | 14 |
| 7 | Obligations à long terme..... | 15 |
| 8 | Immeubles | 17 |
| 9 | Infrastructures | 20 |
| 10 | Obligations à rendement réel | 22 |
| 11 | Marchés boursiers | 23 |
| 12 | Placements privés | 24 |
| 13 | Fonds équilibré | 26 |

II. STATISTIQUES FINANCIÈRES ET RÉTROSPECTIVE

| | | |
|-----|--|-----|
| 1. | Évolution de l'actif net attribuable aux déposants | 30 |
| 2. | Variation de l'actif net attribuable aux déposants et de l'actif total sous gestion | 31 |
| 3. | Évolution de l'avoir des déposants | 32 |
| 4. | Ventilation de l'avoir des déposants | 40 |
| 5. | Intérêt ou revenu annuel versé sur les dépôts moyens | 41 |
| 6. | Sommaire des placements | 42 |
| 7. | Ventilation des placements | 43 |
| 8. | Secteur immobilier - Financements de 5 M\$ et plus | 45 |
| 9. | Investissements en actions, en obligations et en créances d'entreprises de sociétés cotées | 54 |
| 10. | Investissements en actions, en obligations et en créances d'entreprises de sociétés fermées | 142 |
| 11. | Relevé des biens immobiliers | 159 |
| 12. | Relevé des biens immobiliers détenus à des fins de revente | 161 |

Le Code d'éthique et de déontologie des dirigeants et des employés est disponible sur le site Web de la Caisse (www.cdpg.com), sous l'onglet Gouvernance.

I. Tableaux des rendements

Caisse de dépôt et placement du Québec
pour la période terminée le 31 décembre 2016

Présentation conforme GIPS^{MD}

Rapport de l'auditeur indépendant sur la conformité de l'ensemble de la société aux normes « Global Investment Performance Standards »

Aux administrateurs de la
Caisse de dépôt et placement du Québec

Nous avons procédé à un audit visant à déterminer si l'ensemble de Caisse de dépôt et placement du Québec (la « Société ») se conformait aux exigences liées à l'élaboration des composites prévues par les normes Global Investment Performance Standards (les « normes GIPS ») pour l'année se terminant au 31 décembre 2016 et à la conception de ses procédés et procédures pour calculer et présenter les résultats conformément aux normes GIPS au 31 décembre 2016. La responsabilité de la conformité aux normes GIPS incombe à la direction de la Société. Notre responsabilité consiste à exprimer une opinion sur la base de notre audit.

Notre audit a été effectué conformément aux normes d'audit généralement reconnues du Canada. Ces normes requièrent que nous planifions et réalisons l'audit de façon à obtenir l'assurance raisonnable que la Société a respecté les critères établis par les normes GIPS. L'audit comprend le contrôle par sondages des éléments probants à l'appui de la conformité, l'appréciation de la conformité générale aux critères en cause et l'évaluation, le cas échéant, des principes comptables suivis et des estimations importantes faites par la direction.

À notre avis, la Société s'est conformée aux normes GIPS pour l'année terminée au 31 décembre 2016, notamment aux exigences liées à l'élaboration des composites dans l'ensemble de la Société, et à la conception de ses procédés et procédures pour calculer et présenter les résultats conformément aux normes GIPS au 31 décembre 2016.

Nous avons publié un rapport d'audit distinct sur les composites individuels de la Société datées du 21 février 2017 et, par conséquent, nous n'exprimons aucune opinion ni aucune autre forme d'assurance au sujet des résultats dans le présent rapport sur la conformité.

21 février 2017

Deloitte S.E.N.C.R.L./p.r.l.¹

¹ CPA auditeur, CA, permis de comptabilité publique n° A110972

Rapport de l'auditeur indépendant

Aux administrateurs de la
Caisse de dépôt et placement du Québec

Nous avons audité le calcul du rendement présenté dans le Sommaire des rendements (« le Sommaire ») ci-joint de la Caisse de dépôt et placement du Québec pour l'année se terminant le 31 décembre 2016. Le Sommaire a été préparé par la direction de Caisse de dépôt et placement du Québec selon les normes Global Investment Performance Standards (GIPS) du CFA Institute, tel qu'il est décrit dans les notes du Sommaire.

Responsabilité de la direction

La direction a la responsabilité de la préparation de l'information conformément aux Global Investment Performance Standards (GIPS), tel qu'il est décrit dans les notes du Sommaire, ainsi que du contrôle interne qu'elle considère comme nécessaire pour permettre la préparation du Sommaire exempt d'anomalies significatives, que celles-ci résultent de fraudes ou d'erreurs. La direction est également responsable de déterminer si le référentiel d'information financière applicable est acceptable dans les circonstances.

Responsabilité de l'auditeur

Notre responsabilité consiste à exprimer une opinion sur le Sommaire, sur la base de notre audit. Nous avons effectué notre audit selon les normes d'audit généralement reconnues du Canada. Ces normes requièrent que nous planifions et réalisons les procédures liées à l'audit et à l'analyse des rendements établie par les normes GIPS et d'autres procédures que nous avons jugées nécessaires dans les circonstances.

Un audit implique la mise en œuvre de procédures en vue de recueillir des éléments probants concernant les montants et les informations fournis dans le Sommaire. Le choix des procédures relève du jugement de l'auditeur, et notamment de son évaluation des risques que le Sommaire comporte des anomalies significatives, que celles-ci résultent de fraudes ou d'erreurs. Dans l'évaluation de ces risques, l'auditeur prend en considération le contrôle interne de l'entité portant sur la préparation du Sommaire afin de concevoir des procédures d'audit appropriées aux circonstances, et non dans le but d'exprimer une opinion sur l'efficacité du contrôle interne de l'entité. Un audit comporte également l'appréciation du caractère approprié des méthodes comptables retenues et du caractère raisonnable des estimations comptables faites par la direction, de même que l'appréciation de la présentation d'ensemble du Sommaire.

Nous estimons que les éléments probants que nous avons obtenus sont suffisants et appropriés pour fonder notre opinion d'audit.

Opinion

À notre avis, le Sommaire donne, dans tous ses aspects significatifs, une image fidèle des rendements des composites et de l'indice de référence de la Société pour l'exercice terminé le 31 décembre 2016 conformément à la méthode de calcul requise par les Global Investment Performance Standards (GIPS) du CFA Institute, tel qu'il est décrit dans les notes du Sommaire.

Autres questions

Nous avons publié un rapport d'audit distinct sur la conformité de l'ensemble de la Société aux Global Investment Performance Standards (GIPS) daté du 21 février 2017 et, par conséquent, nous n'exprimons aucune opinion ni aucune autre forme d'assurance au sujet des résultats dans le présent rapport.

Référentiel de calcul des rendements et restrictions quant à la diffusion et à l'utilisation

Sans modifier notre opinion, nous attirons votre attention aux notes relatives au Sommaire, qui décrivent les bases de calcul des rendements. Le Sommaire a été préparé de manière à répondre aux exigences des Global Investment Performance Standards (GIPS). En conséquence, il est possible que le Sommaire ne puisse se prêter à un usage autre.

21 février 2017

Deloitte S.E.N.C.R.L / p.r.l.¹

¹ CPA auditeur, CA, permis de comptabilité publique n° A110972



Notes générales

1. Présentation de la firme

La Caisse de dépôt et placement du Québec (la Caisse) est une institution financière qui gère des fonds provenant de régimes de retraite et d'assurance publics et parapublics québécois (les déposants). La Caisse investit dans les grands marchés liquides et sous forme de placements privés et d'investissements immobiliers. L'actif net attribuable aux déposants, excluant les dépôts à vue et dépôts à terme, s'établissait à 270,0 G\$ au 31 décembre 2016. Ce document présente les rendements relatifs aux fonds confiés à la Caisse par les déposants (voir la note 7, p. 9).

2. Énoncé de conformité

La Caisse est en conformité avec les Normes internationales de présentation des performances GIPS^{MD} (Normes GIPS^{MD}) et a préparé et présenté ce rapport conformément aux Normes GIPS^{MD}. La Caisse a été vérifiée de façon indépendante pour les exercices allant du 1^{er} janvier 2006 au 31 décembre 2016.

La vérification détermine si (1) la Caisse a été en conformité avec toutes les exigences de construction des composites des Normes GIPS^{MD} au niveau de l'ensemble de la firme comme défini ci-dessus et que (2) les processus et procédures de la Caisse sont conçus de manière à calculer et à présenter les performances conformément aux Normes GIPS^{MD}. Les composites ont fait l'objet d'un examen de performance pour les exercices allant du 1^{er} janvier 2007 au 31 décembre 2016.

3. Calculs de rendement

Les calculs de rendement sont basés sur des évaluations mensuelles. La formule Dietz modifiée est utilisée pour calculer le rendement. Tous les dépôts et retraits des déposants sont faits le premier jour de chaque mois. Ainsi, les flux monétaires n'ont pas d'incidence sur les rendements.

Chaque portefeuille discrétionnaire pour lequel la Caisse impute des charges d'exploitation est représenté dans au moins un composite. L'évaluation de ces composites est basée sur les dates de transaction et les rendements sont calculés mensuellement. Ces rendements sont ensuite liés géométriquement pour produire les rendements trimestriels et annuels.

Les rendements totaux, incluant les gains ou les pertes réalisés à la vente de placements, les gains et les pertes non réalisés, ainsi que les revenus et dépenses de placement sont utilisés pour calculer les rendements. Ces rendements incluent le rendement généré par la trésorerie et les équivalents de trésorerie. Les revenus d'intérêts sont courus et sont inclus dans les justes valeurs utilisées pour calculer les rendements. Les revenus de dividendes sont inscrits généralement à la date ex-dividende.

Conformément à la décision du Conseil des normes comptables du Canada (CNC), la Caisse a adopté les Normes internationales d'information financière (IFRS) depuis le 1^{er} janvier 2014. La Caisse se qualifie à titre d'entité d'investissement selon les IFRS. De cette façon, l'ensemble des instruments financiers sont évalués à la juste valeur conformément à l'IFRS 13 *Évaluation de la juste valeur*.

Les IFRS exigent qu'une société se qualifiant à titre d'entité d'investissement ne consolide pas ses filiales, mais les évalue à la juste valeur à titre de placement. La juste valeur des filiales est établie selon une technique d'évaluation d'entreprise qui reflète, entre autres, la juste valeur des instruments financiers détenus directement par ces filiales. Auparavant, selon les principes comptables généralement reconnus du Canada, les composites incluaient la consolidation des actifs et des passifs des filiales. Ce changement concerne les composites Dettes immobilières, Immeubles, Infrastructures et Placements privés.

Tous les composites ont adopté les IFRS au cours de l'exercice se terminant le 31 décembre 2014. L'adoption des nouvelles normes au 1^{er} janvier 2014 n'avait eu aucune incidence sur les rendements présentés. Toutefois, le composite Immeubles avait adopté les IFRS par anticipation le 1^{er} janvier 2012.

Pour de plus amples détails sur les techniques d'évaluation ainsi que sur les politiques, directives et procédures entourant l'évaluation de la juste valeur, veuillez vous référer à la note 7 des états financiers consolidés.

La juste valeur des titres à revenu fixe est déterminée au moyen des prix de fermeture publiés par des courtiers, ainsi que ceux fournis par des institutions financières reconnues, lorsque ces valeurs sont disponibles. Lorsqu'un prix n'est pas disponible, la juste valeur est déterminée au moyen de techniques d'évaluation utilisées dans les marchés des capitaux, telle que l'actualisation au taux d'intérêt courant des flux de trésorerie futurs. Pour de plus amples détails sur la méthodologie employée pour évaluer les BTAA (billets à terme adossés à des actifs), veuillez vous référer à la note 7 des états financiers consolidés.

La juste valeur des actions cotées est déterminée à partir des prix de fermeture des principales Bourses.

Les évaluations des actions non cotées sont réalisées selon des techniques d'évaluation couramment employées ou sur la base de transactions comparables conclues sans lien de dépendance. Les évaluations des actions et des valeurs convertibles



non cotées sont revues par le comité d'évaluation de la Caisse. Certaines évaluations sont revues semi-annuellement par des firmes externes indépendantes. La juste valeur des fonds d'investissement est déterminée selon la juste valeur de l'actif net fournie par le commandité ou l'administrateur.

La proportion de détention des déposants dans les composites Placements privés, Infrastructures et Immeubles ne varie pas entre les périodes d'évaluation.

Les instruments financiers dérivés sont comptabilisés à leur juste valeur. La juste valeur des instruments financiers dérivés est établie selon le type d'instrument financier dérivé. La juste valeur des instruments financiers dérivés négociés sur les marchés réglementés et réglés sur une chambre de compensation est établie respectivement selon les prix des principales bourses représentant le marché actif et selon les prix des chambres de compensation. Pour les instruments financiers dérivés négociés sur les marchés hors cote, la juste valeur de ces instruments est établie par des techniques d'évaluation reconnues et couramment employées telles que l'actualisation des flux de trésorerie futurs ou d'autres modèles financiers. Ces techniques nécessitent l'élaboration et l'utilisation d'hypothèses tenant compte de données d'entrées observables et non observables telles que les courbes de taux d'intérêt et les écarts de crédit qui constituent les taux d'actualisation ainsi que les courbes de taux de change, les prix des sous-jacents et la volatilité.

La Caisse peut, dans certains pays, bénéficier d'une exemption de taxes ou d'un taux réduit de taxation à l'égard des revenus et des intérêts, en vertu du droit interne ou du traité fiscal entre le Canada et le pays visé. Les rendements des composites sont présentés après les taxes de non-résident, si applicables. Ailleurs qu'au Canada, les rendements des indices de référence sont présentés après les taxes de non-résident.

4. Mesure de risque

Pour le composite Fonds équilibré, la dispersion des rendements annuels est mesurée par l'écart-type des rendements annuels des comptes des déposants présents durant toute l'année dans le composite.

Pour les autres composites, cette mesure de dispersion n'est pas utilisée car le nombre de portefeuilles dans chacun de ces composites est inférieur à 5. La dispersion des rendements est mesurée par l'écart-type annualisé des rendements mensuels du composite et de son indice sur une période mobile de trois ans.

Pour les composites Placements privés, Infrastructures et Immeubles, dont l'évaluation complète des placements est effectuée semestriellement, cette information n'est pas présentée.

5. Charges d'exploitation et autres frais

En raison de la nature de la Caisse, les charges d'exploitation et autres frais qui sont imputés aux composites sont les frais réels encourus pour gérer ces fonds. La somme de ces frais est répartie selon des inducteurs appropriés aux activités de placement. Tous les rendements dans cette présentation sont calculés après les frais de transaction, les frais de gestion externe des fonds d'investissement, et les charges des filiales immobilières non consolidées, mais avant les charges d'exploitation et autres frais. Pour chaque composite, les frais réels encourus sont présentés en points centésimaux (p.c.).

6. Devise de présentation

Tous les rendements et les actifs sont présentés en dollars canadiens.

7. Actif net sous gestion

L'actif net sous gestion correspond à l'actif net attribuable aux déposants présenté aux états financiers consolidés, ajusté afin d'exclure les actifs qui ne font pas partie de la firme comme définie dans la note 1, soit les dépôts à vue et les dépôts à terme des déposants.

8. Information complémentaire

Le manuel de procédures internes concernant l'évaluation des placements, les calculs de rendements et la préparation de cette présentation de rendements est disponible sur demande pour les déposants existants ou potentiels en écrivant à servicesadministratifsdeposants@cdpq.com.

Obligations

Rendement et actif net sous gestion pour les années terminées le 31 décembre :

| | Rendement (%) | | | Risque (%) | | Actif net (k\$) | |
|------|---------------|--------|--------|----------------------|-------------------|-----------------|------------------------|
| | Composite | Indice | Écart | Écart-type rendement | Écart-type indice | Composite | Actif net sous gestion |
| 2016 | 3,09 | 1,73 | 1,36 | 3,50 | 4,03 | 68 074 757 \$ | 270 018 068 \$ |
| 2015 | 3,82 | 3,75 | 0,08 | 3,59 | 4,14 | 67 860 038 \$ | 247 494 947 \$ |
| 2014 | 8,23 | 8,87 | (0,64) | 2,68 | 3,07 | 62 869 594 \$ | 225 433 142 \$ |
| 2013 | 0,24 | (1,20) | 1,44 | 2,86 | 3,19 | 55 016 405 \$ | 199 690 933 \$ |
| 2012 | 4,30 | 3,58 | 0,72 | 2,90 | 3,02 | 43 789 616 \$ | 175 192 938 \$ |
| 2011 | 10,10 | 9,81 | 0,29 | 3,28 | 3,28 | 41 600 376 \$ | 158 706 574 \$ |
| 2010 | 8,45 | 6,84 | 1,60 | 3,80 | 3,78 | 40 038 013 \$ | 151 387 764 \$ |
| 2009 | 6,38 | 5,41 | 0,97 | 3,59 | 3,60 | 37 645 302 \$ | 131 103 348 \$ |
| 2008 | 4,82 | 6,41 | (1,59) | 3,55 | 3,61 | 44 161 584 \$ | 117 950 388 \$ |
| 2007 | 3,76 | 3,68 | 0,07 | 3,02 | 3,04 | 39 445 960 \$ | 155 140 783 \$ |

Rendement annualisé au 31 décembre (en pourcentage) :

| | 1 an | 2 ans | 3 ans | 4 ans | 5 ans | 6 ans | 7 ans | 8 ans | 9 ans | 10 ans |
|-------------|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|
| Composite | 3,09 | 3,46 | 5,03 | 3,81 | 3,91 | 4,91 | 5,41 | 5,53 | 5,45 | 5,28 |
| 2016 Indice | 1,73 | 2,73 | 4,74 | 3,23 | 3,30 | 4,35 | 4,71 | 4,79 | 4,97 | 4,84 |
| Écart | 1,36 | 0,72 | 0,28 | 0,58 | 0,61 | 0,56 | 0,71 | 0,74 | 0,48 | 0,44 |

Notes relatives au composite Obligations :

1. Description du composite

Ce composite a comme objectif d'offrir une valeur ajoutée au-dessus de l'indice de référence en investissant principalement dans des titres de dette canadiens.

Le 1^{er} juillet 2010, les activités de dette privée ont été transférées du composite Participations et infrastructures à ce composite. Jusqu'au 30 juin 2010, le composite regroupait uniquement les placements en obligations faits sur les marchés cotés.

Ce composite utilise des instruments financiers dérivés dans le cours normal de sa gestion. Ils sont principalement utilisés pour couvrir des positions, réduire les risques de marché et profiter d'occasions d'arbitrage.

Les activités de prêt et d'emprunt de titres ainsi que de vente à découvert sont permises dans le cadre de la gestion de ce composite selon les limites autorisées. La structure des titres de dette d'actifs titrisés non synthétiques adossés à des actifs tangibles ne doit comporter aucun levier.

Une portion non significative des actifs de ce composite est confiée à des gestionnaires externes.

2. Date de création du composite

Ce composite a été créé le 1^{er} septembre 1998.

3. Indice de référence

Depuis le 1^{er} juillet 2010, l'indice de référence est l'indice FTSE TMX Canada obligataire universel ajusté. Les composantes FTSE TMX Canada obligations provinciales et FTSE TMX Canada obligations municipales ont été remplacées par la composante FTSE TMX Canada obligations du Québec. Auparavant, l'indice de référence de ce composite était l'indice FTSE TMX Canada obligataire universel. Ce changement d'indice était justifié pour mieux refléter la surpondération des obligations du Québec dans le composite.

4. Période de calcul

Le rendement de ce composite est calculé du 1^{er} janvier 2007 au 31 décembre 2016.

5. Charges d'exploitation et autres frais

Les rendements sont calculés après les frais de transaction, mais avant les charges d'exploitation et autres frais. Les charges d'exploitation et autres frais en points centésimaux correspondent au ratio des frais réels encourus sur l'actif net moyen. Pour les quatre années précédentes, le ratio correspond à la moyenne des ratios annuels.

Les charges d'exploitation et autres frais pour ce composite représentent 10 p.c. pour les 12 derniers mois terminés le 31 décembre 2016. Pour les quatre années précédentes,



Caisse de dépôt et placement
du Québec

soit du 1^{er} janvier 2012 au 31 décembre 2015, les frais
représentaient en moyenne 10 p.c.

Dettes immobilières

Rendement et actif net sous gestion pour les années terminées le 31 décembre :

| | Rendement (%) | | | Risque (%) | | Actif net (k\$) | |
|------|---------------|--------|---------|----------------------|-------------------|-----------------|------------------------|
| | Composite | Indice | Écart | Écart-type rendement | Écart-type indice | Composite | Actif net sous gestion |
| 2016 | 2,64 | 1,66 | 0,98 | 4,13 | 4,04 | 11 553 457 \$ | 270 018 068 \$ |
| 2015 | 5,14 | 3,52 | 1,62 | 4,01 | 4,14 | 11 299 439 \$ | 247 494 947 \$ |
| 2014 | 11,91 | 8,79 | 3,12 | 3,31 | 3,10 | 10 440 656 \$ | 225 433 142 \$ |
| 2013 | 0,07 | (1,19) | 1,27 | 3,61 | 3,10 | 8 818 031 \$ | 199 690 933 \$ |
| 2012 | 5,14 | 3,60 | 1,54 | 3,89 | 3,03 | 7 574 217 \$ | 175 192 938 \$ |
| 2011 | 14,96 | 9,51 | 5,45 | 11,27 | 3,21 | 6 679 713 \$ | 158 706 574 \$ |
| 2010 | 17,09 | 7,13 | 9,95 | 11,11 | 4,40 | 8 607 291 \$ | 151 387 764 \$ |
| 2009 | (20,33) | 8,52 | (28,85) | 10,60 | 4,09 | 9 019 927 \$ | 131 103 348 \$ |
| 2008 | (7,64) | (3,04) | (4,60) | 4,41 | 4,05 | 11 331 733 \$ | 117 950 388 \$ |
| 2007 | 0,94 | 3,52 | (2,58) | 4,04 | 3,01 | 11 506 095 \$ | 155 140 783 \$ |

Rendement annualisé au 31 décembre (en pourcentage) :

| | 1 an | 2 ans | 3 ans | 4 ans | 5 ans | 6 ans | 7 ans | 8 ans | 9 ans | 10 ans |
|-------------|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|--------|
| Composite | 2,64 | 3,88 | 6,49 | 4,85 | 4,91 | 6,52 | 7,97 | 3,94 | 2,59 | 2,42 |
| 2016 Indice | 1,66 | 2,59 | 4,61 | 3,13 | 3,22 | 4,25 | 4,65 | 5,13 | 4,19 | 4,12 |
| Écart | 0,98 | 1,30 | 1,88 | 1,72 | 1,68 | 2,27 | 3,32 | (1,18) | (1,60) | (1,70) |

Notes relatives au composite Dettes immobilières :

1. Description du composite

Ce composite regroupe essentiellement des prêts et titres hypothécaires commerciaux gérés par la filiale Otéra Capital. Il comprend des prêts hypothécaires de premier rang ou de rang inférieur, des obligations hypothécaires et des prêts transitoires (majoritairement des prêts à la construction). Ce composite pourrait détenir des titres adossés à des créances hypothécaires commerciales au Canada (TACHC) souscrits à l'interne.

Ce composite inclut divers instruments financiers dérivés à des fins de gestion des risques de taux d'intérêt et de devises. Les produits dérivés de taux d'intérêt servent à ramener la durée, donc la sensibilité du portefeuille aux variations des taux, près de celle de l'indice. Ils peuvent également servir à garantir un taux à un emprunteur.

Aucun levier n'est autorisé dans ce composite, à l'exception de celui résultant (1) des activités telles que la titrisation et les reprises immobilières, dans lesquelles il existe déjà des prêts hypothécaires sur un immeuble repris, (2) de la consolidation des plateformes opérationnelles et (3) des sommes dues aux actionnaires. Toutefois, un levier peut être toléré seulement si cela résulte des effets de la gestion de la durée ou de la couverture de change.

2. Date de création du composite

Ce composite a été créé le 1^{er} septembre 1998.

3. Indice de référence

Depuis le 1^{er} janvier 2012, l'indice de référence de ce composite est l'indice FTSE TMX Canada obligataire universel.

Entre le 1^{er} janvier 2010 et le 31 décembre 2011, l'indice de référence de ce composite était composé à 90 % de l'indice FTSE TMX Canada obligataire universel et à 10 % de l'indice Giliberto-Levy couvert.

Du 1^{er} janvier 2007 au 31 décembre 2009, l'indice de référence était composé à 90 % de l'indice FTSE TMX Canada obligataire universel et à 10 % de l'indice Barclays CMBS B couvert.

Ces changements d'indices étaient justifiés afin de mieux refléter la composition du composite.

4. Période de calcul

Le rendement de ce composite est calculé du 1^{er} janvier 2007 au 31 décembre 2016.

5. Charges d'exploitation et autres frais

Les rendements sont calculés après les frais de transaction et les charges de la filiale non consolidée, mais avant les charges d'exploitation et autres frais. Les charges d'exploitation et autres frais en points centésimaux correspondent au ratio des frais réels encourus sur l'actif



net moyen. Pour les quatre années précédentes, le ratio correspond à la moyenne des ratios annuels.

Les charges d'exploitation et autres frais pour ce composite représentent 1 p.c. pour les 12 derniers mois terminés le 31 décembre 2016. Pour les quatre années précédentes, soit du 1^{er} janvier 2012 au 31 décembre 2015, les frais représentaient en moyenne 4 p.c.

6. Évaluation des placements

Tel que décrit dans les notes générales, la Caisse évalue sa participation dans sa filiale non consolidée, Otéra Capital, à la juste valeur à titre de placement. La juste valeur de la participation en actions dans la filiale est établie selon une technique d'évaluation d'entreprise. Cette valeur d'entreprise reflète la juste valeur des actifs détenus directement par cette filiale qui comprend principalement

les prêts hypothécaires commerciaux. Cette valeur est établie selon l'actif net des états financiers audités de la filiale. La juste valeur de la participation sous forme d'instruments d'emprunt dans cette filiale est établie selon une actualisation des flux de trésorerie futurs. Cette évaluation s'appuie principalement sur des données d'entrée observables telles que les taux d'intérêt et l'écart de crédit.

La juste valeur des prêts hypothécaires commerciaux est établie selon une actualisation des flux de trésorerie futurs qui sont divisés en catégories de risque, selon le ratio prêt-valeur, pour lesquelles un taux d'actualisation approprié au marché est déterminé. Les évaluations des prêts hypothécaires commerciaux sont revues semi-annuellement par une firme externe indépendante.

Valeurs à court terme

Rendement et actif net sous gestion pour les années terminées le 31 décembre :

| | Rendement (%) | | | Risque (%) | | Actif net (k\$) | |
|------|---------------|--------|-------|----------------------|-------------------|-----------------|------------------------|
| | Composite | Indice | Écart | Écart-type rendement | Écart-type indice | Composite | Actif net sous gestion |
| 2016 | 0,52 | 0,51 | 0,01 | 0,10 | 0,09 | 6 157 183 \$ | 270 018 068 \$ |
| 2015 | 0,73 | 0,63 | 0,10 | 0,09 | 0,09 | 4 584 461 \$ | 247 494 947 \$ |
| 2014 | 1,01 | 0,91 | 0,10 | 0,04 | 0,05 | 6 830 301 \$ | 225 433 142 \$ |
| 2013 | 1,07 | 1,01 | 0,06 | 0,05 | 0,06 | 3 511 628 \$ | 199 690 933 \$ |
| 2012 | 1,08 | 1,01 | 0,07 | 0,12 | 0,10 | 8 916 169 \$ | 175 192 938 \$ |
| 2011 | 1,06 | 1,00 | 0,06 | 0,14 | 0,11 | 6 762 222 \$ | 158 706 574 \$ |
| 2010 | 0,65 | 0,54 | 0,12 | 0,48 | 0,45 | 3 376 296 \$ | 151 387 764 \$ |
| 2009 | 1,07 | 0,62 | 0,45 | 0,51 | 0,53 | 2 714 918 \$ | 131 103 348 \$ |
| 2008 | 3,68 | 3,33 | 0,35 | 0,32 | 0,30 | 4 468 179 \$ | 117 950 388 \$ |
| 2007 | 4,56 | 4,43 | 0,12 | 0,28 | 0,26 | 2 365 475 \$ | 155 140 783 \$ |

Rendement annualisé au 31 décembre (en pourcentage) :

| | 1 an | 2 ans | 3 ans | 4 ans | 5 ans | 6 ans | 7 ans | 8 ans | 9 ans | 10 ans |
|-------------|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|
| Composite | 0,52 | 0,63 | 0,75 | 0,83 | 0,88 | 0,91 | 0,88 | 0,90 | 1,21 | 1,54 |
| 2016 Indice | 0,51 | 0,57 | 0,68 | 0,77 | 0,81 | 0,85 | 0,80 | 0,78 | 1,06 | 1,39 |
| Écart | 0,01 | 0,05 | 0,07 | 0,07 | 0,07 | 0,07 | 0,07 | 0,12 | 0,15 | 0,14 |

Notes relatives au composite Valeurs à court terme :

1. Description du composite

Ce composite a comme objectif de préserver le capital investi et de maintenir un degré de liquidité élevé tout en procurant un rendement courant comparable à celui des bons du Trésor canadiens 91 jours.

Ce composite utilise des instruments financiers dérivés dans le cours normal de sa gestion. Ils sont notamment utilisés pour la gestion du risque de taux d'intérêt ou de la durée de la dette.

2. Date de création du composite

Ce composite a été créé le 1^{er} septembre 1998.

3. Indice de référence

L'indice de référence de ce composite est le FTSE TMX Canada bons du Trésor 91 jours.

4. Période de calcul

Le rendement de ce composite est calculé du 1^{er} janvier 2007 au 31 décembre 2016.

5. Charges d'exploitation et autres frais

Les rendements sont calculés après les frais de transaction, mais avant les charges d'exploitation et autres frais. Les charges d'exploitation et autres frais en points centésimaux correspondent au ratio des frais réels encourus sur l'actif net moyen. Pour les quatre années précédentes, le ratio correspond à la moyenne des ratios annuels.

Les charges d'exploitation et autres frais pour ce composite représentent 1 p.c. pour les 12 derniers mois terminés le 31 décembre 2016. Pour les quatre années précédentes, soit du 1^{er} janvier 2012 au 31 décembre 2015, les frais représentaient en moyenne 2 p.c.

Obligations à long terme

Rendement et actif net sous gestion pour les années terminées le 31 décembre :

| | Rendement (%) | | | Risque (%) | | Actif net (k\$) | |
|------|---------------|--------|--------|----------------------|-------------------|-----------------|------------------------|
| | Composite | Indice | Écart | Écart-type rendement | Écart-type indice | Composite | Actif net sous gestion |
| 2016 | 2,07 | 2,12 | (0,06) | 8,38 | 8,40 | 2 639 527 \$ | 270 018 068 \$ |
| 2015 | 4,68 | 4,75 | (0,07) | 8,30 | 8,33 | 2 390 024 \$ | 247 494 947 \$ |
| 2014 | 18,20 | 18,40 | (0,20) | 6,13 | 6,16 | 2 208 145 \$ | 225 433 142 \$ |
| 2013 | (6,48) | (6,40) | (0,08) | 6,53 | 6,54 | 1 895 965 \$ | 199 690 933 \$ |
| 2012 | 3,43 | 3,70 | (0,26) | 5,87 | 5,85 | 3 678 975 \$ | 175 192 938 \$ |
| 2011 | 18,55 | 18,63 | (0,08) | 6,54 | 6,51 | 3 758 146 \$ | 158 706 574 \$ |
| 2010 | 12,30 | 12,32 | (0,02) | 7,34 | 7,51 | 3 597 657 \$ | 151 387 764 \$ |
| 2009 | 2,11 | 1,25 | 0,86 | 7,12 | 7,29 | 3 102 148 \$ | 131 103 348 \$ |
| 2008 | 4,64 | 6,16 | (1,51) | 7,13 | 7,33 | 3 039 517 \$ | 117 950 388 \$ |
| 2007 | 4,66 | 4,39 | 0,27 | s.o. | s.o. | 3 175 403 \$ | 155 140 783 \$ |

Rendement annualisé au 31 décembre (en pourcentage) :

| | 1 an | 2 ans | 3 ans | 4 ans | 5 ans | 6 ans | 7 ans | 8 ans | 9 ans | 10 ans |
|-------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|--------|--------|
| Composite | 2,07 | 3,37 | 8,09 | 4,25 | 4,08 | 6,37 | 7,20 | 6,55 | 6,33 | 6,16 |
| 2016 Indice | 2,12 | 3,43 | 8,20 | 4,35 | 4,22 | 6,49 | 7,30 | 6,53 | 6,49 | 6,28 |
| Écart | (0,06) | (0,06) | (0,10) | (0,10) | (0,13) | (0,12) | (0,11) | 0,02 | (0,15) | (0,11) |

Notes relatives au composite Obligations à long terme :

1. Description du composite

Ce composite regroupe essentiellement des instruments financiers du marché obligataire canadien à long terme. Depuis le 1^{er} janvier 2010, l'objectif de ce composite est de répliquer le rendement de son indice de référence.

2. Date de création du composite

Ce composite a été créé le 1^{er} avril 2005.

3. Indice de référence

Depuis le 1^{er} janvier 2012, l'indice de référence se nomme FTSE TMX Canada obligations gouvernementales à long terme ajusté et est composé à 10 % de l'indice FTSE TMX Canada obligations fédérales à long terme, à 40 % de l'indice FTSE TMX Canada obligations provinciales à long terme et à 50 % du FTSE TMX Canada obligations provinciales du Québec à long terme. Ce changement d'indice était justifié afin de mieux refléter la composition du composite.

Du 1^{er} janvier 2011 au 31 décembre 2011, l'indice de référence était le FTSE TMX Canada obligations gouvernementales à long terme ajusté et était composé à 25 % de l'indice FTSE TMX Canada obligations fédérales à long terme, à 25 % de l'indice FTSE TMX Canada obligations provinciales à long terme et à 50 % du FTSE TMX Canada obligations provinciales du Québec à long

terme. Ce changement d'indice était justifié afin de mieux refléter la composition du composite.

Du 1^{er} juillet 2010 au 31 décembre 2010, l'indice était le FTSE TMX Canada obligations gouvernementales à long terme ajusté, dont la portion Provinces était remplacée par les obligations du Québec. Ce changement d'indice était justifié afin de mieux refléter la surpondération des obligations du Québec dans le composite.

Du 1^{er} janvier 2007 au 30 juin 2010, l'indice de référence de ce composite était l'indice FTSE TMX Canada obligations gouvernementales à long terme.

4. Période de calcul

Le rendement de ce composite est calculé du 1^{er} janvier 2007 au 31 décembre 2016.

5. Charges d'exploitation et autres frais

Les rendements sont calculés après les frais de transaction, mais avant les charges d'exploitation et autres frais. Les charges d'exploitation et autres frais en points centésimaux correspondent au ratio des frais réels encourus sur l'actif net moyen. Pour les quatre années précédentes, le ratio correspond à la moyenne des ratios annuels.

Les charges d'exploitation et autres frais pour ce composite représentent 4 p.c. pour les 12 derniers mois terminés le



**Caisse de dépôt et placement
du Québec**

31 décembre 2016. Pour les quatre années précédentes, soit du 1^{er} janvier 2012 au 31 décembre 2015, les frais représentaient en moyenne 6 p.c.

Immeubles

Rendement et actif net sous gestion pour les années terminées le 31 décembre :

| | Rendement (%) | | | Risque (%) | | Actif net (k\$) | |
|------|---------------|---------|---------|----------------------|-------------------|-----------------|------------------------|
| | Composite | Indice | Écart | Écart-type rendement | Écart-type indice | Composite | Actif net sous gestion |
| 2016 | 10,35 | 7,25 | 3,10 | s.o. | s.o. | 31 721 120 \$ | 270 018 068 \$ |
| 2015 | 13,05 | 15,40 | (2,35) | s.o. | s.o. | 26 955 199 \$ | 247 494 947 \$ |
| 2014 | 9,93 | 11,09 | (1,16) | s.o. | s.o. | 22 878 122 \$ | 225 433 142 \$ |
| 2013 | 15,06 | 15,56 | (0,49) | s.o. | s.o. | 22 570 193 \$ | 199 690 933 \$ |
| 2012 | 12,43 | 13,18 | (0,75) | s.o. | s.o. | 17 973 935 \$ | 175 192 938 \$ |
| 2011 | 10,96 | 15,63 | (4,66) | s.o. | s.o. | 18 204 805 \$ | 158 706 574 \$ |
| 2010 | 13,42 | 11,58 | 1,84 | s.o. | s.o. | 16 770 823 \$ | 151 387 764 \$ |
| 2009 | (12,65) | (15,31) | 2,66 | s.o. | s.o. | 14 311 038 \$ | 131 103 348 \$ |
| 2008 | (21,92) | (3,41) | (18,51) | s.o. | s.o. | 14 111 088 \$ | 117 950 388 \$ |
| 2007 | 20,29 | 24,37 | (4,09) | s.o. | s.o. | 17 584 287 \$ | 155 140 783 \$ |

Rendement annualisé au 31 décembre (en pourcentage) :

| | 1 an | 2 ans | 3 ans | 4 ans | 5 ans | 6 ans | 7 ans | 8 ans | 9 ans | 10 ans |
|-------------|-------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Composite | 10,35 | 11,69 | 11,10 | 12,08 | 12,15 | 11,95 | 12,16 | 8,71 | 4,78 | 6,24 |
| 2016 Indice | 7,25 | 11,25 | 11,20 | 12,27 | 12,45 | 12,98 | 12,77 | 8,81 | 7,38 | 8,97 |
| Écart | 3,10 | 0,44 | (0,09) | (0,19) | (0,30) | (1,02) | (0,61) | (0,10) | (2,59) | (2,73) |

Autres rendements présentés au 31 décembre (en pourcentage) :

| | Rendement courant | Appréciation (dépréciation) du capital | Rendement total |
|------|-------------------|--|-----------------|
| 2016 | 2,21 | 7,98 | 10,35 |
| 2015 | 2,23 | 10,59 | 13,05 |
| 2014 | 2,33 | 7,42 | 9,93 |
| 2013 | 3,33 | 11,36 | 15,06 |
| 2012 | 3,50 | 8,63 | 12,43 |
| 2011 | 4,17 | 6,57 | 10,96 |
| 2010 | 4,61 | 8,42 | 13,42 |
| 2009 | 4,41 | (16,34) | (12,65) |
| 2008 | 3,71 | (24,71) | (21,92) |
| 2007 | 3,99 | 15,67 | 20,29 |

Notes relatives au composite Immeubles :

1. Description du composite

Ce composite regroupe les participations détenues dans la filiale immobilière Ivanhoé Cambridge. Plus de 80 % des actifs bruts du composite sont constitués de placements en détention directe. Les autres investissements détenus par la filiale sont sous forme de fonds d'investissement, de prêts hypothécaires, d'actions et de valeurs convertibles, principalement reliés à des actifs immobiliers.

Ce composite, par l'intermédiaire de la filiale immobilière, peut inclure des instruments financiers dérivés dans le

cours normal de sa gestion. Ils sont notamment utilisés pour la couverture du risque des devises, la gestion du risque de taux d'intérêt ainsi que la gestion de la durée de la dette.

Pour les placements en détention directe de la filiale immobilière, le levier maximal est de 55 %. Aucun levier n'est autorisé pour les placements qui ne sont pas détenus en mode de détention directe. Les activités de prêts et d'emprunts de titres ainsi que de ventes à découvert sont permises dans le cadre de la gestion de ce composite selon les limites autorisées.



2. Date de création du composite

Ce composite a été créé le 1^{er} septembre 1998.

3. Indice de référence

Depuis le 1^{er} janvier 2016, l'indice Immeubles est composé à 85 % de l'indice IPD Global Property ajusté (couvert) et à 15 % de l'indice IPD Global Property Fund (couvert), moins un coût de levier, un coût de gestion et des charges fiscales. Le coût du levier est composé à 50 % du coût réel du financement interne couvert, à 25 % du taux hypothécaire américain Giliberto-Levy 4-6 ans couvert, et à 25 % du taux obligataire Canada 5 ans majoré par un écart de crédit hypothécaire canadien. Les changements apportés à l'indice étaient justifiés afin de mieux refléter les opportunités d'investissement et la diversification géographique globale du composite.

Du 1^{er} janvier 2010 au 31 décembre 2015, l'indice se nommait Aon Hewitt – Immobilier ajusté et était composé à 40 % de l'indice IPD Canada, à 30 % de l'indice NCREIF couvert, à 15 % de l'indice IPD UK couvert, à 15 % de l'indice IPD France couvert, moins un coût de levier, un coût de gestion et des charges fiscales. Depuis le 1^{er} juillet 2012, une composante FTSE TMX Canada bons du Trésor 30 jours a aussi été ajoutée au calcul de l'indice. Cette composante a un poids de 3 % dans l'indice de référence. Le coût du levier était composé à 50 % du coût réel du financement interne couvert, à 25 % du taux obligataire US 3 ans couvert, majoré d'un écart de crédit Giliberto-Levy 2-3 ans, et à 25 % du taux obligataire Canada 3 ans majoré par un écart de crédit hypothécaire canadien.

Jusqu'au 31 décembre 2009, l'indice se nommait Aon – Immobilier et était composé à 70 % de l'indice IPD Canada et à 30 % de l'indice NCREIF couvert, moins une proportion de l'indice FTSE TMX Canada obligataire à court terme de sociétés pour refléter le levier.

Les changements apportés à l'indice étaient justifiés afin de mieux refléter la composition du composite.

4. Période de calcul

Le rendement de ce composite est calculé du 1^{er} janvier 2007 au 31 décembre 2016.

5. Charges d'exploitation et autres frais

Les rendements sont calculés après les frais de transaction et les charges de la filiale non consolidée, mais avant les charges d'exploitation et autres frais. Les charges d'exploitation et autres frais en points centésimaux correspondent au ratio des frais réels encourus sur l'actif net moyen. Pour les quatre années précédentes, le ratio correspond à la moyenne des ratios annuels.

Les charges d'exploitation et autres frais pour ce composite représentent 3 p.c. pour les 12 derniers mois terminés le 31 décembre 2016. Pour les quatre années précédentes,

soit du 1^{er} janvier 2012 au 31 décembre 2015, les frais représentaient en moyenne 5 p.c.

6. Évaluation des placements

Tel que décrit aux notes générales, le composite Immeubles a adopté les IFRS par anticipation le 1^{er} janvier 2012. La Caisse évalue sa participation dans sa filiale immobilière non consolidée, Ivanhoé Cambridge, à la juste valeur à titre de placement. La juste valeur de la participation en actions dans la filiale immobilière est établie selon une technique d'évaluation d'entreprise, la méthode de multiples de sociétés comparables, soit une méthode couramment utilisée. Cette méthode s'appuie sur des données d'entrée observables et non observables, telles que le multiple du cours-valeur aux livres. Cette valeur d'entreprise reflète, entre autres, la juste valeur des actifs et des passifs détenus directement par la filiale, qui incluent principalement les immeubles de placement, ainsi que la juste valeur découlant de la qualité du portefeuille et de la gestion intégrée de la plateforme de la filiale. L'évaluation est établie annuellement par une firme externe indépendante.

La juste valeur des immeubles de placement détenus directement par la filiale est établie et certifiée par des évaluateurs immobiliers agréés externes, reconnus et indépendants. Comme les facteurs fondamentaux affectant la juste valeur ne changent pas de façon significative sur une courte période, ces immeubles sont évalués semestriellement depuis juin 2007 et annuellement pour les périodes antérieures à cette date. Les évaluations sont réalisées en conformité avec les normes d'évaluation en vigueur dans chaque marché. Pour établir la valeur au 30 juin, l'évaluateur effectue une mise à jour des taux d'actualisation et de capitalisation et certifie la nouvelle valeur. Une réévaluation complète est effectuée au 31 décembre de chaque année.

À chaque date d'évaluation, les investissements détenus dans des fonds externes d'investissement, les actions non cotées et les financements hypothécaires sont évalués à l'interne par la filiale immobilière et représentent environ 9 % des actifs du composite. Dans le cas des fonds d'investissement, représentant plus de 8 % des actifs du composite, l'évaluation est subséquemment comparée à la juste valeur fournie par le commandité ou l'administrateur.

Sur une base trimestrielle, lors des dispositions des immeubles, les gains ou les pertes sur dispositions sont constatés. De plus, il peut arriver qu'une situation, telle qu'une demande de financement ou un établissement de valeur fiscale, permette d'obtenir une nouvelle évaluation entre les deux semestres. Si cette évaluation affiche une variation significative par rapport à la juste valeur, celle-ci sera comptabilisée durant le trimestre.

7. Autres rendements présentés

Pour ce composite, en plus du rendement total, les rendements annuels de l'appréciation ou de la dépréciation du capital et le rendement courant d'exploitation de la filiale



non consolidée sont présentés. Le rendement courant provenant des activités de la filiale immobilière est réinvesti dans cette dernière. Le rendement courant inclut les revenus de location, le rendement de la trésorerie et les équivalents de trésorerie, déduit des frais d'exploitation des immeubles et des frais de financement. Depuis le 1^{er} janvier 2011, ces rendements sont calculés séparément

en liant géométriquement les rendements calculés selon la formule Dietz modifiée. Avant le 1^{er} janvier 2011, ces rendements étaient calculés de sorte que la somme géométrique des deux composantes était égale au rendement total du composite.

Infrastructures

Rendement et actif net sous gestion pour les années terminées le 31 décembre :

| | Rendement (%) | | | Risque (%) | | Actif net (k\$) | |
|-------|---------------|--------|---------|----------------------|-------------------|-----------------|------------------------|
| | Composite | Indice | Écart | Écart-type rendement | Écart-type indice | Composite | Actif net sous gestion |
| 2016 | 11,08 | 10,79 | 0,29 | s.o. | s.o. | 14 639 781 \$ | 270 018 068 \$ |
| 2015 | 6,59 | (5,09) | 11,68 | s.o. | s.o. | 12 957 468 \$ | 247 494 947 \$ |
| 2014 | 13,23 | 21,49 | (8,27) | s.o. | s.o. | 10 132 887 \$ | 225 433 142 \$ |
| 2013 | 10,62 | 22,63 | (12,01) | s.o. | s.o. | 8 048 236 \$ | 199 690 933 \$ |
| 2012 | 8,74 | 15,00 | (6,26) | s.o. | s.o. | 6 306 972 \$ | 175 192 938 \$ |
| 2011 | 23,28 | 12,70 | 10,59 | s.o. | s.o. | 5 751 198 \$ | 158 706 574 \$ |
| 2010* | 13,94 | 17,12 | (3,18) | s.o. | s.o. | 4 332 759 \$ | 151 387 764 \$ |

*Du 1^{er} juillet 2010 au 31 décembre 2010

Rendement annualisé au 31 décembre (en pourcentage) :

| | 1 an | 2 ans | 3 ans | 4 ans | 5 ans | 6 ans | 7 ans | 8 ans | 9 ans | 10 ans |
|-------------|-------|-------|-------|--------|--------|--------|-------|-------|-------|--------|
| Composite | 11,08 | 8,82 | 10,27 | 10,35 | 10,03 | 12,14 | s.o. | | | |
| 2016 Indice | 10,79 | 2,55 | 8,51 | 11,88 | 12,50 | 12,53 | s.o. | | | |
| Écart | 0,29 | 6,27 | 1,76 | (1,52) | (2,46) | (0,39) | s.o. | | | |

Notes relatives au composite Infrastructures :

1. Description du composite

Ce composite regroupe principalement les activités de gestion dans des placements négociés pour des souscriptions de l'avoir propre en appui au maintien ou au développement d'entreprises dans les secteurs en infrastructures. Il s'agit d'investissements sous forme de titres de participation dans des sociétés privées ou cotées en Bourse et exploitant des actifs de type services aux collectivités. Ces investissements peuvent être effectués dans des projets de développement ou stabilisés.

Ce composite utilise des instruments financiers dérivés dans le cours normal de sa gestion. Ils ne doivent être utilisés que pour la couverture du risque de taux d'intérêt et de devises ou aux fins d'une couverture d'une position détenue en portefeuille.

Une portion de ce composite est investie sous forme de fonds d'investissement.

À chaque date d'évaluation, la juste valeur des fonds d'investissement est fournie par le commandité. Cette évaluation est subséquemment comparée aux états financiers audités fournis par le commandité. Cette portion représente 1 % des actifs de ce composite.

2. Date de création du composite

Ce composite a été créé le 1^{er} juillet 2010.

3. Indice de référence

Depuis le 1^{er} avril 2015, l'indice de référence « Infrastructures » correspond à l'indice MSCI ACWI Infrastructures ajusté couvert, à l'exception des titres de pays émergents qui restent non couverts. Ce changement d'indice était justifié afin de mieux refléter l'univers des opportunités d'investissement dans les infrastructures publiques.

Du 1^{er} janvier 2013 au 31 mars 2015, l'indice de référence « Infrastructures » était formé de la façon suivante : un panier de titres publics liés à l'infrastructure, couverts, à l'exception des titres de pays émergents qui étaient non couverts.

Du 1^{er} juillet 2010 au 31 décembre 2012, l'indice de référence était un composite formé d'un panier de titres publics liés à l'infrastructure, couverts, provenant de Standard & Poor's.

Sur de courtes périodes, il est possible d'observer des écarts significatifs entre le rendement du composite et celui de son indice. L'indice est composé de titres publics, alors que le composite est essentiellement composé de titres privés, d'où un écart lié aux fluctuations du marché.

4. Période de calcul

Le rendement de ce composite est calculé du 1^{er} juillet 2010 au 31 décembre 2016.



5. Charges d'exploitation et autres frais

Les rendements sont calculés après les frais de transaction et les frais des fonds d'investissement, mais avant les charges d'exploitation et autres frais. Les charges d'exploitation et autres frais en points centésimaux correspondent au ratio des frais réels encourus sur l'actif net moyen. Pour les quatre années précédentes, le ratio correspond à la moyenne des ratios annuels.

Les charges d'exploitation et autres frais pour ce composite représentent 46 p.c. pour les 12 derniers mois terminés le 31 décembre 2016. Pour les quatre années précédentes, soit du 1^{er} janvier 2012 au 31 décembre 2015, les frais représentaient en moyenne 39 p.c.

Obligations à rendement réel

Rendement et actif net sous gestion pour les années terminées le 31 décembre :

| | Rendement (%) | | | Risque (%) | | Actif net (k\$) | |
|------|---------------|---------|--------|----------------------|-------------------|-----------------|------------------------|
| | Composite | Indice | Écart | Écart-type rendement | Écart-type indice | Composite | Actif net sous gestion |
| 2016 | 2,83 | 2,86 | (0,02) | 7,88 | 7,88 | 1 087 059 \$ | 270 018 068 \$ |
| 2015 | 2,84 | 2,79 | 0,05 | 9,68 | 9,69 | 1 089 696 \$ | 247 494 947 \$ |
| 2014 | 13,20 | 13,18 | 0,01 | 8,02 | 8,02 | 980 477 \$ | 225 433 142 \$ |
| 2013 | (13,08) | (13,07) | 0,00 | 8,70 | 8,70 | 1 188 230 \$ | 199 690 933 \$ |
| 2012 | 2,72 | 2,85 | (0,13) | 6,43 | 6,42 | 1 227 452 \$ | 175 192 938 \$ |
| 2011 | 18,37 | 18,35 | 0,02 | 8,51 | 8,19 | 1 288 122 \$ | 158 706 574 \$ |
| 2010 | 11,12 | 11,09 | 0,03 | 11,75 | 11,39 | 939 609 \$ | 151 387 764 \$ |
| 2009 | 17,09 | 14,50 | 2,59 | 11,87 | 11,47 | 652 763 \$ | 131 103 348 \$ |
| 2008 | (2,18) | 0,42 | (2,60) | 10,10 | 10,02 | 557 727 \$ | 117 950 388 \$ |
| 2007 | 1,52 | 1,59 | (0,08) | 5,64 | 5,56 | 861 805 \$ | 155 140 783 \$ |

Rendement annualisé au 31 décembre (en pourcentage) :

| | 1 an | 2 ans | 3 ans | 4 ans | 5 ans | 6 ans | 7 ans | 8 ans | 9 ans | 10 ans |
|-------------|--------|-------|-------|-------|--------|--------|--------|-------|--------|--------|
| Composite | 2,83 | 2,84 | 6,18 | 1,00 | 1,34 | 4,00 | 4,99 | 6,43 | 5,44 | 5,04 |
| 2016 Indice | 2,86 | 2,83 | 6,17 | 0,99 | 1,36 | 4,01 | 5,00 | 6,14 | 5,49 | 5,09 |
| Écart | (0,02) | 0,01 | 0,01 | 0,01 | (0,02) | (0,01) | (0,01) | 0,29 | (0,05) | (0,05) |

Notes relatives au composite Obligations à rendement réel :

1. Description du composite

Ce composite regroupe les obligations canadiennes à rendement réel de la Caisse. Les obligations à rendement réel sont des obligations dont la valeur nominale est directement liée à l'indice des prix à la consommation. Depuis le 1^{er} janvier 2010, l'objectif de ce composite est de répliquer le rendement de son indice de référence.

2. Date de création du composite

Ce composite a été créé le 1^{er} octobre 2004.

3. Indice de référence

L'indice de référence de ce composite est l'indice FTSE TMX Canada obligations à rendement réel.

4. Période de calcul

Le rendement de ce composite est calculé du 1^{er} janvier 2007 au 31 décembre 2016.

5. Charges d'exploitation et autres frais

Les rendements sont calculés après les frais de transaction, mais avant les charges d'exploitation et autres frais. Les charges d'exploitation et autres frais en points centésimaux correspondent au ratio des frais réels encourus sur l'actif net moyen. Pour les quatre années précédentes, le ratio correspond à la moyenne des ratios annuels.

Les charges d'exploitation et autres frais pour ce composite représentent 7 p.c. pour les 12 derniers mois terminés le 31 décembre 2016. Pour les quatre années précédentes, soit du 1^{er} janvier 2012 au 31 décembre 2015, les frais représentaient en moyenne 10 p.c.

Marchés boursiers

Rendement et actif net sous gestion pour l'année terminée le 31 décembre :

| | Rendement (%) | | | Risque (%) | | Actif net (k\$) | |
|------|---------------|--------|-------|----------------------|-------------------|-----------------|------------------------|
| | Composite | Indice | Écart | Écart-type rendement | Écart-type indice | Composite | Actif net sous gestion |
| 2016 | 9,40 | 7,51 | 1,89 | s.o. | s.o. | 101 271 741 \$ | 270 018 068 \$ |

Rendement annualisé au 31 décembre (en pourcentage) :

| | 1 an | 2 ans | 3 ans | 4 ans | 5 ans | 6 ans | 7 ans | 8 ans | 9 ans | 10 ans |
|-------------|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|
| Composite | 9,40 | | | | | | | | | |
| 2016 Indice | 7,51 | | | | | | | | | |
| Écart | 1,89 | | | | | | | | | |

Notes relatives au composite Marchés boursiers :

1. Description du composite

Dans le cadre d'une révision globale des portefeuilles spécialisés offerts aux déposants, les composites Actions Qualité mondiale, Actions canadiennes, Actions des marchés en émergence, Actions américaines et Actions EAEO ont été fusionnés et leurs actifs et passifs ont été transférés afin de créer le composite Marchés boursiers en date du 1^{er} janvier 2016. Aucun gain ou perte n'a été réalisé à la suite du regroupement des composites.

Le composite Marchés boursiers vise à procurer un rendement ajusté pour le risque supérieur à celui obtenu dans des investissements traditionnels en actions. Pour atteindre cet objectif, le composite adopte une approche d'investissement en absolu qui n'est pas basée sur la composition des indices mais plutôt sur des critères de qualité spécifiques aux entreprises. Ce composite est subdivisé en six grands mandats : Qualité mondiale, Canada, Pondérations alternatives, Marchés en croissance, Relationnel, Stratégique. Pour chacun de ces mandats, un processus d'investissement rigoureux, régi par un comité d'investissement spécifique interne, encadre la sélection des titres et la construction du portefeuille.

Une portion des actifs de ce composite est confiée à des gestionnaires externes.

Ce composite peut comporter un levier au comptant de 5 % dans le cours normal des activités d'investissement.

Ce composite n'est pas couvert contre les fluctuations des devises. Toutefois, une couverture peut être mise en place et les stratégies de couverture doivent être approuvées.

Les instruments financiers dérivés sur taux d'intérêt et de devises ne doivent être utilisés que pour la couverture du risque de taux d'intérêt et de devises, sauf approbation exceptionnelle.

Les activités de prêt et d'emprunt de titres ainsi que de vente à découvert sont permises dans le cadre de la gestion de ce composite selon les limites autorisées.

2. Date de création du composite

Ce composite a été créé le 1^{er} janvier 2016.

3. Indice de référence

L'indice de référence « Marchés boursiers » est composé à 90 % Marchés boursiers traditionnel et à 10 % de l'indice FTSE TMX Canada bons du Trésor 91 jours, pour laquelle la composante Marchés boursiers traditionnel est composée à 60 % de l'indice MSCI World (ex Canada) non couvert, à 25 % de l'indice S&P/TSX et à 15 % de l'indice MSCI EM non couvert.

4. Période de calcul

Le rendement de ce composite est calculé du 1^{er} janvier 2016 au 31 décembre 2016.

5. Charges d'exploitation et autres frais

Les rendements sont calculés après les frais de transaction et les frais des fonds d'investissement, mais avant les charges d'exploitation et autres frais. Les charges d'exploitation et autres frais en points centésimaux correspondent au ratio des frais réels encourus sur l'actif net moyen.

Les charges d'exploitation et autres frais pour ce composite représentent 16 p.c. depuis sa création (1^{er} janvier 2016).

Placements privés

Rendement et actif net sous gestion pour les années terminées le 31 décembre :

| | Rendement (%) | | | Risque (%) | | Actif net (k\$) | |
|------|---------------|---------|---------|----------------------|-------------------|-----------------|------------------------|
| | Composite | Indice | Écart | Écart-type rendement | Écart-type indice | Composite | Actif net sous gestion |
| 2016 | 14,01 | 8,76 | 5,26 | s.o. | s.o. | 30 387 019 \$ | 270 018 068 \$ |
| 2015 | 8,39 | 4,07 | 4,32 | s.o. | s.o. | 26 099 185 \$ | 247 494 947 \$ |
| 2014 | 12,15 | 12,54 | (0,40) | s.o. | s.o. | 22 396 335 \$ | 225 433 142 \$ |
| 2013 | 19,69 | 22,72 | (3,03) | s.o. | s.o. | 20 181 956 \$ | 199 690 933 \$ |
| 2012 | 13,60 | 14,10 | (0,50) | s.o. | s.o. | 17 795 997 \$ | 175 192 938 \$ |
| 2011 | 7,05 | 7,36 | (0,30) | s.o. | s.o. | 15 745 769 \$ | 158 706 574 \$ |
| 2010 | 26,73 | 1,99 | 24,74 | s.o. | s.o. | 17 467 606 \$ | 151 387 764 \$ |
| 2009 | 10,79 | 23,98 | (13,18) | s.o. | s.o. | 11 255 624 \$ | 131 103 348 \$ |
| 2008 | (31,35) | (40,07) | 8,72 | s.o. | s.o. | 9 733 977 \$ | 117 950 388 \$ |
| 2007 | 16,18 | 3,79 | 12,40 | s.o. | s.o. | 11 344 412 \$ | 155 140 783 \$ |

Rendement annualisé au 31 décembre (en pourcentage) :

| | 1 an | 2 ans | 3 ans | 4 ans | 5 ans | 6 ans | 7 ans | 8 ans | 9 ans | 10 ans |
|-------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|
| Composite | 14,01 | 11,17 | 11,49 | 13,49 | 13,51 | 12,41 | 14,35 | 13,90 | 7,67 | 8,49 |
| 2016 Indice | 8,76 | 6,39 | 8,40 | 11,82 | 12,27 | 11,44 | 10,03 | 11,69 | 4,22 | 4,18 |
| Écart | 5,26 | 4,78 | 3,09 | 1,67 | 1,24 | 0,97 | 4,32 | 2,21 | 3,45 | 4,31 |

Notes relatives au composite Placements privés :

1. Description du composite

Ce composite regroupe les activités de gestion des placements privés spécialisées dans les métiers d'investissement d'acquisitions par emprunt (*buyout*), de capital de développement, de capital de risque, de dette en détresse, de dette mezzanine et de restructuration.

Certains actifs en provenance du composite Participations et infrastructures ont été transférés dans le composite en date du 1^{er} juillet 2010 en raison de la réorganisation de l'offre du composite et de la fermeture du composite Participations et infrastructures.

Ce composite utilise des instruments financiers dérivés dans le cours normal de sa gestion. Ils sont utilisés pour la couverture du risque de taux d'intérêt et de devises, ou aux fins d'une couverture d'une position détenue en portefeuille.

À chaque date d'évaluation, la juste valeur des fonds d'investissement est fournie par le commandité. Cette évaluation est subséquemment comparée aux états financiers audités fournis par le commandité. Cette portion représente 36 % des actifs de ce composite.

2. Date de création du composite

Ce composite a été créé le 1^{er} octobre 2003.

3. Indice de référence

Depuis le 1^{er} janvier 2016, l'indice de référence est composé à 50 % de l'indice State Street Private Equity ajusté partiellement couvert et à 50 % de l'indice MSCI World partiellement couvert. Ce changement était justifié afin de mieux refléter la politique de couverture du composite.

Du 1^{er} janvier 2013 au 31 décembre 2015, l'indice de référence était composé à 50 % de l'indice State Street Private Equity ajusté couvert et à 50 % de l'indice MSCI World Index couvert. Ce changement d'indice était justifié afin de mieux refléter la composition du composite.

Du 1^{er} juillet 2010 au 31 décembre 2012, l'indice de référence était composé à 70 % de l'indice State Street Private Equity ajusté couvert et à 30 % de l'indice MSCI World couvert. Ce changement d'indice était justifié par l'évolution du composite à la suite des transferts du 1^{er} juillet 2010.

Du 1^{er} janvier 2007 au 30 juin 2010, l'indice de référence était composé à 60 % du S&P 500 couvert et à 40 % du MSCI EAFE couvert. Ce changement d'indice était justifié par l'évolution sur le plan géographique et sectoriel de la politique de placement du composite et par sa liquidité plus élevée.



4. Période de calcul

Le rendement de ce composite est calculé du 1^{er} janvier 2007 au 31 décembre 2016.

5. Charges d'exploitation et autres frais

Les rendements sont calculés après les frais de transaction et les frais des fonds d'investissement, mais avant les charges d'exploitation et autres frais. Les charges d'exploitation et autres frais en points centésimaux

correspondent au ratio des frais réels encourus sur l'actif net moyen. Pour les quatre années précédentes, le ratio correspond à la moyenne des ratios annuels.

Les charges d'exploitation et autres frais pour ce composite représentent 55 p.c. pour les 12 derniers mois terminés le 31 décembre 2016. Pour les quatre années précédentes, soit du 1^{er} janvier 2012 au 31 décembre 2015, les frais représentaient en moyenne 26 p.c.

Fonds équilibré

Rendement et actif net sous gestion pour les années terminées le 31 décembre :

| | Rendement (%) | | | Risque (%) | | | Actif net (k\$) | |
|------|---------------|---------|--------|--------------|--------------------|----------------------|-------------------|----------------|
| | Composite | Indice | Écart | Nbre comptes | Écart-type comptes | Écart-type rendement | Écart-type indice | Composite |
| 2016 | 7,57 | 5,76 | 1,81 | 56 | 2,18 | 4,19 | 4,76 | 270 018 068 \$ |
| 2015 | 9,10 | 6,70 | 2,40 | 49 | 2,21 | 3,71 | 4,32 | 247 494 947 \$ |
| 2014 | 12,02 | 11,41 | 0,61 | 47 | 2,73 | 2,97 | 3,01 | 225 433 142 \$ |
| 2013 | 13,06 | 12,56 | 0,50 | 41 | 3,70 | 3,56 | 3,44 | 199 690 933 \$ |
| 2012 | 9,55 | 9,30 | 0,25 | 39 | 3,25 | 4,34 | 4,49 | 175 192 938 \$ |
| 2011 | 3,97 | 4,23 | (0,26) | 36 | 2,48 | 5,03 | 6,58 | 158 706 574 \$ |
| 2010 | 13,62 | 9,48 | 4,15 | 36 | 4,06 | 9,98 | 10,10 | 151 387 764 \$ |
| 2009 | 10,04 | 14,10 | (4,05) | 34 | 4,84 | 9,44 | 9,57 | 131 103 348 \$ |
| 2008 | (25,05) | (18,47) | (6,58) | 32 | 7,99 | 9,37 | 8,37 | 117 950 388 \$ |
| 2007 | 5,63 | 6,20 | (0,57) | 29 | 2,86 | 4,12 | 4,17 | 155 140 783 \$ |

Rendement annualisé au 31 décembre (en pourcentage) :

| | 1 an | 2 ans | 3 ans | 4 ans | 5 ans | 6 ans | 7 ans | 8 ans | 9 ans | 10 ans |
|-------------|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|
| Composite | 7,57 | 8,33 | 9,55 | 10,41 | 10,24 | 9,17 | 9,80 | 9,83 | 5,26 | 5,30 |
| 2016 Indice | 5,76 | 6,23 | 7,93 | 9,07 | 9,11 | 8,28 | 8,45 | 9,14 | 5,66 | 5,72 |
| Écart | 1,81 | 2,10 | 1,62 | 1,35 | 1,13 | 0,89 | 1,34 | 0,68 | (0,40) | (0,42) |

Composition de l'indice de référence Fonds équilibré au 31 décembre 2016 :

| Indice de référence ¹ | Poids |
|--|-------|
| FTSE TMX Canada obligataire universel ajusté | 26 % |
| FTSE TMX Canada obligataire universel | 4 % |
| FTSE TMX Canada bons du Trésor 91 jours | 1 % |
| FTSE TMX Canada obligations gouvernementales à long terme ajusté | 1 % |
| Indice Immeubles | 12 % |
| Indice Infrastructures | 6 % |
| FTSE TMX Canada obligations à rendement réel | 0 % |
| Indice Marchés boursiers | 37 % |
| Indice Placements privés | 12 % |

1. La description des indices est présentée dans les notes de chacun des composites.

Notes relatives au composite Fonds équilibré :

1. Description du composite

Ce composite regroupe l'ensemble des comptes des déposants, incluant le Fonds général, et mesure l'impact global de la répartition de l'actif effectuée par la Caisse pour l'ensemble des catégories d'actifs offertes aux déposants. Des activités de trésorerie, de superposition et de calibrage des mandats de Marchés boursiers sont aussi incluses dans ce composite. Depuis 2007, une perte non

réalisée sur des placements en BTAA est incluse dans ce composite.

Ce composite peut inclure des instruments financiers dérivés dans le cours normal de sa gestion. Ils sont utilisés principalement pour couvrir des positions, réduire les risques de marché, profiter d'occasions d'arbitrage, répliquer l'indice de référence, accélérer un investissement ou un désinvestissement, couvrir les risques de taux de



change et de taux d'intérêt et apparier la durée du composite à celle de l'indice.

Des activités à levier peuvent être présentes dans le composite, incluant les ventes à découvert. Le niveau de levier dépend de la nature de l'investissement. Certaines stratégies ne contiennent pas de levier et d'autres sont 100 % à levier selon les limites autorisées.

Une portion des actifs de ce composite est confiée à des gestionnaires externes.

En 2014, à la suite de l'adoption des IFRS, une modification a été apportée à la méthodologie d'évaluation des composites Dettes immobilières, Infrastructures et Placements privés. Veuillez vous référer à la note 3 des Notes générales pour de plus amples détails. L'adoption des IFRS pour ces composites n'a eu aucune incidence sur le rendement du composite Fonds équilibré.

En 2012, à la suite de l'adoption anticipée des IFRS pour le composite Immeubles, une modification a été apportée à la méthodologie d'évaluation de la composante Immeubles du Fonds équilibré. Se référer au composite Immeubles du présent document pour de plus amples détails.

2. Date de création du composite

Ce composite a été créé le 1^{er} octobre 2002.

3. Indice de référence

L'indice de référence de ce composite est un indice construit par la Caisse. Il est composé de la moyenne pondérée des indices de référence des déposants. Ces

indices correspondent à la moyenne pondérée des indices des catégories d'actif présentes dans la politique de référence de chaque déposant. La politique de référence des déposants est établie une fois par mois selon les besoins et les préférences des déposants ainsi que les prévisions de marché. L'indice de référence comprend aussi un niveau d'exposition aux devises et un ajustement à la durée déterminée par la politique de référence de chaque déposant. Les poids de chacun des indices qui composent l'indice de référence de ce composite, en date du 1^{er} décembre 2016, sont indiqués dans le tableau de la page précédente.

4. Période de calcul

Le rendement de ce composite est calculé du 1^{er} janvier 2007 au 31 décembre 2016.

5. Charges d'exploitation et autres frais

Les rendements sont calculés après les frais de transaction, les frais des fonds d'investissement et les charges des filiales immobilières, mais avant les charges d'exploitation et autres frais. Les charges d'exploitation et autres frais en points centésimaux correspondent au ratio des frais réels encourus sur l'actif net moyen. Pour les quatre années précédentes, le ratio correspond à la moyenne des ratios annuels.

Les charges d'exploitation et autres frais pour ce composite représentent 20 p.c. pour les 12 derniers mois terminés le 31 décembre 2016. Pour les quatre années précédentes, soit du 1^{er} janvier 2012 au 31 décembre 2015, les frais représentaient en moyenne 17 p.c.

II. Statistiques financières et rétrospective

| | |
|--|-----|
| 1. Évolution de l'actif net attribuable aux déposants | 30 |
| 2. Variation de l'actif net attribuable aux déposants et de l'actif total sous gestion | 31 |
| 3. Évolution de l'avoir des déposants | 32 |
| 4. Ventilation de l'avoir des déposants | 40 |
| 5. Intérêt ou revenu annuel versé sur les dépôts moyens | 41 |
| 6. Sommaire des placements | 42 |
| 7. Ventilation des placements..... | 43 |
| 8. Secteur immobilier - Financements de 5 M\$ et plus | 45 |
| 9. Investissements en actions, en obligations et en créances d'entreprises de sociétés cotées..... | 54 |
| 10. Investissements en actions, en obligations et en créances d'entreprises de sociétés fermées | 142 |
| 11. Relevé des biens immobiliers | 159 |
| 12. Relevé des biens immobiliers détenus à des fins de revente | 161 |

1

ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX DÉPOSANTS
au 31 décembre
(juste valeur - en millions de dollars)

| | 2016 | 2015 | 2014 | 2013 | 2012 | 2011 | 2010 | 2009 | 2008 | 2007 |
|--|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| Actif | | | | | | | | | | |
| Placements | 308 875 | 286 845 | 268 804 | 236 408 | 211 097 | 185 606 | 178 376 | 167 575 | 182 493 | 222 797 |
| Avances à des déposants | 1 068 | 776 | 1 090 | 996 | 797 | 761 | 789 | 371 | 754 | 372 |
| Revenus de placement courus et à recevoir | 1 173 | 1 226 | 1 149 | 898 | 751 | 854 | 933 | 1 042 | 1 394 | 1 209 |
| Montants à recevoir relatifs à des opérations en voie de règlement | 3 898 | 1 288 | 1 346 | 1 697 | 153 | 774 | 177 | 70 | 1 241 | 1 567 |
| Autres actifs | 845 | 682 | 334 | 240 | 1 002 | 3 293 | 2 922 | 1 598 | 993 | 1 204 |
| | 315 859 | 290 817 | 272 723 | 240 239 | 213 800 | 191 288 | 183 197 | 170 656 | 186 875 | 227 149 |
| Passif | | | | | | | | | | |
| Passif relatifs aux placements | 42 890 | 41 039 | 44 924 | 37 161 | 34 129 | 28 554 | 27 807 | 34 830 | 62 612 | 66 100 |
| Montants à payer relatifs à des opérations en voie de règlement | 1 687 | 1 224 | 1 300 | 2 380 | 155 | 110 | 563 | 1 478 | 849 | 2 087 |
| Autres passifs financiers | 536 | 529 | 648 | 549 | 1 300 | 1 162 | 1 310 | 1 200 | 1 511 | 1 561 |
| Participations ne donnant pas le contrôle | - | - | - | - | 2 006 | 2 497 | 1 775 | 1 560 | 1 815 | 2 051 |
| | 45 113 | 42 792 | 46 872 | 40 090 | 37 590 | 32 323 | 31 455 | 39 068 | 66 787 | 71 799 |
| Actif net attribuable aux déposants | 270 746 | 248 025 | 225 851 | 200 149 | 176 210 | 158 965 | 151 742 | 131 588 | 120 088 | 155 350 |

Depuis 2013, les chiffres sont présentés conformément aux normes IFRS.

2 VARIATION DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX DÉPOSANTS ET DE L'ACTIF TOTAL SOUS GESTION
des exercices clos le 31 décembre
(en millions de dollars)

| | 2016 | 2015 | 2014 | 2013 | 2012 | 2011 | 2010 | 2009 | 2008 | 2007 |
|---|----------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|----------|---------|
| Résultats de placement nets avant distributions aux déposants | 18 417 | 20 109 | 23 775 | 22 768 | 14 937 | 5 746 | 17 731 | 11 752 | (39 816) | 7 871 |
| Contributions nettes (retraits nets) des déposants | 4 304 | 2 065 | 1 927 | 1 171 | 2 308 | 1 477 | 2 423 | (252) | 4 554 | 4 000 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux déposants | 22 721 | 22 174 | 25 702 | 23 939 | 17 245 | 7 223 | 20 154 | 11 500 | (35 262) | 11 871 |
| Actif net attribuable aux déposants | 270 746 | 248 025 | 225 851 | 200 149 | 176 210 | 158 965 | 151 742 | 131 588 | 120 088 | 155 350 |
| Passif excluant l'actif net attribuable aux déposants | 45 113 | 42 792 | 46 872 | 40 090 | 37 590 | 32 323 | 31 455 | 39 068 | 66 787 | 71 799 |
| Actif total | 315 859 | 290 817 | 272 723 | 240 239 | 213 800 | 191 288 | 183 197 | 170 656 | 186 875 | 227 149 |
| Biens sous gestion et administrés | | | | | | | | | | |
| Biens sous gestion | 18 569 | 20 505 | 12 699 | 13 080 | 7 423 | 8 731 | 11 417 | 14 933 | 17 364 | 16 498 |
| Biens administrés | 59 723 | 52 850 | 47 264 | 41 635 | 37 913 | 4 159 | 4 516 | 15 676 | 16 185 | 14 098 |
| | 78 292 | 73 355 | 59 963 | 54 715 | 45 336 | 12 890 | 15 933 | 30 609 | 33 549 | 30 596 |
| Actif total sous gestion | 394 151 | 364 172 | 332 686 | 294 954 | 259 136 | 204 178 | 199 130 | 201 265 | 220 424 | 257 745 |

Depuis 2013, les chiffres sont présentés conformément aux normes IFRS.

ÉVOLUTION DE L'AVOIR DES DÉPOSANTS
au 31 décembre
(juste valeur - en millions de dollars)

| | 2016 | 2015 | 2014 | 2013 | 2012 | 2011 | 2010 | 2009 | 2008 | 2007 |
|--|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|----------|--------|
| CAISSES DE RETRAITE | | | | | | | | | | |
| Retraite Québec | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 2 627 | 3 348 | 2 973 | 2 569 | 2 191 | 1 478 | 905 | 385 | (87) | 2 431 |
| Dépôts (retraits) | 540 | (108) | 325 | 745 | 567 | 178 | 981 | (20) | 934 | 33 |
| +/- valeur non matérialisée | 1 999 | 1 972 | 2 696 | 3 487 | 1 435 | (624) | 3 249 | 2 118 | (9 381) | (383) |
| Avoir net | 62 243 | 57 077 | 51 865 | 45 871 | 39 070 | 34 877 | 33 845 | 28 710 | 26 227 | 34 761 |
| Avances de fonds | (740) | (445) | (665) | (636) | (461) | (369) | (504) | (76) | (478) | (58) |
| Avoir net incluant avances de fonds | 61 503 | 56 632 | 51 200 | 45 235 | 38 609 | 34 508 | 33 341 | 28 634 | 25 749 | 34 703 |
| Excédent sur le coût | 13 197 | 11 198 | 9 226 | 6 530 | 3 043 | 1 608 | 2 232 | (1 017) | (3 135) | 6 246 |
| Régime supplémentaire de rentes pour les employés de l'industrie de la construction du Québec | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 947 | 1 082 | 843 | 1 034 | 832 | 538 | 277 | 143 | 257 | 855 |
| Dépôts (retraits) | 37 | 37 | 160 | 198 | 254 | 159 | 121 | 78 | 112 | 93 |
| +/- valeur non matérialisée | 243 | 348 | 1 054 | 235 | 231 | 415 | 1 098 | 466 | (2 279) | (261) |
| Avoir net | 20 694 | 19 467 | 18 000 | 15 943 | 14 476 | 13 159 | 12 047 | 10 551 | 9 864 | 11 774 |
| Avances de fonds | (24) | (27) | (11) | - | (7) | (16) | (10) | (59) | (47) | (34) |
| Avoir net incluant avances de fonds | 20 670 | 19 440 | 17 989 | 15 943 | 14 469 | 13 143 | 12 037 | 10 492 | 9 817 | 11 740 |
| Excédent sur le coût | 3 271 | 3 028 | 2 680 | 1 626 | 1 391 | 1 160 | 745 | (353) | (819) | 1 460 |
| Régime de retraite des employés du gouvernement et des organismes publics | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 3 036 | 3 173 | 3 426 | 2 946 | 2 253 | 1 464 | 281 | 364 | 470 | 2 998 |
| Dépôts (retraits) | (660) | (743) | (664) | (759) | (767) | (689) | (673) | (334) | (438) | (249) |
| +/- valeur non matérialisée | 1 350 | 1 704 | 2 540 | 3 114 | 1 673 | (94) | 4 538 | 3 331 | (12 301) | (849) |
| Avoir net | 63 604 | 59 878 | 55 744 | 50 442 | 45 141 | 41 982 | 41 301 | 37 155 | 33 794 | 46 063 |
| Avances de fonds | - | - | (87) | (57) | - | - | - | - | - | - |
| Avoir net incluant avances de fonds | 63 604 | 59 878 | 55 657 | 50 385 | 45 141 | 41 982 | 41 301 | 37 155 | 33 794 | 46 063 |
| Excédent sur le coût | 13 376 | 12 026 | 10 322 | 7 782 | 4 668 | 2 995 | 3 089 | (1 449) | (4 780) | 7 521 |
| Régime de retraite du personnel d'encadrement | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 496 | 648 | 585 | 479 | 386 | 312 | 144 | 49 | 54 | 535 |
| Dépôts (retraits) | (119) | (63) | (119) | (25) | 35 | (39) | (388) | (165) | 217 | (58) |
| +/- valeur non matérialisée | 208 | 275 | 412 | 437 | 255 | 6 | 655 | 519 | (1 943) | (149) |
| Avoir net | 11 012 | 10 427 | 9 567 | 8 689 | 7 798 | 7 122 | 6 843 | 6 432 | 6 029 | 7 701 |
| Avances de fonds | - | - | - | - | - | - | (6) | - | - | (16) |
| Avoir net incluant avances de fonds | 11 012 | 10 427 | 9 567 | 8 689 | 7 798 | 7 122 | 6 837 | 6 432 | 6 029 | 7 685 |
| Excédent sur le coût | 2 084 | 1 876 | 1 601 | 1 189 | 752 | 497 | 491 | (164) | (683) | 1 260 |
| Régimes particuliers | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 12 | 15 | 13 | 13 | 10 | 7 | 2 | - | 3 | 19 |
| Dépôts (retraits) | (7) | (6) | (5) | (5) | (4) | (1) | (65) | (5) | (5) | 7 |
| +/- valeur non matérialisée | 4 | 5 | 11 | 10 | 6 | (1) | 20 | 19 | (70) | (5) |
| Avoir net | 250 | 241 | 227 | 208 | 190 | 178 | 173 | 216 | 202 | 274 |
| Excédent sur le coût | 48 | 44 | 39 | 28 | 18 | 12 | 13 | (7) | (26) | 44 |

ÉVOLUTION DE L'AVOIR DES DÉPOSANTS (suite)
au 31 décembre
(juste valeur - en millions de dollars)

| | 2016 | 2015 | 2014 | 2013 | 2012 | 2011 | 2010 | 2009 | 2008 | 2007 |
|--|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|---------|--------|
| Régime de retraite des élus municipaux | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 13 | 13 | 11 | 12 | 8 | 6 | 1 | - | 2 | 13 |
| Dépôts (retraits) | (2) | (5) | (3) | (2) | (1) | (2) | (1) | (2) | (1) | - |
| +/- valeur non matérialisée | 5 | 5 | 12 | 13 | 7 | (1) | 17 | 13 | (46) | (4) |
| Avoir net | 245 | 229 | 216 | 196 | 173 | 159 | 156 | 139 | 128 | 173 |
| Excédent sur le coût | 55 | 50 | 45 | 33 | 20 | 13 | 14 | (3) | (16) | 30 |
| Régime de retraite des maires et conseillers des municipalités | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Dépôts (retraits) | (1) | 2 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| +/- valeur non matérialisée | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Avoir net | 1 | 2 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Excédent sur le coût | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Régime complémentaire de rentes des techniciens ambulanciers/paramédics et des services préhospitaliers d'urgence | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 18 | 21 | 72 | 17 | 17 | 12 | 8 | 4 | 3 | 18 |
| Dépôts (retraits) | 8 | 11 | 17 | 11 | 12 | 15 | 12 | 9 | 8 | 3 |
| +/- valeur non matérialisée | 13 | 17 | (27) | 21 | 10 | (3) | 20 | 16 | (57) | (7) |
| Avoir net | 539 | 500 | 451 | 389 | 340 | 301 | 277 | 237 | 208 | 254 |
| Excédent sur le coût | 47 | 34 | 17 | 44 | 23 | 13 | 16 | (4) | (20) | 37 |
| Fonds d'amortissement des régimes de retraite | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 2 862 | 2 656 | 2 673 | 2 367 | 1 781 | 1 124 | 264 | 284 | (244) | 1 798 |
| Dépôts (retraits) | 1 500 | 1 500 | 1 000 | 1 000 | 1 000 | 1 000 | 1 500 | - | 2 850 | 3 750 |
| +/- valeur non matérialisée | 1 753 | 1 718 | 2 897 | 2 774 | 1 590 | 25 | 3 603 | 2 450 | (8 467) | (409) |
| Avoir net | 65 422 | 59 307 | 53 433 | 46 863 | 40 722 | 36 351 | 34 202 | 28 835 | 26 101 | 31 962 |
| Excédent sur le coût | 11 446 | 9 693 | 7 975 | 5 078 | 2 304 | 714 | 689 | (2 914) | (5 364) | 3 103 |
| Régime de retraite des membres de la Sûreté du Québec - Caisse employeurs | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 26 | 19 | 19 | 17 | 7 | 7 | 5 | - | - | - |
| Dépôts (retraits) | (8) | 172 | (1) | (2) | 147 | (3) | (3) | 128 | - | - |
| +/- valeur non matérialisée | 17 | 11 | 20 | 20 | 5 | (2) | 12 | - | - | - |
| Avoir net | 613 | 578 | 376 | 338 | 303 | 144 | 142 | 128 | - | - |
| Excédent sur le coût | 83 | 66 | 55 | 35 | 15 | 10 | 12 | - | - | - |
| Régime de retraite de l'Université du Québec | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 25 | 13 | 17 | 12 | 21 | 9 | 6 | 9 | 6 | 7 |
| Dépôts (retraits) | 6 | 28 | (11) | 4 | - | (10) | 34 | (8) | 10 | 18 |
| +/- valeur non matérialisée | 19 | 22 | 15 | 28 | 6 | 13 | 23 | (17) | (61) | 25 |
| Avoir net | 431 | 381 | 318 | 297 | 253 | 226 | 214 | 151 | 167 | 212 |
| Excédent sur le coût | 133 | 114 | 92 | 77 | 49 | 43 | 30 | 7 | 24 | 85 |

ÉVOLUTION DE L'AVOIR DES DÉPOSANTS (suite)
au 31 décembre
(juste valeur - en millions de dollars)

| | 2016 | 2015 | 2014 | 2013 | 2012 | 2011 | 2010 | 2009 | 2008 | 2007 |
|---|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|
| Régime de retraite du personnel des CPE | | | | | | | | | | |
| et des garderies privées conventionnées du Québec | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 18 | 12 | 12 | 8 | 7 | 2 | 1 | (6) | 4 | 2 |
| Dépôts (retraits) | 11 | 50 | - | 38 | 15 | 17 | 34 | (15) | 5 | 29 |
| +/- valeur non matérialisée | 15 | 7 | 9 | 12 | 5 | 5 | 7 | 5 | (15) | 1 |
| Avoir net | 316 | 272 | 203 | 182 | 124 | 97 | 73 | 31 | 47 | 53 |
| Excédent sur le coût | 51 | 36 | 29 | 20 | 8 | 3 | (2) | (9) | (14) | 1 |
| Régime complémentaire de retraite des employés syndiqués de la Commission de la construction du Québec | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | - | - | - | - | - | (2) | (2) | - | 1 | 1 |
| Dépôts (retraits) | - | - | - | - | - | (16) | (5) | - | 8 | - |
| +/- valeur non matérialisée | - | - | - | - | - | 2 | 5 | (1) | (5) | - |
| Avoir net | - | - | - | - | - | - | 16 | 18 | 19 | 15 |
| Excédent sur le coût | - | - | - | - | - | 1 | (1) | (6) | (5) | - |
| Régime de retraite pour certains employés de la Commission scolaire de la Capitale | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 2 | 2 | 1 | 2 | 2 | 1 | 1 | - | 1 | 2 |
| Dépôts (retraits) | (3) | (3) | (3) | (3) | (4) | (3) | (4) | (3) | (4) | (1) |
| +/- valeur non matérialisée | - | - | 2 | 1 | 1 | 1 | 3 | 2 | (7) | - |
| Avoir net | 34 | 35 | 36 | 36 | 36 | 37 | 38 | 38 | 39 | 49 |
| Excédent sur le coût | 3 | 3 | 3 | 1 | - | (1) | (2) | (5) | (7) | - |
| Régime de rentes pour le personnel non enseignant de la Commission des écoles catholiques de Montréal | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 11 | 10 | 10 | 11 | 10 | 7 | 3 | 1 | 4 | 13 |
| Dépôts (retraits) | (19) | (20) | (21) | (22) | (22) | (23) | (23) | (24) | (25) | 294 |
| +/- valeur non matérialisée | 2 | 2 | 11 | 8 | 9 | 6 | 21 | 13 | (42) | (3) |
| Avoir net | 202 | 208 | 216 | 216 | 219 | 222 | 232 | 231 | 241 | 304 |
| Excédent sur le coût | 27 | 25 | 23 | 12 | 4 | (5) | (11) | (32) | (45) | (3) |
| Régime de retraite des membres de la Sûreté du Québec - Caisse participants | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 15 | 16 | 15 | 12 | 6 | 4 | 3 | - | (1) | 1 |
| Dépôts (retraits) | 30 | 29 | 32 | 31 | 31 | 26 | 23 | 26 | 23 | 21 |
| +/- valeur non matérialisée | 14 | 10 | 14 | 13 | 6 | (1) | 7 | 7 | (8) | (1) |
| Avoir net | 404 | 345 | 290 | 229 | 173 | 130 | 101 | 68 | 35 | 21 |
| Excédent sur le coût | 61 | 47 | 37 | 23 | 10 | 4 | 5 | (2) | (9) | (1) |
| Régime de retraite des employés de la Ville de Laval | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 17 | 11 | 10 | 7 | 7 | 2 | 1 | - | 1 | - |
| Dépôts (retraits) | 22 | 110 | (1) | 10 | 8 | 23 | 8 | 13 | 17 | 25 |
| +/- valeur non matérialisée | 13 | 6 | 7 | 12 | 4 | 5 | 9 | 1 | (12) | 2 |
| Avoir net | 338 | 286 | 159 | 143 | 114 | 95 | 65 | 47 | 33 | 27 |
| Excédent sur le coût | 47 | 34 | 28 | 21 | 9 | 5 | - | (9) | (10) | 2 |

ÉVOLUTION DE L'AVOIR DES DÉPOSANTS (suite)
au 31 décembre
(juste valeur - en millions de dollars)

| | 2016 | 2015 | 2014 | 2013 | 2012 | 2011 | 2010 | 2009 | 2008 | 2007 |
|---|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|
| Régime de retraite des employés en fonction | | | | | | | | | | |
| au Centre hospitalier Côte-des-Neiges | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 4 | 5 | 6 | 5 | 3 | 3 | - | - | - | - |
| Dépôts (retraits) | (3) | (2) | (2) | (3) | (2) | (4) | 61 | - | - | - |
| +/- valeur non matérialisée | 1 | 1 | 2 | 2 | 2 | (1) | 6 | - | - | - |
| Avoir net | 84 | 82 | 78 | 72 | 68 | 65 | 67 | - | - | - |
| Excédent sur le coût | 13 | 12 | 11 | 9 | 7 | 5 | 6 | - | - | - |
| Fonds commun de placement des régimes de retraite | | | | | | | | | | |
| de l'Université Laval | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 10 | 3 | 2 | 2 | 8 | - | - | - | - | - |
| Dépôts (retraits) | 21 | 50 | (11) | 3 | 106 | - | - | - | - | - |
| +/- valeur non matérialisée | 11 | 17 | 10 | 15 | - | - | - | - | - | - |
| Avoir net | 247 | 205 | 135 | 134 | 114 | - | - | - | - | - |
| Excédent sur le coût | 53 | 42 | 25 | 15 | - | - | - | - | - | - |
| Fiducie globale Ville de Magog | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 3 | 3 | 2 | 3 | - | - | - | - | - | - |
| Dépôts (retraits) | - | - | 1 | 1 | 40 | - | - | - | - | - |
| +/- valeur non matérialisée | 2 | 2 | 3 | 3 | 1 | - | - | - | - | - |
| Avoir net | 64 | 59 | 54 | 48 | 41 | - | - | - | - | - |
| Excédent sur le coût | 11 | 9 | 7 | 4 | 1 | - | - | - | - | - |
| Régime de retraite des employées et employés | | | | | | | | | | |
| de la Ville de Sherbrooke | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 2 | 3 | 2 | 2 | - | - | - | - | - | - |
| Dépôts (retraits) | - | - | 3 | 12 | 13 | - | - | - | - | - |
| +/- valeur non matérialisée | 1 | (1) | 2 | (1) | - | - | - | - | - | - |
| Avoir net | 38 | 35 | 33 | 26 | 13 | - | - | - | - | - |
| Excédent sur le coût | 1 | - | 1 | (1) | - | - | - | - | - | - |
| Régime de retraite des agents de la paix en services | | | | | | | | | | |
| correctionnels | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 19 | 18 | 10 | 3 | - | - | - | - | - | - |
| Dépôts (retraits) | 109 | 121 | 135 | 133 | - | - | - | - | - | - |
| +/- valeur non matérialisée | 19 | 14 | 13 | 9 | - | - | - | - | - | - |
| Avoir net | 603 | 456 | 303 | 145 | - | - | - | - | - | - |
| Avances de fonds | - | - | (1) | (1) | - | - | - | - | - | - |
| Avoir net incluant avances de fonds | 603 | 456 | 302 | 144 | - | - | - | - | - | - |
| Excédent sur le coût | 55 | 36 | 22 | 9 | - | - | - | - | - | - |
| Régime complémentaire de retraite des employés réguliers | | | | | | | | | | |
| de la Société de transport de Sherbrooke | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 3 | 3 | 3 | - | - | - | - | - | - | - |
| Dépôts (retraits) | - | - | - | 56 | - | - | - | - | - | - |
| +/- valeur non matérialisée | 2 | 2 | 6 | - | - | - | - | - | - | - |
| Avoir net | 75 | 70 | 65 | 56 | - | - | - | - | - | - |
| Excédent sur le coût | 10 | 8 | 6 | - | - | - | - | - | - | - |

ÉVOLUTION DE L'AVOIR DES DÉPOSANTS (suite)
au 31 décembre
(juste valeur - en millions de dollars)

| | 2016 | 2015 | 2014 | 2013 | 2012 | 2011 | 2010 | 2009 | 2008 | 2007 |
|---|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|
| Régime de retraite de la Corporation de l'École Polytechnique | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 2 | 1 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Dépôts (retraits) | 11 | 23 | 11 | - | - | - | - | - | - | - |
| +/- value non matérialisée | 3 | 1 | 1 | - | - | - | - | - | - | - |
| Avoir net | 53 | 37 | 12 | - | - | - | - | - | - | - |
| Excédent sur le coût | 5 | 2 | 1 | - | - | - | - | - | - | - |
| Régimes de retraite de la Ville de Terrebonne | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 2 | 1 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Dépôts (retraits) | 6 | 49 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| +/- value non matérialisée | 1 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Avoir net | 59 | 50 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Excédent sur le coût | 1 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Régime de retraite des cadres de la Ville de Québec | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 1 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Dépôts (retraits) | 245 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| +/- value non matérialisée | (2) | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Avoir net | 244 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Excédent sur le coût | (2) | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Régime de retraite des employés manuels de la Ville de Québec | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 1 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Dépôts (retraits) | 296 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| +/- value non matérialisée | (1) | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Avoir net | 296 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Excédent sur le coût | (1) | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Régime de retraite des fonctionnaires de la Ville de Québec | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 2 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Dépôts (retraits) | 517 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| +/- value non matérialisée | (1) | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Avoir net | 518 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Excédent sur le coût | (1) | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Régime de retraite du personnel professionnel de la Ville de Québec | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 1 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Dépôts (retraits) | 191 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| +/- value non matérialisée | (1) | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Avoir net | 191 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Excédent sur le coût | (1) | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Régime de retraite des policiers et policières de la Ville de Québec | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 2 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Dépôts (retraits) | 420 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| +/- value non matérialisée | (3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Avoir net | 419 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Excédent sur le coût | (3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

ÉVOLUTION DE L'AVOIR DES DÉPOSANTS (suite)
au 31 décembre
(juste valeur - en millions de dollars)

| | 2016 | 2015 | 2014 | 2013 | 2012 | 2011 | 2010 | 2009 | 2008 | 2007 |
|---|--------|--------|--------|--------|--------|-------|-------|-------|---------|--------|
| Régime de retraite des pompiers de la Ville de Québec | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 1 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Dépôts (retraits) | 150 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| +/- value non matérialisée | (1) | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Avoir net | 150 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Excédent sur le coût | (1) | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Régime de retraite des employés du Réseau de transport de la Capitale | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Dépôts (retraits) | 63 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| +/- value non matérialisée | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Avoir net | 63 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Excédent sur le coût | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| RÉGIMES D'ASSURANCE | | | | | | | | | | |
| Régie des marchés agricoles et alimentaires du Québec | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | - | 1 | - | - | 1 | - | - | - | 1 | - |
| Dépôts (retraits) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| +/- value non matérialisée | - | - | 1 | - | - | - | 1 | - | (1) | - |
| Avoir net | 10 | 10 | 9 | 8 | 8 | 7 | 7 | 6 | 6 | 6 |
| Excédent sur le coût | 2 | 2 | 2 | 1 | 1 | 1 | 1 | - | - | 1 |
| La Financière agricole du Québec | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 16 | 23 | 12 | 10 | 11 | 7 | - | 3 | 14 | 21 |
| Dépôts (retraits) | 87 | 191 | 2 | 49 | 37 | (8) | (36) | 31 | (3) | (7) |
| +/- value non matérialisée | 11 | (1) | 14 | 15 | 5 | 2 | 20 | 3 | (56) | (5) |
| Avoir net | 700 | 586 | 373 | 345 | 271 | 218 | 217 | 233 | 196 | 241 |
| Excédent sur le coût | 52 | 41 | 42 | 28 | 13 | 8 | 6 | (14) | (17) | 39 |
| Autorité des marchés financiers | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 14 | 14 | 26 | 15 | 15 | 14 | 11 | 14 | 15 | 20 |
| Dépôts (retraits) | 22 | 55 | 12 | - | 7 | 16 | 53 | 6 | 13 | 13 |
| +/- value non matérialisée | 7 | 4 | 6 | (6) | 8 | 14 | 15 | 3 | (19) | (5) |
| Avoir net | 791 | 748 | 675 | 631 | 622 | 592 | 548 | 469 | 446 | 437 |
| Excédent sur le coût | 43 | 36 | 32 | 26 | 32 | 24 | 10 | (5) | (8) | 11 |
| Commission des normes, de l'équité, de la santé et de la sécurité du travail | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 705 | 703 | 805 | 710 | 650 | 410 | 176 | (54) | (22) | 822 |
| Dépôts (retraits) | (314) | (170) | 80 | (76) | (2) | (27) | 39 | (248) | (159) | (315) |
| +/- value non matérialisée | 288 | 458 | 631 | 665 | 289 | (1) | 1 004 | 797 | (2 957) | (217) |
| Avoir net | 15 367 | 14 688 | 13 697 | 12 181 | 10 882 | 9 945 | 9 563 | 8 344 | 7 849 | 10 987 |
| Avances de fonds | (90) | (22) | - | - | (40) | (136) | (7) | (50) | (76) | (80) |
| Avoir net incluant avances de fonds | 15 277 | 14 666 | 13 697 | 12 181 | 10 842 | 9 809 | 9 556 | 8 294 | 7 773 | 10 907 |
| Excédent sur le coût | 3 043 | 2 755 | 2 297 | 1 666 | 1 001 | 712 | 713 | (291) | (1 088) | 1 869 |

ÉVOLUTION DE L'AVOIR DES DÉPOSANTS (suite)
au 31 décembre
(juste valeur - en millions de dollars)

| | 2016 | 2015 | 2014 | 2013 | 2012 | 2011 | 2010 | 2009 | 2008 | 2007 |
|--|--------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|---------|-------|
| Société de l'assurance automobile du Québec | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 503 | 605 | 580 | 458 | 420 | 294 | 184 | 63 | 34 | 958 |
| Dépôts (retraits) | (300) | 13 | 65 | (5) | 67 | (13) | 37 | (156) | (360) | (435) |
| +/- valeur non matérialisée | 159 | 339 | 394 | 363 | 256 | 102 | 665 | 441 | (2 185) | (447) |
| Avoir net | 11 306 | 10 944 | 9 987 | 8 948 | 8 132 | 7 389 | 7 006 | 6 120 | 5 772 | 8 283 |
| Avances de fonds | (214) | (282) | (326) | (302) | (289) | (240) | (262) | (186) | (153) | (183) |
| Avoir net incluant avances de fonds | 11 092 | 10 662 | 9 661 | 8 646 | 7 843 | 7 149 | 6 744 | 5 934 | 5 619 | 8 100 |
| Excédent sur le coût | 2 029 | 1 870 | 1 531 | 1 137 | 774 | 518 | 416 | (249) | (690) | 1 495 |
| Les Producteurs de bovins du Québec | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | - | 1 | - | - | - | - | - | - | 1 | - |
| Dépôts (retraits) | - | - | - | 1 | (3) | 1 | 3 | - | - | (1) |
| +/- valeur non matérialisée | - | - | - | - | - | - | - | - | (1) | - |
| Avoir net | 6 | 6 | 5 | 5 | 4 | 7 | 6 | 3 | 3 | 3 |
| Excédent sur le coût | (1) | (1) | (1) | (1) | (1) | (1) | (1) | (1) | (1) | - |
| Régime de rentes de survivants | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 24 | 25 | 24 | 26 | 23 | 16 | 5 | 6 | (10) | 31 |
| Dépôts (retraits) | (24) | (21) | (20) | (21) | (29) | (22) | (24) | (15) | (21) | (16) |
| +/- valeur non matérialisée | 7 | 10 | 20 | 21 | 11 | (2) | 40 | 25 | (104) | (5) |
| Avoir net | 432 | 425 | 411 | 387 | 361 | 356 | 364 | 343 | 327 | 462 |
| Excédent sur le coût | 91 | 84 | 74 | 54 | 33 | 22 | 24 | (16) | (41) | 63 |
| Conseil de gestion de l'assurance parentale | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | - | - | - | - | - | - | - | - | 4 | 19 |
| Dépôts (retraits) | - | - | (2) | - | - | - | - | - | (202) | (224) |
| +/- valeur non matérialisée | - | - | - | - | 1 | - | - | - | - | (3) |
| Avoir net | 1 | 1 | 1 | 3 | 3 | 2 | 2 | 2 | 2 | 200 |
| Excédent sur le coût | (1) | (1) | (1) | (1) | (1) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) |
| AUTRES DÉPOSANTS | | | | | | | | | | |
| Office de la protection du consommateur | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 6 | 6 | 5 | 5 | 3 | 3 | 1 | 1 | - | 2 |
| Dépôts (retraits) | 3 | - | 3 | 8 | 6 | 10 | 11 | 9 | 11 | 4 |
| +/- valeur non matérialisée | 3 | 3 | 7 | 5 | 3 | 1 | 4 | 1 | (4) | (1) |
| Avoir net | 141 | 129 | 120 | 105 | 87 | 75 | 61 | 45 | 34 | 27 |
| Excédent sur le coût | 23 | 20 | 17 | 10 | 5 | 2 | 1 | (3) | (4) | - |
| Société des alcools du Québec | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | - | - | - | - | - | - | - | - | - | (1) |
| Dépôts (retraits) | - | (193) | 106 | (31) | (3) | (23) | 144 | (83) | 30 | 40 |
| +/- valeur non matérialisée | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Avoir net | - | - | 193 | 87 | 118 | 121 | 144 | - | 83 | 53 |
| Excédent sur le coût | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

ÉVOLUTION DE L'AVOIR DES DÉPOSANTS (suite)
au 31 décembre
(juste valeur - en millions de dollars)

| | 2016 | 2015 | 2014 | 2013 | 2012 | 2011 | 2010 | 2009 | 2008 | 2007 |
|---|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|----------|---------|
| Fonds des générations | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 387 | 335 | 321 | 311 | 217 | 130 | 92 | 33 | (40) | 29 |
| Dépôts (retraits) | 1 456 | 961 | 837 | 117 | 782 | 602 | 655 | 794 | 615 | 976 |
| +/- valeur non matérialisée | 332 | 278 | 396 | 310 | 147 | 5 | 236 | 180 | (286) | 3 |
| Avoir net | 11 211 | 9 036 | 7 462 | 5 908 | 5 170 | 4 024 | 3 287 | 2 304 | 1 297 | 1 008 |
| Excédent sur le coût | 1 601 | 1 269 | 991 | 595 | 285 | 138 | 133 | (103) | (283) | 3 |
| Fonds des congés de maladie accumulés | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 52 | 50 | 53 | 49 | 47 | 35 | 44 | 18 | 2 | - |
| Dépôts (retraits) | - | - | - | - | (79) | - | - | - | 600 | - |
| +/- valeur non matérialisée | 25 | 26 | 46 | 44 | 13 | (11) | 40 | 41 | - | - |
| Avoir net | 1 095 | 1 018 | 942 | 843 | 750 | 769 | 745 | 661 | 602 | - |
| Excédent sur le coût | 224 | 199 | 173 | 127 | 83 | 70 | 81 | 41 | - | - |
| Fonds d'information sur le territoire | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 4 | 5 | 5 | 28 | 9 | 1 | - | - | - | - |
| Dépôts (retraits) | 12 | (3) | - | (292) | 18 | 313 | - | - | - | - |
| +/- valeur non matérialisée | 2 | 2 | 4 | (5) | 10 | 1 | - | - | - | - |
| Avoir net | 114 | 96 | 92 | 83 | 352 | 315 | - | - | - | - |
| Excédent sur le coût | 14 | 12 | 10 | 6 | 11 | 1 | - | - | - | - |
| Agence du revenu du Québec | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 5 | 5 | 5 | 4 | 2 | - | - | - | - | - |
| Dépôts (retraits) | - | - | - | - | 79 | - | - | - | - | - |
| +/- valeur non matérialisée | 4 | 3 | 6 | 6 | 1 | - | - | - | - | - |
| Avoir net | 120 | 111 | 103 | 92 | 82 | - | - | - | - | - |
| Excédent sur le coût | 20 | 16 | 13 | 7 | 1 | - | - | - | - | - |
| Fonds de la réserve budgétaire du gouvernement du Québec | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | - | - | - | - | - | - | - | 2 | 18 | - |
| Dépôts (retraits) | - | - | - | - | - | - | (71) | (268) | 319 | - |
| +/- valeur non matérialisée | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Avoir net | - | - | - | - | - | - | - | 71 | 337 | - |
| Excédent sur le coût | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Ensemble des déposants | | | | | | | | | | |
| Revenu net attribué | 11 894 | 12 849 | 12 541 | 11 137 | 8 947 | 5 884 | 2 413 | 1 319 | 491 | 10 594 |
| Dépôts (retraits) | 4 303 | 2 065 | 1 926 | 1 171 | 2 308 | 1 477 | 2 423 | (252) | 4 554 | 4 000 |
| +/- valeur non matérialisée | 6 524 | 7 260 | 11 235 | 11 631 | 5 990 | (138) | 15 318 | 10 433 | (40 307) | (2 723) |
| Avoir net | 270 746 | 248 025 | 225 851 | 200 149 | 176 210 | 158 965 | 151 742 | 131 588 | 120 088 | 155 350 |
| Avances de fonds | (1 068) | (776) | (1 090) | (996) | (797) | (761) | (789) | (371) | (754) | (371) |
| Avoir net incluant avances de fonds | 269 678 | 247 249 | 224 761 | 199 153 | 175 413 | 158 204 | 150 953 | 131 217 | 119 334 | 154 979 |
| Excédent sur le coût | 51 208 | 44 684 | 37 424 | 26 189 | 14 558 | 8 568 | 8 706 | (6 612) | (17 045) | 23 262 |

4

VENTILATION DE L'AVOIR DES DÉPOSANTS
au 31 décembre
(juste valeur - en pourcentage)

| | 2016 | 2015 | 2014 | 2013 | 2012 | 2011 | 2010 | 2009 | 2008 | 2007 |
|---|--------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| Fonds d'amortissement des régimes de retraite | 24,2 | 23,9 | 23,8 | 23,4 | 23,1 | 22,9 | 22,6 | 21,9 | 21,7 | 20,6 |
| Régime de retraite des employés du gouvernement et des organismes publics | 23,4 | 24,2 | 24,8 | 25,2 | 25,6 | 26,4 | 27,2 | 28,2 | 28,2 | 29,7 |
| Retraite Québec | 23,0 | 23,0 | 22,8 | 22,9 | 22,2 | 21,9 | 22,3 | 21,8 | 21,9 | 22,4 |
| Régime supplémentaire de rentes pour les employés de l'industrie de la construction du Québec | 7,6 | 7,9 | 8,0 | 8,0 | 8,2 | 8,3 | 8,0 | 8,0 | 8,2 | 7,6 |
| Commission des normes, de l'équité, de la santé et de la sécurité du travail | 5,7 | 5,9 | 6,1 | 6,1 | 6,2 | 6,3 | 6,3 | 6,3 | 6,5 | 7,1 |
| Société de l'assurance automobile du Québec | 4,2 | 4,4 | 4,3 | 4,5 | 4,6 | 4,7 | 4,6 | 4,7 | 4,8 | 5,3 |
| Régime de retraite du personnel d'encadrement | 4,1 | 4,2 | 4,2 | 4,3 | 4,4 | 4,5 | 4,5 | 4,9 | 5,0 | 5,0 |
| Fonds des générations | 4,1 | 3,7 | 3,3 | 3,0 | 2,9 | 2,5 | 2,2 | 1,8 | 1,1 | 0,6 |
| Autres déposants | 3,7 | 2,8 | 2,7 | 2,6 | 2,8 | 2,5 | 2,3 | 2,4 | 2,6 | 1,7 |
| | 100,0 | 100,0 | 100,0 | 100,0 | 100,0 | 100,0 | 100,0 | 100,0 | 100,0 | 100,0 |

5

INTÉRÊT OU REVENU ANNUEL VERSÉ SUR LES DÉPÔTS MOYENS
 (taux en pourcentage)

| CATÉGORIES DE DÉPÔTS | 2016 | 2015 | 2014 | 2013 | 2012 | 2011 | 2010 | 2009 | 2008 | 2007 |
|-------------------------------------|-------------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|
| Dépôts à vue ¹ | 0,50 | 0,65 | 1,00 | 1,00 | 1,00 | 1,00 | 0,61 | 0,61 | 3,11 | 4,35 |
| Dépôts à terme ¹ | 3,08 | 1,80 | 1,81 | 1,54 | 1,47 | 1,69 | 0,78 | 1,39 | 3,55 | 4,38 |
| Dépôts à participation ² | 5,58 | 6,57 | 6,88 | 6,64 | 5,74 | 4,00 | 1,76 | 1,14 | 0,65 | 8,32 |

¹ Le fonds général reçoit les dépôts à vue et à terme des déposants et leur verse des intérêts sur ces dépôts. Le taux indiqué est le taux moyen versé au cours de l'année

² Le revenu produit par les placements du fonds général et des fonds particuliers de la Caisse est versé ou attribué aux déposants détenteurs de dépôts à participation; le taux indiqué est le taux annuel moyen. Ce taux représente uniquement le revenu net ainsi que les gains nets (pertes nettes) réalisés à l'annulation d'unités de participation de portefeuilles spécialisés détenues par les fonds particuliers et il ne tient pas compte des variations de la juste valeur des investissements. Aux fins de ce calcul, les dépôts à participation sont pris au coût. Ce taux se distingue du taux de rendement pondéré par le temps qui se compose à la fois du revenu et de la variation de la juste valeur des placements.

6

SOMMAIRE DES PLACEMENTS
au 31 décembre
(en pourcentage)

| | Coût | Juste valeur ¹ | | | | | | | | | |
|---|-------|---------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | 2016 | 2016 | 2015 | 2014 | 2013 | 2012 | 2011 | 2010 | 2009 | 2008 | 2007 |
| Équivalents de trésorerie | 0,5 | 0,4 | 0,8 | 1,4 | 2,5 | - | - | - | - | - | - |
| Valeurs à court terme | 0,3 | 0,3 | 0,3 | 0,3 | 0,9 | 0,8 | 1,2 | 2,7 | 4,8 | 7,3 | 7,2 |
| Titres achetés en vertu de conventions de revente | 3,7 | 3,1 | 2,2 | 6,0 | 4,1 | 5,4 | 4,3 | 5,5 | 4,8 | 3,1 | 3,4 |
| Créances d'entreprises | 0,9 | 0,8 | 1,1 | 0,7 | 0,6 | - | - | - | - | - | - |
| Obligations | 30,2 | 25,6 | 27,8 | 28,2 | 27,5 | 28,4 | 32,0 | 34,3 | 36,7 | 38,6 | 37,1 |
| BTAA | 1,6 | 1,3 | 1,6 | 3,4 | 4,1 | 4,8 | 4,8 | 5,0 | 4,3 | 3,9 | 4,8 |
| Financements hypothécaires | - | - | - | - | - | 4,3 | 4,1 | 4,3 | 5,3 | 6,5 | 4,7 |
| Titres à revenu fixe | 37,2 | 31,5 | 33,8 | 40,0 | 39,7 | 43,7 | 46,4 | 51,8 | 55,9 | 59,4 | 57,2 |
| Actions canadiennes | 9,2 | 10,8 | 10,4 | 9,5 | 9,1 | 10,9 | 9,5 | 9,8 | 8,8 | 7,2 | 7,9 |
| Actions étrangères | 29,7 | 29,4 | 29,4 | 27,4 | 27,4 | 32,9 | 32,2 | 26,3 | 23,3 | 20,7 | 24,7 |
| Participations dans des filiales non consolidées | 23,9 | 27,9 | 26,0 | 22,6 | 23,0 | - | - | - | - | - | - |
| Biens immobiliers | - | - | - | - | - | 12,5 | 11,9 | 12,1 | 12,0 | 12,7 | 10,2 |
| Titres à revenu variable | 62,8 | 68,1 | 65,8 | 59,5 | 59,5 | 56,3 | 53,6 | 48,2 | 44,1 | 40,6 | 42,8 |
| Instruments financiers dérivés | 0,0 | 0,4 | 0,4 | 0,5 | 0,8 | - | - | - | - | - | - |
| | 100,0 | 100,0 | 100,0 | 100,0 | 100,0 | 100,0 | 100,0 | 100,0 | 100,0 | 100,0 | 100,0 |

¹Certains chiffres ont été reclassés afin de les rendre conformes à la présentation adoptée en 2015 et depuis 2013, les chiffres sont présentés conformément aux normes IFRS.

VENTILATION DES PLACEMENTS
au 31 décembre
(en millions de dollars)

| PLACEMENTS ¹ | Coût | % | Juste valeur | | | | | | | | | |
|--|----------------|-------------|----------------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | 2016 | | 2016 | 2015 | 2014 | 2013 | 2012 | 2011 | 2010 | 2009 | 2008 | 2007 |
| Obligations | | | | | | | | | | | | |
| Titres canadiens | | | | | | | | | | | | |
| Gouvernement du Québec | 16 382 | 6,3 | 16 136 | 19 308 | 17 839 | 14 097 | 10 549 | 9 659 | 8 925 | 7 973 | 9 460 | 8 851 |
| Gouvernement du Canada | 26 114 | 10,1 | 25 927 | 24 339 | 26 720 | 16 492 | 17 255 | 17 249 | 22 445 | 22 205 | 16 944 | 24 261 |
| Autres gouvernements | 4 720 | 1,8 | 4 625 | 4 612 | 3 940 | 2 552 | 1 169 | 1 581 | 1 701 | 3 158 | 3 047 | 2 304 |
| Garantis par le gouvernement du Québec | 4 394 | 1,7 | 4 528 | 5 462 | 5 739 | 5 696 | 7 886 | 7 777 | 6 074 | 5 495 | 5 102 | 5 524 |
| Garantis par les autres gouvernements | 37 | - | 34 | 101 | 113 | 6 453 | 5 321 | 5 279 | 5 924 | 4 987 | 5 989 | 7 787 |
| Municipalités, scolaires et autres | 864 | 0,3 | 942 | 948 | 1 012 | 1 122 | 1 374 | 1 481 | 1 280 | 1 279 | 1 611 | 1 728 |
| Secteur corporatif | 11 016 | 4,3 | 11 410 | 11 970 | 12 400 | 11 067 | 10 236 | 12 320 | 9 850 | 10 941 | 14 710 | 16 554 |
| | 63 527 | 24,5 | 63 602 | 66 740 | 67 763 | 57 479 | 53 790 | 55 346 | 56 199 | 56 038 | 56 863 | 67 009 |
| Titres étrangers | | | | | | | | | | | | |
| Gouvernement des États-Unis | 6 184 | 2,4 | 6 328 | 4 624 | 2 283 | 1 185 | 989 | 1 174 | 1 379 | 510 | 1 706 | 2 416 |
| Secteur corporatif | 7 312 | 2,8 | 7 904 | 7 777 | 4 948 | 3 440 | 5 142 | 2 370 | 3 668 | 4 571 | 8 954 | 10 395 |
| Autres | 1 177 | 0,5 | 1 345 | 672 | 736 | 2 945 | - | 408 | 17 | 346 | 2 902 | 2 929 |
| | 14 673 | 5,7 | 15 577 | 13 073 | 7 967 | 7 570 | 6 131 | 3 952 | 5 064 | 5 427 | 13 562 | 15 740 |
| | 78 200 | 30,2 | 79 179 | 79 813 | 75 730 | 65 049 | 59 921 | 59 298 | 61 263 | 61 465 | 70 425 | 82 749 |
| Créances d'entreprises | | | | | | | | | | | | |
| Titres canadiens | 1 201 | 0,5 | 1 280 | 1 277 | 1 188 | 835 | - | - | - | - | - | - |
| Titres étrangers | 1 192 | 0,4 | 1 212 | 1 727 | 789 | 479 | - | - | - | - | - | - |
| | 2 393 | 0,9 | 2 492 | 3 004 | 1 977 | 1 314 | - | - | - | - | - | - |
| BTAA | 4 057 | 1,6 | 3 970 | 4 612 | 9 236 | 9 752 | 10 153 | 8 932 | 8 942 | 7 249 | 7 186 | 10 740 |
| Actions et valeurs convertibles | | | | | | | | | | | | |
| Titres canadiens | | | | | | | | | | | | |
| Énergie | 6 399 | 2,5 | 6 601 | 4 394 | 4 599 | 4 196 | 4 273 | 3 195 | 3 411 | 3 346 | 2 690 | 3 210 |
| Matériels | 1 516 | 0,6 | 1 640 | 1 214 | 1 508 | 1 358 | 3 464 | 3 201 | 3 998 | 2 791 | 1 811 | 2 137 |
| Industrie | 2 911 | 1,1 | 4 663 | 4 306 | 4 093 | 3 280 | 1 895 | 1 617 | 1 325 | 1 166 | 847 | 1 416 |
| Consommation discrétionnaire | 896 | 0,4 | 1 887 | 2 260 | 2 347 | 2 477 | 3 682 | 3 487 | 3 577 | 2 670 | 2 172 | 3 505 |
| Biens de consommation de base | 1 334 | 0,5 | 2 771 | 2 772 | 2 220 | 1 159 | 747 | 549 | 283 | 257 | 240 | 445 |
| Santé | 100 | - | 79 | 62 | 748 | 563 | 272 | 104 | 123 | 106 | 101 | 218 |
| Finance | 7 880 | 3,1 | 10 150 | 9 359 | 5 339 | 4 108 | 4 165 | 2 682 | 2 007 | 2 042 | 2 853 | 3 285 |
| Technologies de l'information | 1 525 | 0,6 | 4 164 | 4 261 | 3 366 | 2 702 | 2 056 | 728 | 846 | 902 | 623 | 1 014 |
| Télécommunications | 374 | 0,1 | 438 | 390 | 388 | 472 | 636 | 250 | 49 | 232 | 608 | 802 |
| Services aux collectivités | 345 | 0,1 | 404 | 282 | 336 | 329 | 901 | 1 009 | 1 196 | 685 | 629 | 787 |
| Fonds communs | 624 | 0,2 | 670 | 592 | 482 | 714 | 882 | 652 | 599 | 491 | 485 | 681 |
| Participations indicielles et autres | - | - | - | - | - | 101 | 100 | 92 | 32 | 33 | 27 | 7 |
| | 23 904 | 9,2 | 33 467 | 29 892 | 25 426 | 21 459 | 23 073 | 17 566 | 17 446 | 14 721 | 13 086 | 17 507 |
| Titres étrangers | | | | | | | | | | | | |
| Fonds externes | 14 378 | 5,6 | 16 931 | 14 505 | 10 824 | 9 470 | 16 848 | 16 783 | 15 952 | 19 634 | 20 124 | 24 428 |
| Gestion interne | 62 530 | 24,1 | 73 911 | 69 823 | 62 790 | 55 350 | 52 583 | 43 037 | 30 892 | 19 418 | 17 695 | 30 691 |
| | 76 908 | 29,7 | 90 842 | 84 328 | 73 614 | 64 820 | 69 431 | 59 820 | 46 844 | 39 052 | 37 819 | 55 119 |
| | 100 812 | 38,9 | 124 309 | 114 220 | 99 040 | 86 279 | 92 504 | 77 386 | 64 290 | 53 773 | 50 905 | 72 626 |

VENTILATION DES PLACEMENTS (suite)
au 31 décembre
(en millions de dollars)

| PLACEMENTS ¹ | Coût | % | Juste valeur | | | | | | | | | |
|--|----------------|--------------|----------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| | 2016 | | 2016 | 2015 | 2014 | 2013 | 2012 | 2011 | 2010 | 2009 | 2008 | 2007 |
| Participations dans des filiales non consolidées | | | | | | | | | | | | |
| Placements de biens immobiliers | 23 316 | 9,0 | 41 347 | 38 699 | 32 632 | 31 795 | - | - | - | - | - | - |
| Placements de dettes immobilières | 11 223 | 4,3 | 11 559 | 10 982 | 10 249 | 8 797 | - | - | - | - | - | - |
| Placements privés | 10 124 | 3,9 | 13 506 | 9 890 | 8 248 | 7 295 | - | - | - | - | - | - |
| Placements d'infrastructures | 9 533 | 3,7 | 11 500 | 11 103 | 7 369 | 5 437 | - | - | - | - | - | - |
| Autres placements | 7 857 | 3,0 | 8 379 | 3 766 | 2 337 | 980 | - | - | - | - | - | - |
| | 62 053 | 23,9 | 86 291 | 74 440 | 60 835 | 54 304 | - | - | - | - | - | - |
| Financements hypothécaires | | | | | | | | | | | | |
| Titres canadiens | - | - | - | - | - | - | 7 411 | 6 754 | 5 886 | 5 944 | 6 451 | 5 979 |
| Titres étrangers | - | - | - | - | - | - | 1 682 | 780 | 1 833 | 2 872 | 5 349 | 4 490 |
| | - | - | - | - | - | - | 9 093 | 7 534 | 7 719 | 8 816 | 11 800 | 10 469 |
| Biens immobiliers | | | | | | | | | | | | |
| Canadiens | - | - | - | - | - | - | 16 494 | 13 501 | 12 880 | 10 931 | 11 884 | 13 419 |
| Étrangers | - | - | - | - | - | - | 9 966 | 8 670 | 8 732 | 9 142 | 11 219 | 9 318 |
| | - | - | - | - | - | - | 26 460 | 22 171 | 21 612 | 20 073 | 23 103 | 22 737 |
| Total des placements à long terme | 247 515 | 95,5 | 296 241 | 276 089 | 246 818 | 216 698 | 198 131 | 175 321 | 163 826 | 151 376 | 163 419 | 199 321 |
| Équivalents de trésorerie | | | | | | | | | | | | |
| Titres canadiens | 997 | 0,4 | 998 | 2 245 | 3 829 | 5 842 | - | - | - | - | - | - |
| Titres étrangers | 243 | 0,1 | 242 | - | - | 60 | - | - | - | - | - | - |
| | 1 240 | 0,5 | 1 240 | 2 245 | 3 829 | 5 902 | - | - | - | - | - | - |
| Valeurs à court terme | | | | | | | | | | | | |
| Titres canadiens | 665 | 0,3 | 649 | 744 | 634 | 1 494 | 391 | 521 | 2 357 | 4 625 | 5 909 | 9 895 |
| Titres étrangers | 156 | - | 157 | 140 | 167 | 627 | 1 192 | 1 789 | 2 425 | 3 458 | 7 485 | 6 131 |
| | 821 | 0,3 | 806 | 884 | 801 | 2 121 | 1 583 | 2 310 | 4 782 | 8 083 | 13 394 | 16 026 |
| Titres achetés en vertu de conventions de revente | | | | | | | | | | | | |
| Titres canadiens | 5 895 | 2,3 | 5 895 | 2 742 | 10 998 | 5 132 | 8 629 | 6 056 | 8 761 | 6 171 | 2 900 | 2 457 |
| Titres étrangers | 3 609 | 1,4 | 3 597 | 3 700 | 5 064 | 4 582 | 2 754 | 1 919 | 1 007 | 1 945 | 2 780 | 4 993 |
| | 9 504 | 3,7 | 9 492 | 6 442 | 16 062 | 9 714 | 11 383 | 7 975 | 9 768 | 8 116 | 5 680 | 7 450 |
| Instruments financiers dérivés | | | | | | | | | | | | |
| Titres canadiens | 3 | - | 4 | 150 | 353 | 1 329 | - | - | - | - | - | - |
| Titres étrangers | 34 | - | 1 092 | 1 035 | 941 | 644 | - | - | - | - | - | - |
| | 37 | - | 1 096 | 1 185 | 1 294 | 1 973 | - | - | - | - | - | - |
| Total des placements à court terme | 11 602 | 4,5 | 12 634 | 10 756 | 21 986 | 19 710 | 12 966 | 10 285 | 14 550 | 16 199 | 19 074 | 23 476 |
| Total | 259 117 | 100,0 | 308 875 | 286 845 | 268 804 | 236 408 | 211 097 | 185 606 | 178 376 | 167 575 | 182 493 | 222 797 |
| Répartition des placements à long terme | | | | | | | | | | | | |
| Secteur public | 59 872 | 24,2 | 59 865 | 60 066 | 58 382 | 50 542 | 44 558 | 44 608 | 47 745 | 45 953 | 46 943 | 55 800 |
| Secteur privé | 187 643 | 75,8 | 236 376 | 216 023 | 188 436 | 166 156 | 153 573 | 130 713 | 116 081 | 105 423 | 116 476 | 143 521 |
| Total | 247 515 | 100,0 | 296 241 | 276 089 | 246 818 | 216 698 | 198 131 | 175 321 | 163 826 | 151 376 | 163 419 | 199 321 |

¹Certains chiffres ont été reclassés afin de les rendre conformes à la présentation adoptée en 2015 et depuis 2013, les chiffres sont présentés conformément aux normes IFRS.

| EMPRUNTEURS | ADRESSES | LIEU |
|--|---|-----------------|
| OTÉRA CAPITAL | | |
| 0697788 B.C. Ltd., Onni Triangle Development Limited Partnership | 2125, Hawkins Street | Port Coquitlam |
| 0790792 B.C. Ltd., RPMG Holdings Ltd. | 19 100, Airport Way | Pitt Meadows |
| 0810968 B.C. Ltd., RPMG Holdings Ltd. | 19 055, Airport Way | Pitt Meadows |
| 0974971 B.C. Ltd. | 527, Carnarvon Street | New Westminster |
| 10 Dundas Street Ltd. | 10, Dundas Street East | Toronto |
| 100 Parkway Forest Drive Limited Partnership | 100, Parkway Forest Drive | Toronto |
| 101 West Hastings Holding Ltd. | 111, West Hastings Street; 351, Abbott Street | Vancouver |
| 1010532 B.C. Ltd., Marcon Yukon Homes (GP) Ltd. | 7926-7992, Yukon Street | Vancouver |
| 110 Parkway Forest Drive Limited Partnership | 110, Parkway Forest Drive | Toronto |
| 1100 Burloak Nominee Inc. | 1100, Burloak Drive | Burlington |
| 1204225 Alberta Ltd. | 184th Street; 107th Avenue | Edmonton |
| 121733 Canada Inc., 125748 Canada Inc., 125749 Canada Inc., 9064-2687 Québec Inc. | 416, Maisonneuve Ouest | Montréal |
| 130 Bloor CREIF Inc. | 130, Bloor Street West | Toronto |
| 145 Richmond Street West Limited Partnership, KWMC Toronto Inc. | 145, Richmond Street West | Toronto |
| 1519958 Ontario Ltd. | 1215-1255, McCowan Road | Toronto |
| 152523 Canada inc., Fonds de placement immobilier Cominar | 3103, boul. Royal | Shawinigan |
| 1562903 Ontario Ltd. | 2305, McPhillips Street | Winnipeg |
| 160 Elgin Portfolio Inc. | 160, Elgin Street | Ottawa |
| 171518 Canada Inc., 8724725 Canada Inc., Samuel Drazin, Shulamit S. Drazin, Tamara Drazin, Édifice 500 René-Lévesque Ouest Inc., Georges S. Gantcheff, Rosdev Hotel Management Services Inc. | 500, boul. René-Lévesque Ouest | Montréal |
| 171518 Canada Inc., Édifice 500 Grande Allée Est Inc., Samuel Drazin, Shulamit S. Drazin, Tamara Drazin, Georges S. Gantcheff, Jennifer Gilgan, Simon Margel, Michael Rosenberg | 500, Grande-Allée Est; 425-475, St-Amable | Québec |
| 1750548 Alberta Ltd. | 109, McLaughlin Drive | Spruce Grove |
| 180 University Holdings Inc. | 188, University Avenue | Toronto |
| 1899038 Ontario Inc. | 95, 115, King Street South | Waterloo |
| 215 Holdings Ltd. | 215, Garry Street | Winnipeg |
| 2200-41 Ane Property Ltd. | 2200, 41st Avenue North East | Calgary |
| 2250584 Ontario Inc., Morguard Holdings PI Ltd. | 2311, 2341, 2355, boul. Alfred-Nobel | Saint-Laurent |
| 2426-5233 Québec inc., 9136-3549 Québec inc., Les Investissements Immobiliers Mirelis Inc., Société d'Investissement Kesmat Inc. | 1134-1140, rue Ste-Catherine Ouest | Montréal |
| 299 Burrard Management Ltd. | 1011, West Cordova Street; 1038, Canada Place Way | Vancouver |
| 30 Adelaide Street East Limited Partnership, 30 Adelaide Street East Inc. | 30, Adelaide Street East | Toronto |
| 310 Donald Inc. | 311, Portage Avenue | Winnipeg |
| 322-326 11th Avenue SW Inc. | 322-326, 11th Avenue South West | Calgary |
| 333 and 339 King Street North (ARI) Ltd., CHC Student Housing Luxe Inc. | 333, 339, King Street North | Waterloo |
| 3500 St. Laurent Boulevard Inc., 480 Boulevard St-Laurent Inc., 740 Saint-Maurice Street Inc., 8 Du Commerce Square Inc., Allied Properties Real Estate Investment Trust | 480, 3500- 3510, boul. Saint-Laurent; 8, Place du Commerce; 740, rue St-Maurice | Montréal |
| 365 Bay Street Inc., Montez Office Fund 1 Holdco Inc. | 365, Bay Street | Toronto |
| 50 Willowdale Holdings Inc., Georges S. Gantcheff | 50, Willowdale Avenue | Outremont |
| 500 Georgia Office Partnership | 510, West Georgia | Vancouver |
| 511049 BC Ltd. | 1567-1577, Lonsdale Avenue | Vancouver |

SECTEUR IMMOBILIER
FINANCEMENTS DE 5 M\$ ET PLUS
au 31 décembre 2016

| EMPRUNTEURS | ADRESSES | LIEU |
|--|--|---|
| 5420 NSR Nominee Inc. | 5420, North Service Road | Burlington |
| 5505 Boulevard Saint-Laurent Inc., Allied Properties Real Estate Investment Trust | 5505, boul. Saint-Laurent | Montréal |
| 5515 NSR Nominee Inc. | 5515, North Service Road | Burlington |
| 555 René GP Inc., 7761007 Canada Inc., 7929579 Canada Inc., Complexe 555 RLO S.E.C., agissant par son commandité 7929579 Canada Inc. | 555, René-Lévesque West blvd. | Montréal |
| 5575 NSR Nominee Inc. | 5575, North Service Road | Burlington |
| 592 Sherbourne LP | 592, Sherbourne Steet | Toronto |
| 6331017 Manitoba Ltd. | 380, Sophia Street | Selkirk |
| 6730574 Canada Inc., Dream Industrial LP | 8000, Avenue Blaise-Pascal | Montréal |
| 6930221 Canada Inc. | 400, avenue Kensington | Westmount |
| 6979530 Canada Inc. | 2344, boul. Alfred-Nobel | Saint-Laurent |
| 6979611 Canada Inc. | 22, Eddy Street | Gatineau |
| 6979637 Canada Inc. | 455, boul. de la Carrière | Gatineau |
| 7167 Progress Way Delta Holdings Inc., Concert Real Estate Corporation | 7167, Progress Way | Delta |
| 760 Grand Bernier Inc., Fiera Properties Core Fund LP | 760, ch. du Grand Bernier Nord | Saint-Jean-sur-Richelieu |
| 7838816 Canada Inc., Intergulf-Cidex Development (XII) Corp. | 1112, 9th Street South West | Calgary |
| 8104441 Canada Inc., 8104450 Canada Inc., 8104468 Canada Inc., 8174709 Canada Inc. | 100- 400, Consilium Place | Toronto |
| 812924 Ontario Limited, Savoy Residences Ltd. | 130, Old Forest Hill Road; 777, Eglinton Avenue West | Toronto |
| 8264635 Canada Inc., Carrefour Langelier S.E.N.C., Carrefour Langelier Inc., Columbia-Wertek Inc., Mazel Inc. | 7225, 7265, 7275, 7325, 7335, 7373, 7445, boul. Langelier | Anjou |
| 9034-3484 Québec Inc. | 1221, boulevard René-Lévesque Ouest | Montréal |
| 9045-4737 Québec inc. | 20, boul. Bouthillier Ouest | Rosemère |
| 9070-8058 Québec Inc. | 1255-1259, Berri | Montréal |
| 9097-0286 Québec Inc., 9164-3064 Québec Inc., Immeubles Régime VIII Inc. | 725, St-Joseph Est | Québec |
| 9103-1013 Québec inc., Dundee Canada 700 Montréal Limited Partnership | 700, rue de La Gauchetière Ouest | Montréal |
| 9103-4975 Québec inc. | 800, 850, boul. de Maisonneuve Est | Montréal |
| 9103-4983 Québec inc. | 888, boul. De Maisonneuve Est | Montréal |
| 9145-0577 Québec Inc., 9145-0627 Québec Inc., 9145-0692 Québec Inc., 9145-0718 Québec Inc., 9145-0726 Québec Inc., 9145-0742 Québec Inc., 9145-0767 Québec Inc., Canada Lac-St-Jean Trust, Kimwood Lac Saint-Jean Holdings ULC | 39, Montée Sandy Beach; 555, 655, 705, avenue du Pont Nord; 1221, boul. Marcotte; 1212, boul. Talbot; 3460, boul. Saint-François; 500, 550, rue Daigneault; 1324, boul. Talbot | Gaspé, Alma, Roberval, Chicoutimi, Jonquière, Chandler |
| 9150-6394 Quebec Inc. | 1313, Autoroute Chomedey | Laval |
| 9170-4767 Québec Inc. | 375, de la Concorde | Montréal |
| 9170-4767 Québec Inc., 9287-0245 Québec Inc. | 380, rue Sherbrooke Ouest | Montréal |
| 9177-2541 Québec Inc. | 380, boul. René-Levesque Ouest | Montréal |
| 9180-6851 Québec Inc. | 4635, 1ère Avenue; 1400, rue St-Jean Baptiste; 1730, 1750, 1790, av. Newton; 1990, Cyrille- Duquet ; 2006- 2010, rue Lavoisier; 201- 211, rue Laurier Est; 2022, rue Lavoisier; 2200, rue Cyrille-Duquet; 2385, rue Watt; 2800, 2900- 2976, boul. Joseph-Armand-Bombardier; 2800, boul. St-Jean-Baptiste; 3175, ch. Quatre-Bourgeois; 625- 673, av. Godin; 9101- 9175, boul. des Sciences; 450, avenue St-Jean Baptiste; 1405- 1475, 55e Avenue; 1540, rue Cyrille-Duquet; 1670, rue Sempé; 2100, rue Cyrille-Duquet; 2500, 2600, 2700, rue Jean-Perrin; 50, route Président Kennedy; 500, avenue Saint-Jean-Baptiste; 9100, rue du Parcours, 955 avenue Saint-Jean-Baptiste | Québec, Sainte-Foy, Montréal, Laval, Charlesbourg, Vanier, Anjou, Dorval, Lévis |
| 9224-2239 Québec Inc., Investissements immobiliers CRDIX30 S.E.C., Corporation Immobilière Omers, Société en commandite BB | 9090-9200, 9170, boul. Leduc | Brossard |

SECTEUR IMMOBILIER
FINANCEMENTS DE 5 M\$ ET PLUS
au 31 décembre 2016

| EMPRUNTEURS | ADRESSES | LIEU |
|--|---|-----------------------|
| 9243763 Canada Inc., Les Commerants Sar Ltée., Sar Trading Ltd., Les Entreprises Dufree Ltée., Dufree Entreprises Ltd., Fredmar-Darick Canada Inc. | 352-392, rue Ste-Catherine Ouest | Montréal |
| 9301-3902 Québec Inc. | 1400, boul. Rene-levesque O | Montréal |
| 9309-3201 Québec Inc., Le Teasdale Résidence pour retraités Inc. | 950, boul. Lucille Teasdale | Terrebonne |
| 9318470 Canada Inc. | 903, 8th Avenue South West | Calgary |
| 9333-2674 Québec Inc., Le Prescott Résidence pour Retraités S.E.C. | rue Phil-Goyette | Vaudreuil-Dorion |
| 939 GP Inc. | 939, Eglinton Avenue East | Toronto |
| 9650458 Canada Inc., Centurian Markham ULC, Redbourne Investments Limited Partnership | 625, Cochrane; 60, Columbia | Markham |
| AIMCO Realty Investors LP, BOPC_COF_LP, CPP Investment Board Real Estate Holdings Inc. | 112, Kent Street | Ottawa |
| Allied Properties Real Estate Investment Trust, CDM de Montréal inc. | 50-80, Queen Street; 700, Wellington Street; 87, Prince Street; 11, Duke | Montréal |
| Aménagement Westcliff Ltée. | 40, rue Evangeline | Granby |
| Amexon Properties Inc. | 480, University Avenue | Toronto |
| Amexon Real Estate Investment Syndicate Inc. | 1000, Finch Avenue West | Toronto |
| Amexon Realty Inc. | 701, 703, Evans Avenue | Toronto |
| Anthem 16434 Fraser Developments Ltd. | 16434, Fraser Highway | Surrey |
| Anthem East 2nd Developments Ltd. | 504-538 East 2nd Street | North Vancouver |
| Aqualina Bayside Toronto Inc. | Bayside Site | Toronto |
| Artis Concorde Ltd. | 1-3, Concorde Gate; 12 Concorde Place | Toronto |
| Artis Four Valley Drive Ltd. | 199, Four Valley Drive | Vaughan |
| Artis Meadowvale Gateway Ltd. | 400-450, Matheson Blvd. East; 5100, Timberlea Blvd.; 6616, 6700, 6760, Campobello Road | Mississauga |
| Aspen Landing Shopping Centre LP | 1600, 85th Street South West | Calgary |
| Balmain Hotel Group LP | 26- 36, Mercer Street | Toronto |
| Baxter Lancaster Nominee Inc. | 2615, 2620- 2650, Lancaster Road; 1050- 1051, Baxter Road | Ottawa |
| Bayshore Shopping Centre Limited, Ivanhoé Cambridge II inc., KingSett Canadian Real Estate Income Fund LP, KS Bayshore Inc. | 100, Bayshore Drive | Ottawa |
| Birchwood Riley Park Inc. | 5th Avenue NW | Calgary |
| Bloor CT Acquisition Inc., Bloor CT Aquisition LP | 2, Bloor Street West | Toronto |
| Bond Head Properties Inc. | East and west side of the Highway 400 and north south of Highway 88; North-west of Highway 27 and Country Road 88 | Bradford |
| Brentwood Towncentre Limited Partnership, Shape Properties (Brentwood) Corp. | 4567, 4545, Lougheed Highway | Burnaby |
| Brookfield Office Properties Canada LP | 333, Bay Street | Toronto |
| Cal-Ed Jasper Holdings Limited | 10 405, Jasper Avenue North West | Edmonton |
| Calgary Hotel Holdings (Alberta) Limited Partnership | 711, 4th Street SE | Calgary |
| Cambridge Retirement Residence General Partnership, Cambridge Retirement Group Ltd. | 208, Hespeler Road | Cambridge |
| Cameron Corporation, Canadian Property Holdings (Alberta) Inc. | 10 141, 13th Avenue North West | Edmonton |
| Canada-Les Halles Holdings ULC | 7500, boul. des Galeries d'Anjou | Anjou |
| Canadian Property Holding Inc. | 1185, West Georgia Street; 6080, Young Street | Vancouver, Halifax |
| Canadian Property Holdings (Alberta) Inc. | 112, 140, 144, 4th Avenue South West | Calgary |
| Canadian Property Holdings (Nova Scotia) Inc., Canada Mortgage and Housing Corporation | 95, 99, Wyse Road | Dartmouth |
| Canadian Tire Properties Inc. | 2360, Parkedale Avenue; 24 624, Adelaide Road | Brockville, Strathroy |
| Carrera Management Corporation, Clydco Holdings Ltd., Mews Holdings Ltd., North Bellevue Holdings Ltd. | 1503- 1507, Bellevue Avenue; 1431, 1437, Clyde Avenue | Vancouver |
| Catarqui Holdings Inc. | 945, Gardiners Road | Kingston |

SECTEUR IMMOBILIER
FINANCEMENTS DE 5 M\$ ET PLUS
au 31 décembre 2016

| EMPRUNTEURS | ADRESSES | LIEU |
|---|--|---|
| CBS Property Holdings Inc., Gestion Plaza Z-Corp. Limitée, Les Développements Plaza DM (2006) Inc., Sydney River Investments Ltd., TC Land Holdings Corp. | 2500, boul. des Promenades; 5490- 5580, boul. Jean XXIII; 1170, Kings Road; 250, Airport Blvd.; 641, King Street | Deux-Montagnes, Trois-Rivières, Sydney River, Gander, Gananoque Fort McMurray Côte-Saint-Luc Rouyn-Noranda Montréal |
| CDM Properties Ltd. | 242, Powder Drive | |
| Centre Commercial Cavendish Cie Ltée. | 5800, boul. Cavendish | |
| Centre Commercial Plaza LPC (2002) Inc. | 100, rue du Terminus | |
| Centre Ice Developments Limited Partnership, L'Avenue Condominiums sur l'Avenue des Canadiens-de-Montréal | Avenue des Canadiens; rue de la Montagne | |
| Centre Régional Châteauguay Inc. | 200, boul. d'Anjou | Châteauguay |
| Cobourg Retirement Group Ltd. | 255, Densmore Road | Cobourg |
| Cominar NB Real Estate Holdings Inc., Cominar NS Real Estate Holdings Inc. | 115, 125, Whiting Road; 420, 440, 749, Wilsey Road; 120- 140, Commerce Street; 1149, Smythe Road; 65, Regent Street; 50- 70, MacNaughton; 520, Edinburgh; 1199, St-George Blvd.; 330- 350, Elmwood Drive; 699, Champlain Street; 612, Windmill Road; 229- 231, boul. JD Gauthier | Moncton, Fredericton, Dieppe, Dartmouth, Shippagan |
| Cominar ON Real Estate Holdings Inc. | 95-105, Moatfield Drive; 225, Duncan | Toronto |
| Commercial Properties Ltd. | 633, Main Street | Moncton |
| Complexe Jules Dallaire Inc., Société en commandite CJD | 2820- 2828, boul. Laurier | Québec |
| Complexe L.L. Phase I, S.E.C. | 4805, boul. Lapinière | Brossard |
| Complexe Pointe-Claire GM S.E.C. | 5000, Autoroute Transcanadienne | Pointe-Claire |
| Complexe St-Charles S.E.N.C. | 1111, rue St-Charles Ouest | Longueuil |
| Continuum REIT GP Inc., Continuum REIT LP | 35, Tobermory Drive; 2450- 2460, Weston Road | Toronto |
| Corporation Immobilière CAGIM | 1170, boul. Lebourgneuf | Québec |
| CR3 1500 Don Mills Inc. | 1500, Don Mills Road | Toronto |
| Crombie Developments Limited | 10 907, 82nd (Whyte) Avenue North West | Edmonton |
| Crombie Limited Partnership | 1894, 1990, 2000, Barrington Street; 2021, Brunswick Street; 5201, 5202, 5251, Duke Street; 1508, Upper James Street | Halifax, Hamilton |
| Crombie Property Holdings II Limited | 215, Park Avenue West | Chatham |
| Crombie Property Holdings Limited | 1100, 1110, 1120, 1140, 1150, 1160, Carp Road; 19, Riedel Street | Stittsville, Ottawa, Fort McMurray |
| CSH-HCN (Avondale) Inc. | 1238, Queen Street East | Toronto |
| Daniels CCW Corporation | Prince of Wales and Living Arts Drive; Confederation Parkway and City Centre Drive | Mississauga |
| DAT 2261 Keating Cross Road LP, Whiterock 2261 Keating Cross Road Victoria Inc., Whiterock 2261 Keating Cross Road LP | 2261, Keating Cross Road | Victoria |
| DAT 2810 Matheson Boulevard LP, Whiterock 2810 Matheson Boulevard Mississauga Inc., Whiterock 2810 Matheson Boulevard LP | 2810, Matheson Boulevard East | Mississauga |
| DAT 300, 302 & 304 The East Mall LP, Whiterock 300, 302 & 304 The East Mall Toronto Inc., Whiterock 300, 302 & 304 The East Mall LP | 300, 302, 304, The East Mall | Toronto |
| Développement Trans-Edmond Inc. | 16 750, route Transcanadienne | Kirkland |
| Développements Immobiliers Commerces Séville Inc., Société en commandite Les Commerces Le Séville | 2153, 2163, 2173, 2183, rue Ste-Catherine | Montréal |
| Dovercourt 455 Inc. | 455, Dovercourt Road | Toronto |
| Dream Industrial (GP) Inc., Dundee 2340 St-Laurent Inc. | 2340, boul. St-Laurent | Ottawa |
| Dundeal Canada West (GP) Inc., Dundeal Canada (West) Limited Partnership | 5102, 5201, 50th Avenue; 4920, 52nd Street | Yellowknife |
| EAD First Street Building Corp. | 104 Avenue North West; 101 Street North West | Edmonton |
| EAD Property Holdings (102) Corp., EAD Property Holdings (103) Corp. | 103 Avenue North West; 101 Street North West | Edmonton |

SECTEUR IMMOBILIER
FINANCEMENTS DE 5 M\$ ET PLUS
au 31 décembre 2016

| EMPRUNTEURS | ADRESSES | LIEU |
|---|---|----------------------------------|
| EC Developments IV (B2) Limited Partnership, EC Developments IV (B3) Limited Partnership, EC Developments IV Limited Partnership, Emerald City Developments IV inc., Emerald City Developments IV (B2) Inc., Emerald City Developments IV (B3) Inc. | Parkway Forest Complex | Toronto |
| Édifce 500 René-Lévesque Ouest Inc. | 500, boul. René-Lévesque Ouest | Montréal |
| Édifce Les Façades Inc. | 400, boul. Jean-Lesage | Québec |
| Édifce Sandvar Ltée. | 502- 510, rue Ste-Catherine Est | Montréal |
| Empire Communities (2183 Lakeshore Blvd.), L.P., Empire Communities (2183 Lakeshore Blvd.) Ltd. | 2183, Lakeshore Boulevard | Etobicoke |
| EP Victoria Square Manors Ltd. | 10 975, 10 925, 10 945, Woodbine Avenue | Markham |
| Faubourg des Francs Inc., Faubourg des Francs S.E.C. | Rue des Francs Bourgeois | Boisbriand |
| Fiducie Immeubles Centre Lachenaie, Immeubles Centre Lachenaie Inc. | 1115- 1181, Montée des Pionniers | Terrebonne |
| First Capital ProMed (Meadowlark) Inc. | 8713, 156th Street North West | Edmonton |
| First Gulf King Street Inc., Sun Life Assurance Company of Canada (Toronto) | 333, King Street East | Toronto |
| Fonds de placement immobilier Cominar | 5100, rue Sherbrooke Est; 4225, boul. des Forges; 2600, 2590, 2640, boul. Laurier | Montréal, Trois-Rivières, Québec |
| Fonds de placement immobilier Cominar, Cominar Rive Nord Inc. | 100, boul. Brien | Repentigny |
| Fonds de placement immobilier Cominar, Homburg Trust (189) | 3400, 3500, 4000, boul. de Maisonneuve Ouest; 1500, avenue Atwater; 4045-4049, rue Sainte-Catherine Ouest | Westmount |
| Front and Sherbourne Limited Partnership, Sentinel (Sherbourne) land Coporation | 15-21, Lower Sherbourne Street | Toronto |
| Germain Residences Ltd., Grenville-Germain Calgary Limited Partnership | 899, Centre Street South West; 112, 9th Avenue South West | Calgary |
| Gestion 500 Place d'Armes Inc. | 500, Place d'Armes | Montréal |
| Gestion Golden Square Mile Inc., Golden Trust, R.C.M. Hôtel Inc., Sherbrooke Canada Trust, The HIG Settlement, Torriani Property Trust | 1228, 1279, 1290, rue Sherbrooke Ouest | Montréal |
| Gillin Engineering and Construction Limited | 141, Laurier Avenue West | Ottawa |
| Glenwood Brant Holdings Inc. | 1220, 1250, Brant Street | Burlington |
| GM Développement inc., Le Hub Techno-culture Inc. | 510- 560, boul. Charest Est | Québec |
| Harbour Plaza Residences Inc. | 88-100, Harbour Street | Toronto |
| Heritage York Holdings Inc. | 1210-1220, Sheppard Avenue East | Toronto |
| Hillcrest Holdings Inc., Montez Hillcrest Inc. | 9350, Yonge Street | Richmond Hill |
| Hopewell (HDPII) Developments Inc. | 6825, 68th Street South East | Calgary |
| Immeubles Marché St-Joseph-du-Lac inc. | 3741- 3773, chemin d'Oka | St-Joseph-du-Lac |
| Immeubles Marché St-Léonard Inc. | 5915- 5993, rue Bélanger | Saint-Léonard |
| Immo Cote Vertu I Ltd. | 395, 415, boul. Côte-Vertu; 1105, boul. Jules-Poitras; 370, boul. Thompson | Montréal |
| Immo Côte Vertu II Ltd. | 325, 365, boul. Côte-Vertu; 320, 360, boul. Thompson | Montréal |
| Immobilier DQ Inc./DQ Realty Inc. | 3050, Matte | Brossard |
| Intracorp 62West (Nominee 2) Ltd., Intracorp 62West (Nominee 3) Ltd., Intracorp 62West Project (Nominee) Ltd., Intracorp 62West Limited Partnership | 212, 282, 62nd Avenue; 7825, Manitoba Street | Vancouver |
| Jackes (ARH) Developments Ltd. | 1331, Yonge Street | Toronto |
| Kanco Mayfair Manor Ltd. | 407, 5th Avenue South East | Medicine Hat |
| Killam Kamres (Kanata Lakes) I Inc. | 1175, Maritime Way | Kanata |
| Killam Kamres (Silver Spear) Inc. | 1355, Silver Spear Road | Mississauga |
| KingSett Canadian Real Estate Income Fund LP | 201, 1st Avenue South | Saskatoon |
| Larco Investments Ltd. | 4295, Blackcomb Way | Whistler |
| Les Associés 630 René-Lévesque S.E.C., 630 René-Lévesque West Property Co., 630 René-Lévesque W. Real Estate Investment Trust, The Montreal Blue Trust | 630, boul. René-Lévesque Ouest | Montréal |

SECTEUR IMMOBILIER
FINANCEMENTS DE 5 M\$ ET PLUS
au 31 décembre 2016

| EMPRUNTEURS | ADRESSES | LIEU |
|---|---|---|
| Les Galeries Montmagny (1988) inc. | 81- 91, 101, boul. Taché Ouest | Montmagny |
| Les Immeubles 950 Paul Kane Inc. | 950, Paul-Kane | Laval |
| Les Immeubles BPK Lévis Inc. | 63-65, rue Président-Kennedy | Lévis |
| London City Centre London Inc. | 380, Wellington; 275, Dundas Street | London |
| Meadowvale Holdings Limited | 6880, Financial Drive | Mississauga |
| Metcalfe Realty Company Limited | 700, Industrial Avenue | Ottawa |
| Metrus Properties II Inc., Metrus (Terra) Properties Inc. | 131, Caldari Rd | Vaughan |
| Midnapore Property Investments Inc. | 10 404, Jasper Avenue North West | Edmonton |
| Millennium Hotel Holdings Corp. | 788, Richards Street | Vancouver |
| ML Matheson Realty Investments Inc. | 115- 135, Matheson Blvd. West | Mississauga |
| Montez Core Income Fund Limited Parnership, Place d'Orleans Holdings Inc., PRR Trust | 110, Place d'Orléans; 3013, 3025, St-Joseph Blvd. | Ottawa |
| Newcorp Properties Ltd., Newcorp Properties Partnership | 81, Golden Drive | Coquitlam |
| Newvest Realty Corporation | 105, Rue de l'Hotel-de-Ville | Gatineau |
| Northland Properties Corporation | 1755, West Broadway | Vancouver |
| Ocean Walk Properties Ltd. | 1860, 1868, 1892, Marine Drive | West Vancouver |
| Old Oak Downtown Inc. | 150, Dufferin Avenue | London |
| Old Oak Downtown Inc., Old Oak Properties Inc., Summit Properties Inc. | 465, Richmond Street; 140,142,148, Fullarton Street | London |
| Old Oak Properties Inc. | 885, Southdale Road West; 905, Southdale Road West; 365-385, Sugarcreek Trail | London |
| Olymbec Development Inc. | 1450- 1470, boul. Louvain Ouest; 1505- 1525, rue Mazurette; 4580- 4610, rue Hickmore; 5600- 5620, rue Notre-Dame; 5623- 5651, rue Ferrier; 6355- 6395, rue Sherbrooke Est; 6635- 6667, ch. Côte-de-Liesse; 9450- 9490, boul. de l'Acadie; 1955, ch. Côte-de-Liesse; 200- 300, boul. Stinson; 2700, rue Alphonse-Gariépy; 8509- 8515, Place Devonshire; 15- 135, 155- 225, boul. Montpellier; 700, boul. Lebeau; 100-190, 200-290 rue Voyageur; 131-141, Labrosse; 135, rue Royale; 15-55, des Forges; 1555-1605, rue Louvain Ouest; 210-222, boul. Brunswick; 230, King Street West; 2315, rue de la Province; 2365- 2385, ch. Saint-François; 3000, rue Cartier; 3140-3260, rue du Chanoine-Chamberland; 35, rue du Robineault; 3540-3600, rue Griffith; 39-47, Hymus; 495-505, rue Montpellier; 5580-5584, 6400, ch. Côte-de-Liesse; 585-599, rue Iberville; 6300, route Transcanadienne; 649-655, rue Hodge; 6767- 6783, boul. Léger; 7175, rue Marion; 720-740, rue Galt Ouest; 889, Montée-de-Liesse; 2100 52e Avenue; 340-380, 341-371, 392-416, 418-438 rue Isabey; 6150-6250, 6362-6434, 6500 route Transcanadienne | Montréal, St-Laurent, Mont-Royal, Lachine, Pointe-Claire, Trois-Rivières, Sherbrooke, Longueuil, Dorval, Saint-Hyacinthe, Salaberry-de-Valleyfield, Repentigny, Montréal-Nord |
| Olymbec Development Inc., Olymbec Group Limited Partnership | 555, boul. Ste-Adèle; 10 500, Colbert; 5700, rue Paré; 1100- 1150, croissant Claire; 1406- 1410, rue St-Amour; 2225- 2231, boul. Hymus; 6749-6789 Place Pascal Gagnon; 8148- 8190, rue Devonshire; 8489- 8491, rue Ernest Cormier | Sainte-Adèle, Montréal, Lachine, St-Laurent, Dorval, Mont-Royal |
| Omers Realty Corporation | 109, Street & Kingsway Avenue | Edmonton |
| Onni (Westlake) Lands Corp. | 10, Park Lawn Road | Toronto |
| Onni Development (Main Street) Corp., RPMG Holdings Ltd. | 1611, Main Street | Vancouver |
| Onni Holdings Ltd. | 91, Golden Drive | Coquitlam |
| Palicor inc. | 11 025- 11 075, boul. L.H. Lafontaine; 7655- 7675, rue Larrey | Anjou |
| Park Avenue Furniture Corporation | 5811, 46th Street South East | Calgary |
| Parkside Townhomes Inc. | 402, Manek Road | Saskatoon |
| PDG Tsawwassen Holdings Ltd., Tsawwassen Development Power Centre Limited Partnership | North of Tsawwassen Mills | Tsawwassen |
| Pensionfund Realty Limited | 2929, Barnet Highway | Coquitlam |

SECTEUR IMMOBILIER
FINANCEMENTS DE 5 M\$ ET PLUS
au 31 décembre 2016

| EMPRUNTEURS | ADRESSES | LIEU |
|---|--|----------------------------------|
| PIRET (Burlington) Holdings Inc., PIRET (Mississauga) Holdings Inc. | 1020, Lorimar Drive; 375- 425, Britannia Road East; 1070, 1100, Midway Blvd.; 1219, Corporate; 199, Traders Blvd. East; 3450, Harvester Road; 7115, Tomken Road; 7600, Danbro Crescent | Mississauga, Burlington |
| PIRET (GTA North) Holdings Inc. | 525, 625, 701, 750-770, 891, 951, Rowntree Dairy Road; 20, 21, 33, Alex Avenue; 83, Strada Drive; 39, 75, 135, Haist Avenue | Vaughan |
| Place du Royaume Inc., Place du Royaume Limited Partnership | 140, boul. Talbot | Saguenay |
| Plaza 1000 Ltd. | 1000, 7th Avenue South West | Calgary |
| Progeres Inc. | 250, Clarke Avenue | Westmount |
| W9/PBI Realty Company, West/PBI Incorporated, Bonaventure LP, 3102445 Nova Scotia Ltd. | 800, de la Gauchetière Ouest | Montréal |
| Queen's Quay (BOPC) Inc. | 207, Queens Quay West | Toronto |
| Redbourne Erindale Properties III Limited Partnership, Redbourne Erindale Properties II Inc., Redbourne Erindale Properties II Limited Partnership, Redbourne Erindale Properties III Inc. | 1270, 1290, 1300, Central Parkway West | Mississauga |
| Redbourne South Shore Properties Inc., Redbourne South Shore Properties Limited Partnership | 1000, rue de Sérigny | Longueuil |
| Red Roe Developments Limited, Red Roe Developments Limited Partnership | 155, Redpath | Toronto |
| Regina Assisted Group Ltd., Regina Assisted Living Limited Partnership | 2400, Arens Road | Regina |
| Restier Limited Partnership | 66, 80, Mooregate Crescent | Kitchener |
| Richcraft Properties Ltd. | 1350- 1372, Leeds Avenue; 1480, Michael Street; 200, Terence Matthews Crescent; 2239- 2261, 2265- 2287, Gladwin Crescent; 2495, Lancaster Road; 30, Stafford Road; 6, 14, 20, Bexley Place | Ottawa |
| RioCan Holdings Inc. | 815- 845, Eglinton Avenue East | Toronto |
| RioTrin Properties (Vaughan 3) Inc. | 7621, Weston Road | Vaughan |
| Rize Alliance (Gold House) Limited Partnership, Rize Alliance (Gold House) Properties Ltd. | 6383, McKay Avenue; 6288, Cassie Avenue | Burnaby |
| Rosbrand Investments Inc. | 4405, boul. Métropolitain Est | Montréal |
| Royop (Southlands) Development Ltd. | 1941, 1991, Strachan Road South East | Medicine Hat |
| Sifton Properties Ltd. | 241, 255, Queens Avenue | London |
| Simcoe Wellington Residences Inc. | 181, Wellington Street West | Toronto |
| Simon Investments Ltd. | 2860, Trethewey Street | Abbotsford |
| Skyline Real Estate Holdings Inc. | 2, 4, 6, 8, 10, Rue Radisson | Gatineau |
| Snowcat Property Holdings Limited | 2915, 13th Avenue | Regina |
| Société en Commandite Axial, Les Tours Axial Inc. | boul. St-Elzéar | Laval |
| Société en commandite Kau et Associés | 7979, Weston Road; 1501- 1657, boul. des Promenades | Vaughan, Saint-Hubert |
| Société Immobilière GP inc. | 750, avenue du Phare Ouest | Matane |
| Station Lands Ltd. | 10 423, 101st Street North West | Edmonton |
| Summit Holdings (2580 Dollard Avenue) Ltd., Summit Holdings (2695 Dollard Avenue) Ltd., Summit Holdings (300 Labrosse Avenue) Ltd., Summit Holdings (7290 Frederick-Banting) Ltd., Summit Industrial Income Operating Limited Partnership | 2580, 2695, Dollard Avenue; 300, Labrosse Avenue; 7290, Frederick-Banting Street | Lasalle, Pointe-Claire, Montréal |
| Surrey Centre Hotel Limited Partnership, Surrey Centre Office Limited Partnership, Surrey Centre Residential Limited Partnership | 3, Civic Plaza | Surrey |
| T.H.M. Immobilier Inc. | 700, 710, Place d'Youville | Québec |
| TC Core LP, TCR 2008 Equities Inc. | 600, Kingston Road; 1855, Bloor Street | Toronto, Mississauga |
| TC Core LP, TCR 2008 Equities Inc., Timbercreek Opportunity Fund LP #2 | 1867, Bloor Street; 25, Rambler Drive | Mississauga, Brampton |
| The 2015 United Okotoks Land LP | D'Arcy Ranch land | Calgary |
| The Great-West Life Assurance Company, London Life Insurance Company | 530, 8th Avenue South West | Calgary |
| TN Trossacks Ltd. | 1549, 1550, 1554, 1558, 1562, 1566, Trossacks | London |
| Tour de la Bourse SPE inc. | 800, Place Victoria | Montréal |

SECTEUR IMMOBILIER
FINANCEMENTS DE 5 M\$ ET PLUS
au 31 décembre 2016

| EMPRUNTEURS | ADRESSES | LIEU |
|--|---|-------------|
| Valiant Rental Inc. | 705, Kingston Road | Pickering |
| Vaughan West II Ltd. | 500, Zenway Boulevard | Vaughan |
| VC, Société en commandite | 1545, boul. Le Corbusier | Laval |
| Walton Duggan Ranch Development Corporation | Cornerstone (South of Stoney Trail North East and east of Metis Trail North East) | Edmonton |
| WAM Montez C and W Inc. | Church Street and Wellesley Street | Toronto |
| Wellesley Residences Corp. | 50, Wellesley Street East | Toronto |
| Whiterock 1125 50th Avenue Montreal Inc., Whiterock 1125 50th Avenue LP | 1125, 50e Avenue | Lachine |
| Whiterock 401 & 405 The West Mall LP, DAT 401 & 405 The West Mall LP, Whiterock 401 & 405 The West Mall Toronto Inc. | 401- 405, The West Mall | Toronto |
| Whiterock Sussex Centre Mississauga Inc. | 50, 90, Burnhamthorpe Road West | Mississauga |
| Windermere Commercial Lands Ltd. | 5110, Windermere Blvd North West | Edmonton |
| Woodbridge Developments (Mountain View) Ltd. | Mountain View Drive | Surrey |
| Woodstock Retirement Group Ltd. | 511, Finkle Street | Woodstock |
| York Bremner Developments Ltd. | 15, York Street; 75, Bremner Blvd. | Toronto |
| IVANHOÉ CAMBRIDGE | | |
| Oxford Properties Residential LP | 200, Bay Street, Suite 900 | Toronto |
| À l'étranger - États-Unis | | |
| GSG Residential Portfolio LP | 1209, Orange Street | Wilmington |
| À l'étranger - Autres | | |
| Logos New Holding & Investment Company Pty Ltd | Level 29 Aurora Place, 88 Philip St | Sydney |
| Prime London Resi Investments Limited | 65, Duke Street | Londres |

INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES

au 31 décembre 2016

(juste valeur - en millions de dollars)

Notes importantes pour la compréhension du tableau :

Ce tableau comprend les principaux investissements en actions, en obligations et en créances d'entreprises de sociétés cotées de la Caisse ainsi que ceux des investissements sous-jacents de ses filiales non-consolidées. Le contenu de ce tableau est assujéti aux normes de déclaration applicables à la liste annuelle de tels investissements. En plus de ces placements et selon les politiques d'investissement des portefeuilles spécialisés, les gestionnaires ont recours à des instruments financiers dérivés qui procurent un rendement économique sur des titres d'actions, sans pour autant que ces titres soient la propriété de la Caisse.

La liste annuelle ne doit comporter aucune information susceptible de nuire aux opérations de la Caisse, à ses intérêts économiques ou à sa compétitivité, de révéler un projet de transaction, une transaction ou une série de transactions en cours, ou de causer un préjudice à une entreprise. En conséquence, il peut occasionnellement exister des variations entre les investissements présentés dans la liste annuelle et ceux qui sont inscrits aux registres de la Caisse au 31 décembre.

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|--|-------------|-----------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| 3i Group PLC | | 146 041 | 1,7 | | | | 1,7 |
| 3M Co | | 2 556 248 | 612,1 | | | | 612,1 |
| 3SBio Inc | | 2 332 000 | 3,0 | | | | 3,0 |
| 58.com Inc | | 786 466 | 29,5 | | | | 29,5 |
| 5N Plus Inc | | 7 157 050 | 12,8 | | | | 12,8 |
| AAC Technologies Holdings Inc | | 1 196 170 | 14,6 | | | | 14,6 |
| Abax Arhat Fund | | 1 117 | 0,1 | | | | 0,1 |
| ABB Ltd | | 1 411 200 | 40,0 | | | | 40,0 |
| Abbott Laboratories | | 174 610 | 9,0 | | | | 9,0 |
| AbbVie Inc | | 120 680 | 10,1 | | | | 10,1 |
| ABC-Mart Inc | | 13 800 | 1,1 | | | | 1,1 |
| Aberdeen Asset Management PLC | | 334 834 | 1,4 | | | | 1,4 |
| Abertis Infraestructuras SA | | 1 053 272 | 19,8 | | | | 19,8 |
| ABN AMRO Group NV | | 234 340 | 7,0 | | | | 7,0 |
| Aboitiz Equity Ventures Inc | | 5 866 553 | 11,2 | | | | 11,2 |
| Aboitiz Power Corp | | 6 417 050 | 7,2 | | | | 7,2 |
| Abu Dhabi Commercial Bank PJSC | | 6 602 623 | 16,6 | | | | 16,6 |
| ACC Ltd | | 68 893 | 1,8 | | | | 1,8 |
| Accenture PLC | | 216 743 | 34,0 | | | | 34,0 |
| Accor SA | | 89 554 | 4,5 | | | | 4,5 |
| Acer Inc | | 1 141 501 | 0,6 | | | | 0,6 |
| Acom Co Ltd | | 132 100 | 0,8 | | | | 0,8 |
| ACS Actividades de Construccion y Servicios SA | | 344 363 | 14,6 | | | | 14,6 |
| Actelion Ltd | | 12 821 | 3,7 | | | | 3,7 |
| Activision Blizzard Inc | | 155 537 | 7,5 | | 92,6 | | 100,1 |

| | | | |
|---|------------|-------|-------|
| Acuity Brands Inc | 3 400 | 1,1 | 1,1 |
| Adani Ports & Special Economic Zone Ltd | 2 063 360 | 10,9 | 10,9 |
| Adaro Energy Tbk PT | 47 311 091 | 8,0 | 8,0 |
| Adecco Group AG | 102 577 | 9,0 | 9,0 |
| Adidas AG | 71 748 | 15,2 | 15,2 |
| ADM Galleus Fund | 1 301 | 1,7 | 1,7 |
| ADM Galleus Fund II | 126 494 | 9,3 | 9,3 |
| Admiral Group PLC | 4 217 574 | 127,7 | 127,7 |
| Adobe Systems Inc | 52 348 | 7,2 | 7,2 |
| ADTRAN Inc | 337 674 | 10,1 | 10,1 |
| Advance Auto Parts Inc | 13 287 | 3,0 | 3,0 |
| Advanced Info Service PCL | 3 951 061 | 21,8 | 21,8 |
| Advanced Semiconductor Engineering Inc | 3 723 419 | 5,1 | 5,1 |
| Advantech Co Ltd | 1 037 774 | 11,0 | 11,0 |
| Aegis Logistics Ltd | 3 000 000 | 7,6 | 7,6 |
| Aegon NV | 1 642 454 | 12,1 | 12,1 |
| Aena SA | 96 616 | 17,7 | 17,7 |
| Aeon Co Ltd | 3 407 | 0,1 | 0,1 |
| AEON Financial Service Co Ltd | 37 377 | 0,9 | 0,9 |
| Aeon Mall Co Ltd | 49 810 | 0,9 | 0,9 |
| AerCap Holdings NV | 113 899 | 6,4 | 6,4 |
| Aéroports de Paris | 61 099 | 8,8 | 8,8 |
| AES Corporation | 1 074 990 | 16,8 | 16,8 |
| AES Gener SA | 11 515 869 | 5,5 | 5,5 |
| AES Tiete Energia SA | 277 841 | 1,6 | 1,6 |
| Aetna Inc | 154 627 | 25,7 | 25,7 |
| Affiliated Managers Group Inc | 5 489 | 1,1 | 1,1 |
| Aflac Inc | 14 162 | 1,3 | 1,3 |
| African Bank Investments Ltd | 3 683 110 | - | - |
| AGCO Corp | 205 510 | 15,9 | 15,9 |
| Ageas | 91 832 | 4,9 | 4,9 |
| Agilent Technologies Inc | 102 600 | 6,3 | 6,3 |
| AGL Energy Ltd | 1 168 664 | 25,1 | 25,1 |
| AGNC Investment Corp | 453 500 | 11,0 | 11,0 |
| Agricultural Bank of China Ltd | 31 722 942 | 17,4 | 17,4 |
| Agrium Inc | 4 820 193 | 650,5 | 650,5 |
| Aguas Andinas SA | 10 242 989 | 7,2 | 7,2 |
| AIA Engineering Ltd | 350 000 | 9,0 | 9,0 |
| AIA Group Ltd | 3 389 658 | 25,7 | 25,7 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|---|-------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|---------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| AIM Quantitative Global SF II Ltd | | 80 000 | 109,3 | | | | 109,3 |
| Air China Ltd | | 4 200 224 | 3,6 | | | | 3,6 |
| Air Liquide SA | | 119 729 | 17,9 | | | | 17,9 |
| Air Methods Corp | | 277 999 | 11,9 | | | | 11,9 |
| Air Products & Chemicals Inc | | 38 989 | 7,5 | | | | 7,5 |
| Air Water Inc | | 286 615 | 7,0 | | | | 7,0 |
| AirAsia Bhd | | 4 114 836 | 2,8 | | | | 2,8 |
| Airbus SE | | 300 712 | 26,7 | | | | 26,7 |
| Airports of Thailand PCL | | 1 843 011 | 27,5 | | | | 27,5 |
| Aisin Seiki Co Ltd | | 186 141 | 10,9 | | | | 10,9 |
| Ajinomoto Co Inc | | 216 756 | 5,9 | | | | 5,9 |
| Ajisen China Holdings Ltd | | 2 003 000 | 1,1 | | | | 1,1 |
| Akamai Technologies Inc | | 46 413 | 4,2 | | | | 4,2 |
| Akbank TAS | | 4 940 049 | 14,7 | | | | 14,7 |
| AKR Corporindo Tbk PT | | 4 201 100 | 2,5 | | | | 2,5 |
| Akzo Nobel NV | | 75 613 | 6,4 | | | | 6,4 |
| Albemarle Corp | | 17 600 | 2,0 | | | | 2,0 |
| Aldar Properties PJSC | | 10 603 491 | 10,2 | | | | 10,2 |
| Alexandria Minerals Corp | | 800 000 | - | | | | - |
| Alexandria Real Estate Equities, Inc. | | 9 300 | 1,4 | | | | 1,4 |
| Alexion Pharmaceuticals Inc | | 10 124 | 1,7 | | | | 1,7 |
| Alfa Laval AB | | 165 041 | 3,7 | | | | 3,7 |
| Alfa SAB de CV | | 15 126 042 | 25,3 | | | | 25,3 |
| Alfresa Holdings Corp | | 273 220 | 6,1 | | | | 6,1 |
| Aliansce Shopping Centers SA | | 2 365 887 | 14,1 | | | | 14,1 |
| Alibaba Group Holding Ltd | | 2 227 140 | 262,3 | | | | 262,3 |
| Alibaba Health Information Technology Ltd | | 4 305 052 | 2,9 | | | | 2,9 |
| Alibaba Pictures Group Ltd | | 26 125 748 | 5,7 | | | | 5,7 |
| Alimentation Couche-Tard Inc | | 23 100 000 | 1 406,3 | | 106,8 | | 1 513,1 |
| Alior Bank SA | | 295 021 | 5,1 | | | | 5,1 |
| Alkermes PLC | | 16 600 | 1,2 | | | | 1,2 |
| Alleghany Corp | | 6 915 | 5,6 | | | | 5,6 |
| Allergan plc | | 27 750 | 7,8 | | | | 7,8 |

| | | | | | |
|-----------------------------------|--------------|------------|-------|-------|-------|
| ALLETE Inc | | 93 500 | 8,0 | | 8,0 |
| Alliance Data Systems Corp | | 389 692 | 119,4 | | 119,4 |
| Alliance Financial Group Bhd | | 3 306 761 | 3,7 | | 3,7 |
| Alliance Global Group Inc | | 21 828 527 | 7,5 | | 7,5 |
| Alliant Energy Corp | | 302 225 | 15,4 | | 15,4 |
| Allianz SE | | 310 783 | 69,0 | | 69,0 |
| Allison Transmission Holdings Inc | | 98 043 | 4,4 | | 4,4 |
| Allstate Corp, The | | 83 060 | 8,3 | | 8,3 |
| Ally Financial Inc | | 207 400 | 5,3 | 58,7 | 64,0 |
| Alpha Bank AE | | 2 477 953 | 6,7 | | 6,7 |
| Alphabet Inc | classe A | 217 136 | 230,8 | 230,8 | |
| | classe C | 187 843 | 194,4 | 194,4 | 425,2 |
| AlphaQuest Original Ltd | | 105 557 | 147,2 | | 147,2 |
| Alps Electric Co Ltd | | 4 300 | 0,1 | | 0,1 |
| Alrosa PJSC | | 8 653 300 | 18,4 | | 18,4 |
| Alstom SA | | 258 451 | 9,6 | | 9,6 |
| AltaGas Ltd | | 163 820 | 5,5 | 106,0 | 111,5 |
| AltaLink LP | | | | 258,0 | 258,0 |
| Altice NV | classe A | 145 124 | 3,9 | 3,9 | |
| | classe B | 42 901 | 1,1 | 1,1 | 5,0 |
| Altria Group Inc | | 524 319 | 47,5 | | 47,5 |
| Alumina Ltd | | 697 721 | 1,2 | | 1,2 |
| Aluminum Corp of China Ltd | | 9 076 938 | 5,0 | | 5,0 |
| Alupar Investimento SA | | 415 350 | 2,9 | | 2,9 |
| Alyeska Fund LP | | 1 | 270,5 | | 270,5 |
| Amada Holdings Co Ltd | | 134 798 | 2,0 | | 2,0 |
| Amadeus IT Group SA | | 102 286 | 6,2 | | 6,2 |
| Amazon.com Inc | | 2 704 | 2,7 | | 2,7 |
| Ambarella Inc | | 154 961 | 11,2 | | 11,2 |
| Ambev SA | | 14 590 841 | 98,6 | 98,6 | |
| | privilégiées | 974 638 | 6,4 | 6,4 | 105,0 |
| Ambrilia Biopharma Inc | | 1 232 719 | - | | - |
| Ambuja Cements Ltd | | 910 160 | 3,7 | | 3,7 |
| Amtcor Ltd | | 320 369 | 4,7 | | 4,7 |
| AMERCO | | 11 876 | 5,9 | | 5,9 |
| Ameren Corp | | 424 063 | 29,8 | | 29,8 |
| America Movil SAB de CV | | 88 750 223 | 75,3 | | 75,3 |
| American Airlines Group Inc | | 867 | - | | - |
| American Campus Communities Inc | | 102 700 | 6,9 | | 6,9 |

au 31 décembre 2016

(juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|---|--------------|-----------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| American Electric Power Co Inc | | 696 210 | 58,8 | | | | 58,8 |
| American Express Co | | 3 289 496 | 326,8 | | | | 326,8 |
| American International Group Inc | | 543 361 | 47,6 | | | | 47,6 |
| American Tower Corp | | 21 787 | 3,1 | | | | 3,1 |
| American Water Works Co Inc | | 218 344 | 21,2 | | | | 21,2 |
| Ameriprise Financial Inc | | 4 823 | 0,7 | | | | 0,7 |
| Ameris Bancorp | | 149 300 | 8,7 | | | | 8,7 |
| AmerisourceBergen Corp | | 232 092 | 24,3 | | | | 24,3 |
| AMETEK Inc | | 42 606 | 2,8 | | | | 2,8 |
| Amex Exploration Inc | | 817 200 | 0,1 | | | | 0,1 |
| Amgen Inc | | 185 903 | 36,5 | | | | 36,5 |
| AMMB Holdings Bhd | | 6 009 801 | 7,7 | | | | 7,7 |
| Amorepacific Corp | | 115 101 | 41,1 | | | 41,1 | |
| | privilégiées | 27 059 | 6,2 | | | 6,2 | 47,3 |
| Amorepacific Group | | 84 202 | 12,4 | | | | 12,4 |
| AMP Ltd | | 23 337 | 0,1 | | | | 0,1 |
| Amphenol Corp | | 90 016 | 8,1 | | | | 8,1 |
| ANA Holdings Inc | | 107 399 | 0,4 | | | | 0,4 |
| Anadarko Petroleum Corp | | 124 927 | 11,7 | | | | 11,7 |
| Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii AS | | 371 132 | 2,5 | | | | 2,5 |
| Analog Devices Inc | | 68 475 | 6,7 | | | | 6,7 |
| Andritz AG | | 144 481 | 9,7 | | | | 9,7 |
| Angel Yeast Co Ltd | | 2 829 410 | 9,7 | | | | 9,7 |
| Anglo American Platinum Ltd | | 145 952 | 3,8 | | | | 3,8 |
| Anglo American PLC | | 1 258 176 | 24,2 | | | | 24,2 |
| AngloGold Ashanti Ltd | | 2 177 854 | 32,1 | | | | 32,1 |
| Anheuser-Busch InBev SA/NV | | 508 459 | 72,3 | | | | 72,3 |
| Anhui Conch Cement Co Ltd | classe A | 3 714 817 | 12,2 | | | 12,2 | |
| | classe H | 3 229 176 | 11,8 | | | 11,8 | 24,0 |
| Anhui Jianghuai Automobile Group Corp Ltd | | 1 633 761 | 3,6 | | | | 3,6 |
| Annaly Capital Management Inc | | 491 900 | 6,6 | | | | 6,6 |
| Ansell Ltd | | 250 000 | 6,0 | | | | 6,0 |
| ANSYS Inc | | 17 900 | 2,2 | | | | 2,2 |
| ANTA Sports Products Ltd | | 2 303 614 | 9,2 | | | | 9,2 |

| | | | | | |
|---------------------------------------|----------|------------|-------|-------|-------|
| Antero Resources Corp | | 84 707 | 2,7 | | 2,7 |
| Anthem Inc | | 15 102 589 | 60,2 | | 60,2 |
| Antofagasta PLC | | 1 932 041 | 21,6 | | 21,6 |
| AO Smith Corp | | 22 500 | 1,4 | | 1,4 |
| Aon PLC | | 117 500 | 17,6 | | 17,6 |
| Aozora Bank Ltd | | 325 276 | 1,5 | | 1,5 |
| AP Moeller - Maersk AS | classe A | 7 321 | 14,9 | 14,9 | |
| | classe B | 11 737 | 25,2 | 25,2 | 40,1 |
| APA Group | | 1 089 956 | 9,1 | | 9,1 |
| Apache Corp | | 6 200 | 0,5 | | 0,5 |
| Apartment Investment & Management Co | | 178 400 | 10,9 | | 10,9 |
| Apollo Hospitals Enterprise Ltd | | 116 958 | 2,7 | | 2,7 |
| Apple Inc | | 2 884 975 | 448,1 | | 448,1 |
| Applied Materials Inc | | 2 451 500 | 106,1 | | 106,1 |
| AptarGroup Inc | | 1 969 500 | 194,0 | | 194,0 |
| ARA Asset Management Ltd | | 1 626 128 | 2,6 | | 2,6 |
| Aramark | | 78 000 | 3,7 | | 3,7 |
| ARC Resources Ltd | | 16 289 802 | 376,5 | | 376,5 |
| Arca Continental SAB de CV | | 725 011 | 5,1 | | 5,1 |
| Arcelik AS | | 423 654 | 3,4 | | 3,4 |
| ArcelorMittal | | 9 381 | 0,1 | | 0,1 |
| Arch Capital Group Ltd | | 19 300 | 2,2 | | 2,2 |
| Archer Daniels Midland Company | | 531 389 | 32,5 | | 32,5 |
| Arconic Inc | | 27 758 | 0,7 | | 0,7 |
| ARES CLO Ltd | | | | 123,4 | 123,4 |
| Arezzo Industria e Comercio SA | | 524 886 | 5,4 | | 5,4 |
| Aristocrat Leisure Ltd | | 50 670 | 0,8 | | 0,8 |
| Arkema SA | | 30 881 | 4,1 | | 4,1 |
| Arrow Electronics Inc | | 120 200 | 11,5 | | 11,5 |
| Arthur J Gallagher & Co | | 62 220 | 4,3 | | 4,3 |
| Arvind Ltd | | 1 150 000 | 8,0 | | 8,0 |
| Aryzta AG | | 155 589 | 9,2 | | 9,2 |
| Asahi Glass Co Ltd | | 4 207 | - | | - |
| Asahi Group Holdings Ltd | | 155 286 | 6,6 | | 6,6 |
| Asahi India Glass Ltd | | 598 401 | 2,1 | | 2,1 |
| Asahi Kasei Corp | | 42 547 | 0,5 | | 0,5 |
| Ascendas Real Estate Investment Trust | | 644 244 | 1,4 | | 1,4 |
| Ashland Global Holdings Inc | | 15 600 | 2,3 | | 2,3 |
| Ashok Leyland Ltd | | 1 739 568 | 2,8 | | 2,8 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|------------------------------------|-------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Ashtead Group PLC | | 112 095 | 2,9 | | | | 2,9 |
| Asia Cement Co Ltd | | 19 790 | 1,6 | | | | 1,6 |
| Asia Cement Corp | | 4 733 329 | 5,2 | | | | 5,2 |
| Asia Pacific Telecom Co Ltd | | 1 226 562 | 0,5 | | | | 0,5 |
| Asian Paints Ltd | | 439 684 | 7,7 | | | | 7,7 |
| Asics Corp | | 647 | - | | | | - |
| ASM Pacific Technology Ltd | | 197 741 | 2,8 | | | | 2,8 |
| ASML Holding NV | | 14 298 | 2,2 | | | | 2,2 |
| Aspect Diversified Fund | | 1 117 333 | 181,8 | | | | 181,8 |
| Aspen Pharmacare Holdings Ltd | | 1 377 555 | 38,3 | | | | 38,3 |
| Assa Abloy AB | | 199 713 | 5,0 | | | | 5,0 |
| Assicurazioni Generali SpA | | 859 170 | 17,2 | | | | 17,2 |
| Associated British Foods PLC | | 265 075 | 12,1 | | | | 12,1 |
| Assurant Inc | | 14 935 | 1,9 | | | | 1,9 |
| Astellas Pharma Inc | | 2 571 550 | 48,0 | | | | 48,0 |
| Astra International Tbk PT | | 60 252 349 | 49,6 | | | | 49,6 |
| AstraZeneca PLC | | 889 910 | 60,3 | | | | 60,3 |
| Astro Malaysia Holdings Bhd | | 5 132 139 | 4,0 | | | | 4,0 |
| Asustek Computer Inc | | 2 015 460 | 22,2 | | | | 22,2 |
| ASX Ltd | | 32 584 | 1,6 | | | | 1,6 |
| AT&T Inc | | 3 180 523 | 181,4 | | | | 181,4 |
| Atco Ltd | | 75 940 | 3,4 | | | | 3,4 |
| Atento SA | | 607 139 | 6,2 | | | | 6,2 |
| Atlantia SpA | | 826 511 | 26,0 | | | | 26,0 |
| Atlas Copco AB | classe A | 4 014 276 | 164,4 | | | 164,4 | |
| | classe B | 199 409 | 7,3 | | | 7,3 | 171,7 |
| Atmos Energy Corp | | 134 824 | 13,4 | | | | 13,4 |
| Atos SE | | 48 610 | 6,9 | | | | 6,9 |
| Atrium European Real Estate Ltd | | 2 049 400 | 11,4 | | | | 11,4 |
| AU Optronics Corp | | 18 112 863 | 8,9 | | | | 8,9 |
| Auckland International Airport Ltd | | 1 235 718 | 7,2 | | | | 7,2 |
| Aurizon Holdings Ltd | | 19 922 330 | 97,7 | | | | 97,7 |
| Aurobindo Pharma Ltd | | 402 370 | 5,3 | | | | 5,3 |
| AusNet Services | | 3 661 941 | 5,6 | | | | 5,6 |

| | | | | |
|---|------------|-------|------|-------|
| Australia & New Zealand Banking Group Ltd | 4 326 | 0,1 | | 0,1 |
| Auto Trader Group PLC | 40 524 | 0,3 | | 0,3 |
| Autodesk Inc | 31 190 | 3,1 | | 3,1 |
| Autoliv Inc | 17 300 | 2,6 | | 2,6 |
| Automatic Data Processing Inc | 164 931 | 22,7 | | 22,7 |
| AutoNation Inc | 140 316 | 9,2 | | 9,2 |
| Autonomy Global Macro Fund | 621 614 | 184,7 | | 184,7 |
| AutoZone Inc | 798 811 | 846,1 | | 846,1 |
| AvalonBay Communities Inc | 14 086 | 3,3 | | 3,3 |
| Avery Dennison Corp | 18 665 | 1,8 | | 1,8 |
| AviChina Industry & Technology Co Ltd | 4 880 863 | 4,5 | | 4,5 |
| Aviva PLC | 1 527 737 | 12,3 | 75,5 | 87,8 |
| Avnet Inc | 445 470 | 28,4 | | 28,4 |
| AXA SA | 1 156 706 | 39,2 | | 39,2 |
| Axalta Coating Systems Ltd | 37 300 | 1,4 | | 1,4 |
| Axel Springer SE | 220 269 | 14,4 | | 14,4 |
| Axiata Group Bhd | 10 352 103 | 14,6 | | 14,6 |
| Axis Bank Ltd | 3 520 494 | 31,3 | | 31,3 |
| Axis Capital Holdings Ltd | 21 800 | 1,9 | | 1,9 |
| Ayala Corp | 818 671 | 16,1 | | 16,1 |
| Ayala Land Inc | 22 281 251 | 19,2 | | 19,2 |
| Azrieli Group Ltd | 17 581 | 1,0 | | 1,0 |
| Azure Dynamics Corp | 749 737 | - | | - |
| Azure Power Global Ltd | 5 366 667 | 122,3 | | 122,3 |
| AZZ Inc | 140 932 | 12,1 | | 12,1 |
| B/E Aerospace Inc | 21 300 | 1,7 | 78,7 | 80,4 |
| B2Gold Corp | 207 059 | 0,7 | | 0,7 |
| Babcock International Group PLC | 180 556 | 2,9 | | 2,9 |
| Badger Daylighting Ltd | 2 385 400 | 76,6 | | 76,6 |
| BAE Systems PLC | 3 337 364 | 32,7 | | 32,7 |
| Baidu Inc | 697 535 | 153,8 | | 153,8 |
| Bajaj Auto Ltd | 721 392 | 37,5 | | 37,5 |
| Bajaj Electricals Ltd | 550 000 | 2,4 | | 2,4 |
| Bajaj Finance Ltd | 246 967 | 4,1 | | 4,1 |
| Bajaj Finserv Ltd | 58 360 | 3,3 | | 3,3 |
| Baker Hughes Inc | 147 644 | 12,9 | | 12,9 |
| Balkrishna Industries Ltd | 100 000 | 2,2 | | 2,2 |
| Ball Corp | 33 447 | 3,4 | | 3,4 |
| Balmoral Resources Ltd | 190 182 | 0,1 | | 0,1 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|---|--------------|-------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Baloise Holding AG | | 15 272 | 2,6 | | | | 2,6 |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | | 2 006 351 | 18,2 | | | | 18,2 |
| Banco Bradesco SA | | 2 195 312 | 26,3 | | | 26,3 | |
| | privilégiées | 7 704 511 | 92,1 | | | 92,1 | 118,4 |
| Banco Davivienda SA | | 346 632 | 4,6 | | | | 4,6 |
| Banco de Chile | | 79 917 904 | 12,6 | | | | 12,6 |
| Banco de Credito e Inversiones | | 109 132 | 7,4 | | | | 7,4 |
| Banco de Sabadell SA | | 1 783 856 | 3,3 | | | | 3,3 |
| Banco do Brasil SA | | 1 980 155 | 22,9 | | | | 22,9 |
| Banco do Estado do Rio Grande do Sul SA | | 1 660 000 | 7,1 | | | | 7,1 |
| Banco Espirito Santo SA | | 1 667 275 | - | | | | - |
| Banco Popular Espanol SA | | 1 801 665 | 2,3 | | | | 2,3 |
| Banco Santander Brasil SA | | 317 534 | 3,9 | | | | 3,9 |
| Banco Santander Chile | | 217 318 993 | 16,2 | | | | 16,2 |
| Banco Santander SA | | 5 474 680 | 38,4 | | | | 38,4 |
| Bancolombia SA | | 1 335 602 | 16,2 | | | | 16,2 |
| Bandai Namco Holdings Inc | | 67 588 | 2,5 | | | | 2,5 |
| Bangkok Bank PCL | | 2 068 460 | 12,4 | | | | 12,4 |
| Bangkok Dusit Medical Services PCL | | 12 727 337 | 11,0 | | | | 11,0 |
| Bangkok Expressway & Metro PCL | | 29 295 504 | 8,2 | | | | 8,2 |
| Bank Central Asia Tbk PT | | 39 629 760 | 61,1 | | | | 61,1 |
| Bank Danamon Indonesia Tbk PT | | 11 026 329 | 4,1 | | | | 4,1 |
| Bank Handlowy w Warszawie SA | | 58 518 | 1,4 | | | | 1,4 |
| Bank Hapoalim BM | | 340 827 | 2,7 | | | | 2,7 |
| Bank Leumi Le-Israel BM | | 482 150 | 2,7 | | | | 2,7 |
| Bank Mandiri Persero Tbk PT | | 18 003 502 | 20,7 | | | | 20,7 |
| Bank Millennium SA | | 1 086 379 | 1,8 | | | | 1,8 |
| Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT | | 14 696 735 | 8,1 | | | | 8,1 |
| Bank of America Corp | | 7 292 874 | 216,1 | | 377,8 | | 593,9 |
| Bank of Baroda | | 644 777 | 2,0 | | | | 2,0 |
| Bank of China Ltd | classe A | 22 878 700 | 15,2 | | | 15,2 | |
| | classe H | 219 474 609 | 130,6 | | | 130,6 | 145,8 |
| Bank of Communications Co Ltd | | 23 896 041 | 23,2 | | | | 23,2 |
| Bank of East Asia Ltd, The | | 577 648 | 3,0 | | | | 3,0 |

| | | | | |
|---|--------------|---------|-------|---------|
| Bank of Ireland | 9 023 408 | 3,0 | | 3,0 |
| Bank of Kyoto Ltd, The | 125 311 | 1,3 | | 1,3 |
| Bank of New York Mellon Corp, The | 1 067 425 | 67,8 | | 67,8 |
| Bank of Queensland Ltd | 5 877 | 0,1 | | 0,1 |
| Bank of the Philippine Islands | 2 334 026 | 5,6 | | 5,6 |
| Bank Pekao SA | 634 508 | 25,6 | | 25,6 |
| Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT | 40 069 236 | 46,6 | | 46,6 |
| Bank Zachodni WBK SA | 63 899 | 6,5 | | 6,5 |
| Bankia SA | 3 296 931 | 4,5 | | 4,5 |
| Bankinter SA | 140 437 | 1,5 | | 1,5 |
| Banpu PCL | 1 341 215 | 1,0 | | 1,0 |
| Banque Canadienne Impériale de Commerce | | | 344,5 | 344,5 |
| Banque de Montréal | | | 333,0 | 333,0 |
| Banque de Nouvelle-Écosse, La | 21 310 000 | 1 593,1 | 603,2 | 2 196,3 |
| Banque Laurentienne du Canada | 2 668 140 | 154,0 | 223,8 | 377,8 |
| Banque Nationale du Canada | 5 800 000 | 316,3 | 367,5 | 683,8 |
| Banque Royale du Canada | 19 235 277 | 1 747,9 | 764,3 | 2 512,2 |
| Banque Toronto-Dominion, La | 28 550 000 | 1 890,6 | 670,3 | 2 560,9 |
| Baoye Group Co Ltd | 4 634 000 | 4,6 | | 4,6 |
| Barclays Africa Group Ltd | 1 777 026 | 29,4 | | 29,4 |
| Barclays PLC | 7 093 901 | 26,3 | 95,6 | 121,9 |
| Barloworld Ltd | 165 536 | 1,9 | | 1,9 |
| Barratt Developments PLC | 1 275 263 | 9,8 | | 9,8 |
| Barry Callebaut AG | 1 827 | 3,0 | | 3,0 |
| Barwa Real Estate Co | 327 950 | 4,0 | | 4,0 |
| BASF India Ltd | 150 983 | 3,5 | | 3,5 |
| BASF SE | 865 963 | 108,2 | | 108,2 |
| Bata Shoe Co Bangladesh Ltd | 8 602 | 0,2 | | 0,2 |
| Batavia Investment Fund Ltd | 7 754 | - | | - |
| Baxter International Inc | 500 369 | 29,8 | | 29,8 |
| Bayer AG | 387 242 | 54,3 | | 54,3 |
| Bayerische Motoren Werke AG | 420 896 | 52,8 | 52,8 | |
| | privilégiées | 69 668 | 7,2 | 7,2 |
| BB Seguridade Participacoes SA | 1 263 000 | 14,7 | | 14,7 |
| BB&T Corp | 356 262 | 22,5 | | 22,5 |
| BBA Aviation PLC | 1 040 500 | 4,9 | | 4,9 |
| BBMG Corp | 12 612 800 | 10,9 | | 10,9 |
| BCE Inc | 126 045 | 7,3 | | 7,3 |
| BDCM Offshore Fund II Ltd | 10 230 | 1,4 | | 1,4 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|--|-------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|---------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| BDO Unibank Inc | | 3 737 969 | 11,3 | | | | 11,3 |
| BEC World PCL | | 3 221 259 | 2,0 | | | | 2,0 |
| Becton Dickinson and Co | | 51 909 | 11,5 | | | | 11,5 |
| Bed Bath & Beyond Inc | | 84 600 | 4,6 | | | | 4,6 |
| Beiersdorf AG | | 48 401 | 5,5 | | | | 5,5 |
| Beijing Capital International Airport Co Ltd | | 4 922 078 | 6,7 | | | | 6,7 |
| Beijing Enterprises Holdings Ltd | | 1 396 217 | 8,9 | | | | 8,9 |
| Beijing Enterprises Water Group Ltd | | 14 251 655 | 12,7 | | | | 12,7 |
| Beijing Originwater Technology Co Ltd | | 9 750 072 | 33,0 | | | | 33,0 |
| Bell Canada | | | | | 543,6 | | 543,6 |
| Belle International Holdings Ltd | | 17 045 878 | 12,9 | | | | 12,9 |
| Bellway PLC | | 194 000 | 8,0 | | | | 8,0 |
| Bendigo and Adelaide Bank Ltd | | 5 633 | 0,1 | | | | 0,1 |
| Benesse Holdings Inc | | 62 439 | 2,3 | | | | 2,3 |
| Beni Stabili SpA SIIQ | | 8 770 400 | 6,7 | | | | 6,7 |
| Berjaya Sports Toto Bhd | | 2 219 399 | 2,0 | | | | 2,0 |
| Berkeley Group Holdings PLC | | 118 490 | 5,5 | | | | 5,5 |
| Berkshire Hathaway Inc | classe A | 9 | 2,9 | | | 2,9 | |
| | classe B | 4 902 949 | 1 071,6 | | | 1 071,6 | 1 074,5 |
| Berli Jucker PCL | | 3 929 419 | 7,4 | | | | 7,4 |
| Best Buy Co Inc | | 18 000 | 1,0 | | | | 1,0 |
| Bezeq The Israeli Telecommunication Corp Ltd | | 2 050 884 | 5,2 | | | | 5,2 |
| BGF retail Co Ltd | | 29 754 | 2,7 | | | | 2,7 |
| BGP Holdings PLC | | 2 416 150 | - | | | | - |
| Bharat Forge Ltd | | 160 122 | 2,9 | | | | 2,9 |
| Bharat Heavy Electricals Ltd | | 1 303 733 | 3,1 | | | | 3,1 |
| Bharat Petroleum Corp Ltd | | 941 889 | 11,8 | | | | 11,8 |
| Bharti Airtel Ltd | | 2 918 892 | 17,6 | | | | 17,6 |
| Bharti Infratel Ltd | | 1 999 622 | 13,6 | | | | 13,6 |
| BHP Billiton Ltd | | 3 964 | 0,1 | | | | 0,1 |
| BHP Billiton PLC | | 2 103 404 | 49,1 | | | | 49,1 |
| Bid Corp Ltd | | 1 115 885 | 26,8 | | | | 26,8 |
| Bidvest Group Ltd, The | | 1 100 674 | 19,6 | | | | 19,6 |
| BIM Birlesik Magazalar AS | | 687 954 | 12,9 | | | | 12,9 |

| | | | | | |
|---|----------|------------|-------|------|-------|
| Biogen Inc | | 40 752 | 15,5 | | 15,5 |
| BioMarin Pharmaceutical Inc | | 13 000 | 1,4 | | 1,4 |
| Black Diamond Relative Value Ltd | | 956 615 | 254,0 | | 254,0 |
| BlackRock Inc | | 40 829 | 20,8 | | 20,8 |
| Blue Mountain Credit Alternatives Fund Ltd | | 281 003 | 39,9 | | 39,9 |
| Blue Note Mining Inc | | 6 668 813 | - | | - |
| Blue Star Ltd | | 766 647 | 7,2 | | 7,2 |
| BlueScope Steel Ltd | | 500 000 | 4,5 | | 4,5 |
| BM&FBovespa SA - Bolsa de Valores Mercadorias e Futuros | | 11 360 119 | 77,2 | | 77,2 |
| BNK Financial Group Inc | | 960 074 | 9,3 | | 9,3 |
| BNP Paribas SA | | 788 630 | 67,5 | | 67,5 |
| BOC Hong Kong Holdings Ltd | | 2 408 000 | 11,6 | | 11,6 |
| Boeing Company, The | | 130 450 | 27,2 | | 27,2 |
| Boer Power Holdings Ltd | | 1 774 000 | 0,9 | | 0,9 |
| Boliden AB | | 102 132 | 3,6 | | 3,6 |
| Bollore SA | | 1 478 317 | 7,0 | | 7,0 |
| Bombardier Inc | classe A | 5 774 400 | 13,5 | 54,3 | 67,8 |
| | classe B | 47 630 000 | 102,9 | | 102,9 |
| Boral Ltd | | 443 818 | 2,3 | | 2,3 |
| BorgWarner Inc | | 80 489 | 4,3 | | 4,3 |
| Bosch Ltd | | 11 517 | 4,8 | | 4,8 |
| Boston Properties Inc | | 14 746 | 2,5 | | 2,5 |
| Boston Scientific Corp | | 9 826 | 0,3 | | 0,3 |
| Bouygues SA | | 474 056 | 22,8 | | 22,8 |
| Bowmore Exploration Ltée | | 6 243 848 | 0,6 | | 0,6 |
| BP PLC | | 15 912 203 | 134,4 | | 134,4 |
| BR Malls Participacoes SA | | 2 202 151 | 10,8 | | 10,8 |
| Brait SE | | 916 415 | 7,9 | | 7,9 |
| Brambles Ltd | | 1 510 634 | 18,2 | | 18,2 |
| Braskem SA | | 401 041 | 5,7 | | 5,7 |
| BRD-Groupe Societe Generale SA | | 4 010 020 | 14,8 | | 14,8 |
| Brenntag AG | | 102 300 | 7,6 | | 7,6 |
| BRF SA | | 1 730 295 | 34,4 | | 34,4 |
| Bridgestone Corp | | 960 | - | | - |
| Bridgewater Associates LP | | 382 515 | 648,8 | | 648,8 |
| Brilliance China Automotive Holdings Ltd | | 6 955 992 | 12,8 | | 12,8 |
| Bristol-Myers Squibb Co | | 405 074 | 31,7 | | 31,7 |
| Britannia Industries Ltd | | 175 000 | 10,0 | | 10,0 |
| British American Tobacco Malaysia Bhd | | 557 290 | 7,4 | | 7,4 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|---------------------------------------|-------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| British American Tobacco PLC | | 981 885 | 75,2 | | | | 75,2 |
| British Land Co PLC, The | | 313 956 | 3,3 | | | | 3,3 |
| Brixtor Property Group Inc | | 31 700 | 1,0 | | | | 1,0 |
| Broadcom Ltd | | 45 548 | 10,8 | | | | 10,8 |
| Broadridge Financial Solutions Inc | | 25 400 | 2,3 | | | | 2,3 |
| Brookfield Asset Management Inc | | | | | 281,5 | | 281,5 |
| Brookfield Renewable Partners ULC | | | | | 201,7 | | 201,7 |
| Brookline Bancorp Inc | | 100 600 | 2,2 | | | | 2,2 |
| Brother Industries Ltd | | 245 900 | 6,0 | | | | 6,0 |
| Brown & Brown Inc | | 236 253 | 14,2 | | | | 14,2 |
| Brown-Forman Corp | | 57 286 | 3,5 | | | | 3,5 |
| BRP Inc | | | | 171,3 | 88,5 | | 259,8 |
| BT Group PLC | | 3 462 687 | 21,1 | | | | 21,1 |
| BTS Group Holdings PCL | | 25 923 126 | 8,3 | | | | 8,3 |
| Bumi Serpong Damai Tbk PT | | 16 899 588 | 3,0 | | | | 3,0 |
| Bumrungrad Hospital PCL | | 1 173 277 | 8,0 | | | | 8,0 |
| Bunge Ltd | | 197 700 | 19,2 | | | | 19,2 |
| Bunzl PLC | | 88 861 | 3,1 | | | | 3,1 |
| Burberry Group PLC | | 127 937 | 3,2 | | | | 3,2 |
| Bureau Veritas SA | | 244 629 | 6,4 | | | | 6,4 |
| BWX Technologies Inc | | 53 988 | 2,9 | | | | 2,9 |
| BYD Co Ltd | | 1 473 949 | 10,4 | | | | 10,4 |
| CA Inc | | 196 000 | 8,4 | | | | 8,4 |
| Cabia Goldhills Inc | | 775 000 | 0,1 | | | | 0,1 |
| Cabot Oil & Gas Corp | | 44 313 | 1,4 | | | | 1,4 |
| Cadence Design Systems Inc | | 56 400 | 1,9 | | | | 1,9 |
| Cadila Healthcare Ltd | | 1 862 779 | 13,1 | | | | 13,1 |
| CAE Inc | | 4 379 111 | 82,2 | | 50,0 | | 132,2 |
| Cairn India Ltd | | 687 740 | 3,3 | | | | 3,3 |
| Caisse Centrale Desjardins du Québec | | | | | 210,7 | | 210,7 |
| Caisse Francaise de Financement Local | | | | | 61,9 | | 61,9 |
| CaixaBank SA | | 7 993 222 | 35,5 | | | | 35,5 |
| Calpine Corp | | 356 231 | 5,5 | | | | 5,5 |

| | | | |
|--|------------|-------|-------|
| Caltex Australia Ltd | 383 191 | 11,3 | 11,3 |
| Camden Property Trust | 11 500 | 1,3 | 1,3 |
| Campbell Soup Co | 1 700 | 0,1 | 0,1 |
| Canada Strategic Metals Inc | 3 620 500 | 0,4 | 0,4 |
| Canadian Apartment Properties REIT | 168 800 | 5,3 | 5,3 |
| Canadian Natural Resources Limited | 23 167 131 | 991,3 | 991,3 |
| Canadian Regional Aircraft Finance Transaction no1 Limited | 300 000 | - | - |
| Canadian Utilities Ltd | 3 331 454 | 120,6 | 120,6 |
| Canon Inc | 6 755 | 0,3 | 0,3 |
| Capgemini SA | 76 739 | 8,7 | 8,7 |
| Capita Group Plc, The | 251 121 | 2,2 | 2,2 |
| Capital & Counties Properties PLC | 1 778 775 | 8,8 | 8,8 |
| Capital Desjardins Inc | | | 71,3 |
| Capital One Financial Corporation | 120 475 | 14,1 | 14,1 |
| Capital Power LP | | | 13,1 |
| CapitaLand Commercial Trust | 816 900 | 1,1 | 1,1 |
| CapitaLand Ltd | 1 040 001 | 2,9 | 2,9 |
| CapitaLand Mall Trust | 796 707 | 1,4 | 1,4 |
| Capitec Bank Holdings Ltd | 109 517 | 7,5 | 7,5 |
| Cardinal Health Inc | 290 000 | 28,0 | 28,0 |
| Cardtronics PLC | 188 340 | 13,8 | 13,8 |
| Carlisle Cos Inc | 65 000 | 9,6 | 9,6 |
| Carlsberg AS | 63 383 | 7,3 | 7,3 |
| Carlyle Global Market Strategies | | | 87,4 |
| Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-3 Ltd | | | 134,2 |
| CarMax Inc | 64 597 | 5,6 | 5,6 |
| Carnival Corp | 162 641 | 11,4 | 11,4 |
| Carnival PLC | 82 432 | 5,6 | 5,6 |
| Carrefour SA | 996 836 | 32,3 | 32,3 |
| Carter's Inc | 61 100 | 7,1 | 7,1 |
| Cascades Inc | 5 018 868 | 60,7 | 60,7 |
| Casetek Holdings Ltd | 445 695 | 1,6 | 1,6 |
| Casino Guichard Perrachon SA | 272 649 | 17,6 | 17,6 |
| Casio Computer Co Ltd | 5 156 | 0,1 | 0,1 |
| Catcher Technology Co Ltd | 266 529 | 2,5 | 2,5 |
| Caterpillar Inc | 270 900 | 33,7 | 33,7 |
| Cathay Financial Holding Co Ltd | 27 233 996 | 54,6 | 54,6 |
| Cathay Pacific Airways Ltd | 3 600 040 | 6,4 | 6,4 |
| Caverion Corp | 223 100 | 2,5 | 2,5 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|---|-------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| CBOE Holdings Inc | | 150 025 | 14,9 | | | | 14,9 |
| CBRE Group Inc | | 47 744 | 2,0 | | | | 2,0 |
| CBS Corp | | 3 964 | 0,3 | | | | 0,3 |
| CCC SA | | 49 055 | 3,2 | | | | 3,2 |
| CCR SA | | 3 836 300 | 25,2 | | | | 25,2 |
| CDK Global Inc | | 322 500 | 25,8 | | | | 25,8 |
| CDP WTN Diversified Strategy Fund Limited | | 1 522 489 | 234,3 | | | | 234,3 |
| CDW Corp | | 13 760 | 1,0 | | | | 1,0 |
| CEB Inc | | 160 470 | 13,0 | | | | 13,0 |
| Celanese Corp | | 29 600 | 3,1 | | | | 3,1 |
| Celgene Corp | | 74 022 | 11,5 | | | | 11,5 |
| Celltrion Inc | | 37 637 | 4,5 | | | | 4,5 |
| Cementos Argos SA | | 1 360 820 | 7,2 | | | | 7,2 |
| Cementos Pacasmayo SAA | | 1 942 993 | 4,9 | | | | 4,9 |
| Cemex SAB de CV | | 32 152 165 | 34,6 | | | | 34,6 |
| Cencosud SA | | 4 244 451 | 16,0 | | | | 16,0 |
| Cenovus Energy Inc | | 31 128 235 | 631,9 | | | | 631,9 |
| Centene Corp | | 65 200 | 4,9 | | | | 4,9 |
| CenterPoint Energy Inc | | 614 479 | 20,3 | | | | 20,3 |
| Centrais Eletricas Brasileiras SA | | 741 573 | 7,0 | | | 7,0 | |
| | classe B | 751 230 | 8,0 | | | 8,0 | 15,0 |
| Central Japan Railway Co | | 136 790 | 30,2 | | | | 30,2 |
| Central Pattana PCL | | 4 425 559 | 9,4 | | | | 9,4 |
| Centre Testing International Group Co Ltd | | 3 565 997 | 7,9 | | | | 7,9 |
| Centrica PLC | | 10 159 841 | 39,4 | | | | 39,4 |
| CenturyLink Inc | | 343 062 | 10,9 | | | | 10,9 |
| Cerner Corp | | 52 379 | 3,3 | | | | 3,3 |
| CETIP SA - Mercados Organizados | | 611 903 | 11,2 | | | | 11,2 |
| Cevian Capital II Co-Investment Amp L.P. | | 1 | 141,7 | | | | 141,7 |
| Cevian Capital II Co-Investment Fund LP | | 1 | 333,3 | | | | 333,3 |
| Cevian Capital II Ltd | | 2 000 000 | 395,6 | | | | 395,6 |
| CEZ AS | | 949 938 | 21,4 | | | | 21,4 |
| CF Industries Holdings Inc | | 120 172 | 5,1 | | | | 5,1 |
| CGN Power Co Ltd | | 34 729 369 | 12,8 | | | | 12,8 |

| | | | | | |
|--|----------|-------------|-------|-------|-------|
| CH Robinson Worldwide Inc | | 45 103 | 4,4 | | 4,4 |
| Chailease Holding Co Ltd | | 684 088 | 1,6 | | 1,6 |
| Challenger Ltd | | 90 754 | 1,0 | | 1,0 |
| Chang Hwa Commercial Bank Ltd | | 10 905 970 | 7,8 | | 7,8 |
| Charles River Laboratories International Inc | | 138 054 | 14,1 | | 14,1 |
| Charles Schwab Corp, The | | 91 968 | 4,9 | | 4,9 |
| Charoen Pokphand Foods PCL | | 10 164 981 | 11,2 | | 11,2 |
| Charoen Pokphand Indonesia Tbk PT | | 13 377 515 | 4,1 | | 4,1 |
| Charter Communications Inc | | 69 881 | 27,0 | | 27,0 |
| CHC Healthcare Group | | 492 450 | 0,9 | | 0,9 |
| Check Point Software Technologies Ltd | | 35 269 | 4,0 | | 4,0 |
| Cheetah Mobile Inc | | 70 990 | 0,9 | | 0,9 |
| Cheil Worldwide Inc | | 208 150 | 3,6 | | 3,6 |
| Chemed Corp | | 78 494 | 16,9 | | 16,9 |
| Chemin de fer Canadien Pacifique Limitée | | 205 015 | 39,3 | | 39,3 |
| Cheng Shin Rubber Industry Co Ltd | | 2 948 818 | 7,5 | | 7,5 |
| Chengdu Kanghong Pharmaceutical Group Co Ltd | | 653 598 | 7,2 | | 7,2 |
| Cheniere Energy Inc | | 201 320 | 11,2 | | 11,2 |
| Cheung Kong Infrastructure Holdings Ltd | | 912 300 | 9,7 | | 9,7 |
| Cheung Kong Property Holdings Ltd | | 2 968 024 | 24,4 | | 24,4 |
| Chevron Corp | | 337 200 | 53,2 | | 53,2 |
| Chiba Bank Ltd, The | | 255 409 | 2,1 | | 2,1 |
| Chicony Electronics Co Ltd | | 1 146 872 | 3,6 | | 3,6 |
| Chicony Power Technology Co Ltd | | 1 481 092 | 3,1 | | 3,1 |
| China Airlines Ltd | | 2 871 338 | 1,1 | | 1,1 |
| China CAMC Engineering Co Ltd | | 3 432 858 | 15,2 | | 15,2 |
| China Cinda Asset Management Co Ltd | | 23 100 508 | 11,2 | | 11,2 |
| China CITIC Bank Corporation Limited | | 23 433 380 | 20,0 | | 20,0 |
| China Coal Energy Co Ltd | | 4 724 860 | 3,0 | | 3,0 |
| China Communications Construction Co Ltd | | 12 043 543 | 18,6 | | 18,6 |
| China Communications Services Corp Ltd | | 5 506 554 | 4,7 | | 4,7 |
| China Conch Venture Holdings Ltd | | 3 115 281 | 7,4 | | 7,4 |
| China Construction Bank Corp | classe A | 13 291 000 | 14,0 | 14,0 | |
| | classe H | 229 430 936 | 236,9 | 236,9 | 250,9 |
| China CYTS Tours Holding Co Ltd | | 5 247 887 | 21,2 | | 21,2 |
| China Development Financial Holding Corp | | 42 991 000 | 14,4 | | 14,4 |
| China Distance Education Holdings Ltd | | 50 277 | 0,8 | | 0,8 |
| China Everbright Bank Co Ltd | | 7 115 203 | 4,3 | | 4,3 |
| China Everbright International Ltd | | 6 172 084 | 9,4 | | 9,4 |

au 31 décembre 2016

(juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|--|-------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| China Everbright Ltd | | 2 134 593 | 5,4 | | | | 5,4 |
| China Evergrande Group | | 11 716 863 | 9,8 | | | | 9,8 |
| China Fiber Optic Network System Group Ltd | | 8 023 200 | - | | | | - |
| China Galaxy Securities Co Ltd | | 6 797 723 | 8,2 | | | | 8,2 |
| China Gas Holdings Ltd | | 9 368 500 | 17,0 | | | | 17,0 |
| China Huarong Asset Management Co Ltd | | 11 527 700 | 5,6 | | | | 5,6 |
| China Huishan Dairy Holdings Co Ltd | | 9 304 206 | 4,8 | | | | 4,8 |
| China International Travel Service Corp Ltd | | 655 819 | 5,5 | | | | 5,5 |
| China Jinmao Holdings Group Ltd | | 8 599 809 | 3,1 | | | | 3,1 |
| China Life Insurance Co Ltd | | 18 718 588 | 65,4 | | | | 65,4 |
| China Life Insurance Co Ltd, Taiwan | | 12 643 883 | 16,9 | | | | 16,9 |
| China Longyuan Power Group Corp Ltd | | 11 494 350 | 12,0 | | | | 12,0 |
| China Medical System Holdings Ltd | | 2 861 991 | 6,1 | | | | 6,1 |
| China Mengniu Dairy Co Ltd | | 9 649 203 | 24,9 | | | | 24,9 |
| China Merchants Bank Co Ltd | classe A | 12 459 581 | 42,3 | | | 42,3 | |
| | classe H | 10 539 985 | 33,1 | | | 33,1 | 75,4 |
| China Merchants Energy Shipping Co Ltd | | 2 040 900 | 1,9 | | | | 1,9 |
| China Merchants Port Holdings Co Ltd | | 4 599 714 | 15,3 | | | | 15,3 |
| China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co Ltd | | 620 781 | 2,0 | | | | 2,0 |
| China Minsheng Banking Corp Ltd | | 15 485 901 | 22,2 | | | | 22,2 |
| China Mobile Ltd | | 44 727 977 | 635,9 | | | | 635,9 |
| China Modern Dairy Holdings Ltd | | 6 384 000 | 2,1 | | | | 2,1 |
| China National Accord Medicines Corp Ltd | | 532 597 | 6,9 | | | | 6,9 |
| China National Building Material Co Ltd | | 9 288 073 | 6,1 | | | | 6,1 |
| China Oilfield Services Ltd | | 4 168 975 | 5,2 | | | | 5,2 |
| China Overseas Land & Investment Ltd | | 10 264 344 | 36,5 | | | | 36,5 |
| China Pacific Insurance Group Co Ltd | | 6 709 147 | 31,4 | | | | 31,4 |
| China Petroleum & Chemical Corp | classe A | 30 969 800 | 32,3 | | | 32,3 | |
| | classe H | 73 483 268 | 69,9 | | | 69,9 | 102,2 |
| China Power International Development Ltd | | 10 836 473 | 5,3 | | | | 5,3 |
| China Railway Construction Corp Ltd | | 5 386 406 | 9,3 | | | | 9,3 |
| China Railway Group Ltd | | 10 674 150 | 11,8 | | | | 11,8 |
| China Resources Beer Holdings Co Ltd | | 4 425 175 | 11,8 | | | | 11,8 |
| China Resources Gas Group Ltd | | 2 912 634 | 11,0 | | | | 11,0 |

| | | | | | |
|---|--------------|------------|------|-------|-------|
| China Resources Land Ltd | | 7 016 257 | 21,2 | | 21,2 |
| China Resources Power Holdings Co Ltd | | 7 379 341 | 15,7 | | 15,7 |
| China Shenhua Energy Co Ltd | | 9 728 196 | 24,6 | | 24,6 |
| China Shineway Pharmaceutical Group Ltd | | 945 000 | 1,4 | | 1,4 |
| China Southern Airlines Co Ltd | | 4 180 485 | 2,9 | | 2,9 |
| China State Construction International Holdings Ltd | | 4 131 467 | 8,3 | | 8,3 |
| China Steel Corp | | 10 738 031 | 11,0 | | 11,0 |
| China Taiping Insurance Holdings Co Ltd | | 4 175 792 | 11,6 | | 11,6 |
| China Telecom Corp Ltd | | 41 146 865 | 25,5 | | 25,5 |
| China Unicom Hong Kong Ltd | | 17 578 787 | 27,5 | | 27,5 |
| China Vanke Co Ltd | | 3 026 818 | 9,3 | | 9,3 |
| China Western Power Industrial Co Ltd | | 3 736 710 | 8,9 | | 8,9 |
| Chinasoft International Ltd | | 2 238 000 | 1,4 | | 1,4 |
| Chipotle Mexican Grill Inc | | 3 853 | 1,9 | | 1,9 |
| Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG | | 215 | 3,0 | | 3,0 |
| Chongqing Brewery Co Ltd | | 1 109 143 | 3,9 | | 3,9 |
| Chongqing Changan Automobile Co Ltd | classe A | 3 651 639 | 10,5 | 10,5 | |
| | classe B | 1 972 525 | 3,8 | 3,8 | 14,3 |
| Chongqing Rural Commercial Bank Co Ltd | | 7 120 698 | 5,6 | | 5,6 |
| Chongqing Taiji Industry Group Co Ltd | | 2 081 938 | 6,9 | | 6,9 |
| Chr Hansen Holding A/S | | 110 906 | 8,3 | | 8,3 |
| Christian Dior SE | | 102 330 | 28,8 | | 28,8 |
| CHS/Community Health Systems Inc | | | | 153,7 | 153,7 |
| Chubb Ltd | | 298 843 | 52,9 | | 52,9 |
| Chubu Electric Power Co Inc | | 1 347 682 | 25,3 | | 25,3 |
| Chugai Pharmaceutical Co Ltd | | 411 | - | | - |
| Chugoku Bank Ltd, The | | 59 700 | 1,2 | | 1,2 |
| Chugoku Electric Power Co Inc, The | | 650 826 | 10,3 | | 10,3 |
| Chunghwa Telecom Co Ltd | | 12 955 340 | 54,7 | | 54,7 |
| Church & Dwight Co Inc | | 46 754 | 2,8 | | 2,8 |
| CI Financial Corp | | 3 280 000 | 94,7 | | 94,7 |
| Cia Brasileira de Distribuicao | | 87 407 | 2,0 | | 2,0 |
| Cia Cervecerias Unidas SA | | 435 088 | 6,1 | | 6,1 |
| Cia de Minas Buenaventura SAA | | 560 164 | 8,5 | | 8,5 |
| Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo | | 3 216 128 | 38,2 | | 38,2 |
| Cia de Transmissao de Energia Eletrica Paulista | | 426 000 | 11,4 | | 11,4 |
| Cia Energetica de Minas Gerais | | 108 400 | 0,4 | 0,4 | |
| | privilégiées | 3 132 817 | 10,0 | 10,0 | 10,4 |
| Cia Energetica do Ceara | | 350 000 | 7,2 | | 7,2 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|--------------------------------|--------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Cia Paranaense de Energia | | 24 900 | 0,2 | | | 0,2 | |
| | classe B | 111 255 | 1,3 | | | 1,3 | 1,5 |
| Cia Siderurgica Nacional SA | | 225 637 | 1,0 | | | | 1,0 |
| CIBC Capital Trust | | | | | 25,4 | | 25,4 |
| Cielo SA | | 1 941 949 | 22,3 | | | | 22,3 |
| CIFC Funding Ltd | | | | | 87,3 | | 87,3 |
| Cigna Corp | | 166 163 | 29,7 | | | | 29,7 |
| Cimarex Energy Co | | 11 905 | 2,2 | | | | 2,2 |
| CIMB Group Holdings Bhd | | 6 949 887 | 9,4 | | | | 9,4 |
| CIMIC Group Ltd | | 586 517 | 19,9 | | | | 19,9 |
| Cincinnati Financial Corp | | 39 966 | 4,1 | | | | 4,1 |
| Cintas Corp | | 45 036 | 7,0 | | | | 7,0 |
| Cipla Ltd | | 2 352 490 | 26,4 | | | | 26,4 |
| Cisco Systems Inc | | 3 076 368 | 124,7 | | | | 124,7 |
| CIT Group Inc | | 59 300 | 3,4 | | | | 3,4 |
| CITIC Ltd | | 12 094 430 | 23,2 | | | | 23,2 |
| CITIC Securities Co Ltd | classe A | 4 309 953 | 13,4 | | | 13,4 | |
| | classe H | 5 181 837 | 14,1 | | | 14,1 | 27,5 |
| Citigroup Inc | | 1 988 410 | 158,4 | | 489,4 | | 647,8 |
| Citizens Financial Group Inc | | 129 630 | 6,2 | | | | 6,2 |
| Citrix Systems Inc | | 229 541 | 27,5 | | | | 27,5 |
| City Developments Ltd | | 181 292 | 1,4 | | | | 1,4 |
| Citycon OYJ | | 948 600 | 3,1 | | | | 3,1 |
| Cityneon Holdings Ltd | | 139 800 | 0,1 | | | | 0,1 |
| CJ CheilJedang Corp | | 33 593 | 13,3 | | | 13,3 | |
| | privilégiées | 496 | 0,1 | | | 0,1 | 13,4 |
| CJ Corp | | 50 349 | 10,5 | | | | 10,5 |
| CJ E&M Corp | | 171 608 | 13,5 | | | | 13,5 |
| CJ Korea Express Corp | | 12 888 | 2,6 | | | | 2,6 |
| CK Hutchison Holdings Ltd | | 1 997 829 | 30,4 | | | | 30,4 |
| ClareGold Trust | | | | | 5,5 | | 5,5 |
| Cleanaway Co Ltd | | 147 000 | 1,0 | | | | 1,0 |
| Cleanaway Waste Management Ltd | | 5 488 210 | 6,6 | | | | 6,6 |
| Clorox Company, The | | 27 505 | 4,4 | | | | 4,4 |

| | | | |
|--|-------------|---------|---------|
| CLP Holdings Ltd | 2 607 219 | 32,1 | 32,1 |
| CME Group Inc | 129 161 | 20,0 | 20,0 |
| CMS Energy Corp | 372 467 | 20,8 | 20,8 |
| CNH Industrial NV | 3 593 104 | 42,0 | 42,0 |
| CNOOC Ltd | 161 576 535 | 271,1 | 271,1 |
| CNP Assurances | 421 132 | 10,5 | 10,5 |
| Coach Inc | 2 528 902 | 118,8 | 118,8 |
| Coal India Ltd | 1 478 469 | 8,8 | 8,8 |
| Cobalt International Energy Inc | 6 330 539 | 10,4 | 10,4 |
| Cobham PLC | 872 597 | 2,4 | 2,4 |
| Coca-Cola Amatil Ltd | 944 835 | 9,3 | 9,3 |
| Coca-Cola Co, The | 1 520 652 | 84,5 | 84,5 |
| Coca-Cola European Partners PLC | 501 518 | 21,2 | 21,2 |
| Coca-Cola Femsa SAB de CV | 1 012 842 | 8,7 | 8,7 |
| Coca-Cola HBC AG | 186 853 | 5,5 | 5,5 |
| Coca-Cola Icecek AS | 136 761 | 1,7 | 1,7 |
| Cochlear Ltd | 12 373 | 1,5 | 1,5 |
| Cogeco Communications Inc | | | 95,2 |
| Cognizant Technology Solutions Corp | 841 665 | 63,2 | 63,2 |
| Colbun SA | 30 906 602 | 8,2 | 8,2 |
| Colgate-Palmolive Co | 3 946 812 | 346,4 | 346,4 |
| Colgate-Palmolive India Ltd | 341 729 | 6,1 | 6,1 |
| Coloplast AS | 139 265 | 12,6 | 12,6 |
| Colruyt SA | 127 883 | 8,5 | 8,5 |
| Comber Wind Financial Corp | | | 80,5 |
| Comcast Corp | 136 968 | 12,7 | 12,7 |
| Comerica Inc | 31 301 | 2,9 | 2,9 |
| ComfortDelGro Corp Ltd | 2 934 470 | 6,7 | 6,7 |
| Commercial Bank of Ceylon PLC | 1 371 069 | 1,8 | 1,8 |
| Commercial Bank of Qatar QSC, The | 543 791 | 6,5 | 6,5 |
| Commercial International Bank Egypt SAE | 3 501 250 | 18,9 | 18,9 |
| Commerzbank AG | 921 529 | 9,4 | 9,4 |
| Commonwealth Bank of Australia | 40 035 | 3,2 | 3,2 |
| Compagnie de Financement Foncier SA | | | 133,9 |
| Compagnie de Saint-Gobain | 468 311 | 29,3 | 29,3 |
| Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada | 18 040 320 | 1 630,1 | 1 630,1 |
| Compagnie Financière Richemont SA | 351 867 | 31,3 | 31,3 |
| Compagnie Générale des Établissements Michelin | 204 445 | 30,6 | 30,6 |
| Compagnie Pétrolière Impériale Ltée | 21 268 | 1,0 | 1,0 |

au 31 décembre 2016

(juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|---|-------------|-------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Compagnies Loblaw limitée, Les | | 11 223 500 | 795,1 | | 102,4 | | 897,5 |
| Compal Electronics Inc | | 11 451 390 | 8,8 | | | | 8,8 |
| Companhia de Saneamento de Minas Gerais Copasa MG | | 1 394 939 | 21,0 | | | | 21,0 |
| Compass Group PLC | | 1 133 360 | 28,2 | | | | 28,2 |
| Computershare Ltd | | 11 319 | 0,1 | | | | 0,1 |
| Conagra Brands Inc | | 140 100 | 7,4 | | | | 7,4 |
| Concho Resources Inc | | 23 900 | 4,2 | | | | 4,2 |
| Concordia Financial Group Ltd | | 369 335 | 2,4 | | | | 2,4 |
| ConocoPhillips | | 770 352 | 51,8 | | | | 51,8 |
| Consolidated Edison Inc | | 433 603 | 42,8 | | | | 42,8 |
| Constellation Brands Inc | | 28 185 | 5,8 | | | | 5,8 |
| Constellation Software Inc | | 15 290 | 9,3 | | | | 9,3 |
| Contact Energy Ltd | | 1 167 735 | 5,1 | | | | 5,1 |
| Container Corp Of India Ltd | | 246 267 | 5,4 | | | | 5,4 |
| Continental AG | | 69 907 | 18,2 | | | | 18,2 |
| Continental Resources Inc | | 66 600 | 4,6 | | | | 4,6 |
| Controladora Vuela Cia de Aviacion SAB de CV | | 80 000 | 1,6 | | | | 1,6 |
| Convenience Retail Asia Ltd | | 1 574 000 | 1,0 | | | | 1,0 |
| Cooper Cos Inc , The | | 230 500 | 54,1 | | | | 54,1 |
| Core Laboratories NV | | 73 850 | 11,9 | | | | 11,9 |
| Corning Inc | | 54 700 | 1,8 | | | | 1,8 |
| Coronation Fund Managers Ltd | | 615 339 | 4,3 | | | | 4,3 |
| Corp Financiera Colombiana SA | | 257 202 | 4,3 | | | | 4,3 |
| Corp Moctezuma SAB de CV | | 3 194 000 | 12,4 | | | | 12,4 |
| Corpbanca SA | | 452 559 970 | 5,1 | | | | 5,1 |
| Corporation Aurifère Aurvista | | 2 130 500 | 0,4 | | | | 0,4 |
| Corporation Fiera Capital | | 1 483 000 | 19,0 | | | | 19,0 |
| Corporation Financière Power | | 484 966 | 16,3 | | 58,5 | | 74,8 |
| Corporation Groupe Mercator Transport | | 2 500 000 | - | | | | - |
| Corporativo Fragua SAB de CV | | 628 913 | 10,9 | | | | 10,9 |
| Cosan SA Industria e Comercio | | 1 121 672 | 17,6 | | | | 17,6 |
| COSCO SHIPPING Ports Ltd | | 6 081 103 | 8,2 | | | | 8,2 |
| Costco Wholesale Corp | | 205 370 | 44,1 | | | | 44,1 |

| | | | | |
|---|------------|-------|-------|-------|
| Coty Inc | 23 400 | 0,6 | 33,4 | 34,0 |
| Country Garden Holdings Co Ltd | 15 051 976 | 11,3 | | 11,3 |
| Covestro AG | 72 525 | 6,7 | | 6,7 |
| Coway Co Ltd | 220 662 | 21,6 | | 21,6 |
| CP ALL PCL | 16 769 231 | 39,2 | | 39,2 |
| CPFL Energia SA | 768 361 | 8,0 | | 8,0 |
| CPFL Energias Renovaveis SA | 2 500 000 | 12,0 | | 12,0 |
| CR Bard Inc | 36 208 | 10,9 | | 10,9 |
| CR Capital Corp | 827 540 | - | | - |
| Credicorp Ltd | 198 972 | 42,1 | | 42,1 |
| Crédit Agricole SA | 1 195 263 | 19,9 | | 19,9 |
| Credit Saison Co Ltd | 45 180 | 1,1 | | 1,1 |
| Credit Suisse Group AG | 2 188 490 | 42,2 | | 42,2 |
| Crestline CDP Opportunity Fund LP | 1 | 37,1 | | 37,1 |
| Cresud SACIF y A | 562 305 | 11,9 | | 11,9 |
| CRH PLC | 291 461 | 13,6 | | 13,6 |
| Croda International PLC | 22 962 | 1,2 | | 1,2 |
| Crown Castle International Corp | 533 538 | 62,1 | | 62,1 |
| Crown Holdings Inc | 32 000 | 2,3 | | 2,3 |
| Crown Resorts Ltd | 1 395 | - | | - |
| CRRC Corp Ltd | 9 695 380 | 11,7 | | 11,7 |
| CSE Global Ltd | 2 581 400 | 1,1 | | 1,1 |
| CSL Ltd | 130 985 | 12,8 | | 12,8 |
| CSPC Pharmaceutical Group Ltd | 9 652 254 | 13,8 | | 13,8 |
| CSRA Inc | | | 42,3 | 42,3 |
| CSX Corp | 1 374 354 | 66,2 | | 66,2 |
| CTBC Financial Holding Co Ltd | 47 658 297 | 35,0 | | 35,0 |
| Ctrip.com International Ltd | 1 095 268 | 58,8 | | 58,8 |
| CU Inc | | | 330,0 | 330,0 |
| CubeSmart | 297 800 | 10,7 | | 10,7 |
| Cummins Inc | 136 000 | 24,9 | | 24,9 |
| CVC Brasil Operadora e Agencia de Viagens SA | 2 146 900 | 21,0 | | 21,0 |
| CVS Health Corp | 3 115 191 | 329,7 | | 329,7 |
| CYBERDYNE Inc | 5 200 | 0,1 | | 0,1 |
| Cyfrowy Polsat SA | 596 275 | 4,7 | | 4,7 |
| Cyrela Brazil Realty SA Empreendimentos e Participacoes | 1 966 400 | 8,3 | | 8,3 |
| Dabur India Ltd | 1 549 092 | 8,5 | | 8,5 |
| Daelim Industrial Co Ltd | 169 784 | 16,4 | | 16,4 |
| Daewoo Engineering & Construction Co Ltd | 221 073 | 1,2 | | 1,2 |

au 31 décembre 2016

(juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|---|-------------|-----------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Dah Chong Hong Holdings Ltd | | 2 510 000 | 1,3 | | | | 1,3 |
| Dah Sing Financial Holdings Ltd | | 227 868 | 2,1 | | | | 2,1 |
| Dai Nippon Printing Co Ltd | | 564 436 | 7,5 | | | | 7,5 |
| Daicel Corp | | 114 605 | 1,7 | | | | 1,7 |
| Dai-ichi Life Insurance Co Limited, The | | 2 331 912 | 52,2 | | | | 52,2 |
| Daiichi Sankyo Co Ltd | | 2 747 | 0,1 | | | | 0,1 |
| Daikin Industries Ltd | | 165 754 | 20,5 | | | | 20,5 |
| Daily Mail & General Trust PLC | | 665 990 | 8,6 | | | | 8,6 |
| Daimler AG | | 1 130 010 | 113,0 | | | | 113,0 |
| Daito Trust Construction Co Ltd | | 11 198 | 2,3 | | | | 2,3 |
| Daiwa House Industry Co Ltd | | 119 829 | 4,4 | | | | 4,4 |
| Daiwa House REIT Investment Corp | | 33 | 0,1 | | | | 0,1 |
| Daiwa Securities Group Inc | | 2 237 851 | 18,5 | | | | 18,5 |
| Dalmia Bharat Ltd | | 450 000 | 12,0 | | | | 12,0 |
| Dana Inc | | | | | 92,7 | | 92,7 |
| Danaher Corp | | 1 586 813 | 165,6 | | | | 165,6 |
| Danone SA | | 473 245 | 40,3 | | | | 40,3 |
| Danske Bank AS | | 164 129 | 6,7 | | | | 6,7 |
| Darden Restaurants Inc | | 43 300 | 4,2 | | | | 4,2 |
| Dassault Systèmes SA | | 40 219 | 4,1 | | | | 4,1 |
| DataTec Ltd | | 534 406 | 2,6 | | | | 2,6 |
| DaVita Inc | | 84 300 | 7,3 | | | | 7,3 |
| DBS Group Holdings Ltd | | 1 340 670 | 21,6 | | | | 21,6 |
| DCB Bank Ltd | | 3 100 000 | 6,6 | | | | 6,6 |
| DCC PLC | | 34 358 | 3,4 | | | | 3,4 |
| DE Shaw Oculus International Fund | | 1 | 204,7 | | | | 204,7 |
| Deere & Co | | 47 528 | 6,6 | | | | 6,6 |
| Dell Technologies Inc Class V | | 30 700 | 2,3 | | | | 2,3 |
| Delphi Automotive PLC | | 73 352 | 6,6 | | | | 6,6 |
| Delta Air Lines Inc | | 323 806 | 21,4 | | | | 21,4 |
| Delta Brac Housing Finance Corp Ltd | | 955 868 | 1,7 | | | | 1,7 |
| Delta Electronics Inc | | 2 645 354 | 17,6 | | | | 17,6 |
| Delta Electronics Thailand PCL | | 1 639 655 | 5,0 | | | | 5,0 |

| | | | | | |
|--|----------|------------|-------|-------|-------|
| Denso Corp | | 376 097 | 21,9 | | 21,9 |
| DENTSPLY SIRONA Inc | | 30 008 | 2,3 | | 2,3 |
| Dentsu Inc | | 1 800 | 0,1 | | 0,1 |
| DEQ Systèmes Corp | | 6 907 000 | 2,6 | | 2,6 |
| Deutsche Bank AG | | 896 740 | 21,9 | | 21,9 |
| Deutsche Boerse AG | | 23 805 | 2,6 | | 2,6 |
| Deutsche Lufthansa AG | | 984 550 | 17,1 | | 17,1 |
| Deutsche Post AG | | 787 775 | 34,8 | | 34,8 |
| Deutsche Telekom AG | | 3 407 237 | 78,8 | | 78,8 |
| Deutsche Wohnen AG | | 38 512 | 1,6 | | 1,6 |
| Devon Energy Corp | | 375 923 | 23,0 | | 23,0 |
| Dexus Property Group | | 197 034 | 1,8 | | 1,8 |
| DGAM CDP Unique Strategies | | 4 269 | 4,3 | | 4,3 |
| DGB Financial Group Inc | | 509 728 | 5,5 | | 5,5 |
| Diageo PLC | | 15 912 965 | 556,4 | | 556,4 |
| Dialog Group BHD | | 10 421 125 | 4,8 | | 4,8 |
| Dick's Sporting Goods Inc | | 35 800 | 2,5 | | 2,5 |
| DiGi.Com Bhd | | 2 937 732 | 4,2 | | 4,2 |
| Digital China Holdings Ltd | | 858 000 | 0,9 | | 0,9 |
| Digital Realty Trust Inc | | 59 200 | 7,8 | | 7,8 |
| Dime Community Bancshares Inc | | 100 200 | 2,7 | | 2,7 |
| Direcional Engenharia SA | | 794 000 | 1,5 | | 1,5 |
| Direct Line Insurance Group PLC | | 429 202 | 2,6 | | 2,6 |
| Dis-Chem Pharmacies Ltd | | 1 155 742 | 2,5 | | 2,5 |
| Discover Financial Services | | 60 489 | 5,8 | | 5,8 |
| Discovery Communications Inc | classe A | 64 342 | 2,4 | 2,4 | |
| | classe C | 96 739 | 3,5 | 3,5 | 5,9 |
| Discovery Ltd | | 963 489 | 10,8 | | 10,8 |
| DISH Network Corp | | 62 500 | 4,9 | | 4,9 |
| Distribuidora Internacional de Alimentacion SA | | 548 776 | 3,6 | | 3,6 |
| Divi's Laboratories Ltd | | 421 719 | 6,5 | | 6,5 |
| Dixons Carphone PLC | | 418 396 | 2,5 | | 2,5 |
| DMCI Holdings Inc | | 13 144 040 | 4,7 | | 4,7 |
| DNB ASA | | 831 601 | 16,6 | | 16,6 |
| Doha Bank QSC | | 426 807 | 5,5 | | 5,5 |
| Dollar General Corp | | 1 242 356 | 123,4 | | 123,4 |
| Dollar Tree Inc | | 3 273 | 0,3 | 269,1 | 269,4 |
| Dollarama Inc | | 6 340 000 | 623,7 | | 623,7 |
| Dominion Resources Inc | | 688 845 | 70,8 | | 70,8 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|---|-------------|-----------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Domino's Pizza Enterprises Ltd | | 4 129 | 0,3 | | | | 0,3 |
| Domino's Pizza Inc | | 5 100 | 1,1 | | | | 1,1 |
| Don Quijote Holdings Co Ltd | | 38 100 | 1,9 | | | | 1,9 |
| DONG Energy A/S | | 81 783 | 4,2 | | | | 4,2 |
| Dongbu Insurance Co Ltd | | 170 441 | 11,8 | | | | 11,8 |
| Dongfeng Motor Group Co Ltd | | 7 581 574 | 9,9 | | | | 9,9 |
| Dongsuh Cos Inc | | 105 184 | 3,2 | | | | 3,2 |
| Doosan Corp | | 14 730 | 1,7 | | | | 1,7 |
| Doosan Heavy Industries & Construction Co Ltd | | 58 932 | 1,8 | | | | 1,8 |
| Doosan Infracore Co Ltd | | 615 765 | 6,0 | | | | 6,0 |
| Dorsal Capital Partners LP | | 1 | 189,4 | | | | 189,4 |
| DoubleUGames Co Ltd | | 110 064 | 4,9 | | | | 4,9 |
| Dover Corp | | 56 900 | 5,7 | | | | 5,7 |
| Dow Chemical Company, The | | 701 834 | 53,9 | | | | 53,9 |
| Downer EDI Ltd | | 600 000 | 3,5 | | | | 3,5 |
| DP World Ltd | | 612 977 | 14,4 | | | | 14,4 |
| DR Horton Inc | | 56 684 | 2,1 | | | | 2,1 |
| Dr Pepper Snapple Group Inc | | 45 545 | 5,5 | | | | 5,5 |
| Dr Reddy's Laboratories Ltd | | 251 335 | 15,2 | | | | 15,2 |
| Drake Global Opportunities Fund Ltd, The | | 147 | 0,2 | | | | 0,2 |
| Dryden 34 Senior Loan Fund | | | | | 134,4 | | 134,4 |
| DSAM Neutral LP | | 1 | 167,8 | | | | 167,8 |
| DSV AS | | 226 198 | 13,5 | | | | 13,5 |
| DTE Energy Co | | 251 769 | 33,3 | | | | 33,3 |
| Dubai Islamic Bank PJSC | | 4 165 672 | 8,5 | | | | 8,5 |
| DUET Group | | 2 573 221 | 6,8 | | | | 6,8 |
| Dufry AG | | 14 188 | 2,4 | | | | 2,4 |
| Duke Energy Corp | | 936 353 | 97,5 | | | | 97,5 |
| Duke Realty Corp | | 41 300 | 1,5 | | | | 1,5 |
| Dun & Bradstreet Corp, The | | 6 625 | 1,1 | | | | 1,1 |
| Dune Capital International Ltd | | 291 | - | | | | - |
| Duni AB | | 40 000 | 0,7 | | | | 0,7 |
| Duratex SA | | 561 855 | 1,6 | | | | 1,6 |

| | | | | |
|---|------------|-------|-------|-------|
| DXB Entertainments PJSC | 10 789 237 | 5,1 | | 5,1 |
| DXP Enterprises Inc | 152 955 | 7,1 | | 7,1 |
| E*TRADE Financial Corp | 38 576 | 1,8 | | 1,8 |
| E.ON SE | 6 206 251 | 58,8 | | 58,8 |
| E.Sun Financial Holding Co Ltd | 22 132 268 | 16,9 | | 16,9 |
| East Japan Railway Co | 308 196 | 35,8 | | 35,8 |
| Eastern Tobacco | 38 571 | 0,8 | | 0,8 |
| Eastmain Resources Inc | 2 937 229 | 1,5 | | 1,5 |
| Eastman Chemical Co | 42 695 | 4,3 | | 4,3 |
| easyJet PLC | 205 886 | 3,4 | | 3,4 |
| Eaton Corp PLC | 218 333 | 19,6 | | 19,6 |
| Eaton Vance Corp | 13 500 | 0,8 | | 0,8 |
| Ebara Corp | 264 030 | 10,1 | | 10,1 |
| eBay Inc | 443 800 | 17,7 | | 17,7 |
| Eclat Textile Co Ltd | 78 507 | 1,1 | | 1,1 |
| Ecolab Inc | 36 082 | 5,7 | | 5,7 |
| Ecopetrol SA | 14 575 346 | 9,0 | | 9,0 |
| Edan Instruments Inc | 2 813 400 | 5,2 | | 5,2 |
| Edenred | 68 590 | 1,8 | | 1,8 |
| Edgewell Personal Care Co | 25 700 | 2,5 | | 2,5 |
| Edison International | 445 879 | 43,0 | | 43,0 |
| EDP - Energias de Portugal SA | 5 866 488 | 24,0 | | 24,0 |
| EDP - Energias do Brasil SA | 726 791 | 4,0 | | 4,0 |
| Edwards Lifesciences Corp | 22 502 | 2,8 | | 2,8 |
| Egyptian International Pharmaceuticals EIPICO | 235 688 | 1,5 | | 1,5 |
| El du Pont de Nemours & Co | 199 455 | 19,6 | | 19,6 |
| Eicher Motors Ltd | 20 364 | 8,8 | | 8,8 |
| Eiffage SA | 76 209 | 7,1 | | 7,1 |
| Eisai Co Ltd | 242 896 | 18,7 | | 18,7 |
| El Puerto de Liverpool SAB de CV | 324 458 | 3,2 | | 3,2 |
| Electric Power Development Co Ltd | 307 965 | 9,5 | | 9,5 |
| Électricité de France SA | 4 258 828 | 58,3 | 229,2 | 287,5 |
| Electricity Generating PCL | 560 487 | 4,2 | | 4,2 |
| Electrolux AB | 146 405 | 4,9 | | 4,9 |
| Electronic Arts Inc | 5 940 | 0,6 | | 0,6 |
| Eli Lilly & Co | 472 500 | 46,6 | | 46,6 |
| Elior Group | 11 299 435 | 347,1 | | 347,1 |
| Elisa OYJ | 59 776 | 2,6 | | 2,6 |
| Ellie Mae Inc | 100 906 | 11,3 | | 11,3 |

au 31 décembre 2016

(juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|--|-------------|-------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| ElSewedy Electric Co | | 670 645 | 3,7 | | | | 3,7 |
| Emaar Malls PJSC | | 6 581 586 | 6,3 | | | | 6,3 |
| Emaar Properties PJSC | | 11 827 958 | 30,8 | | | | 30,8 |
| E-MART Inc | | 70 599 | 14,3 | | | | 14,3 |
| Embotelladora Andina SA | | 766 501 | 3,8 | | | | 3,8 |
| Embraer SA | | 516 257 | 3,4 | | | | 3,4 |
| Emera Inc | | 49 660 | 2,3 | | | | 2,3 |
| Emerson Electric Co | | 356 183 | 26,6 | | | | 26,6 |
| Emirates Telecommunications Group Co PJSC | | 5 864 117 | 40,3 | | | | 40,3 |
| Emlak Konut Gayrimenkul Yatirim Ortakligi AS | | 3 842 031 | 4,4 | | | | 4,4 |
| Empresa Distribuidora Y Comercializadora Norte | | 241 074 | 9,0 | | | | 9,0 |
| Empresa Nacional de Electricidad SA | | 14 614 321 | 12,9 | | | | 12,9 |
| Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA | | 444 552 | 6,3 | | | | 6,3 |
| Empresas CMPC SA | | 3 680 294 | 10,1 | | | | 10,1 |
| Empresas COPEC SA | | 1 339 455 | 17,2 | | | | 17,2 |
| EMS-Chemie Holding AG | | 2 926 | 2,0 | | | | 2,0 |
| Enagas SA | | 328 782 | 11,2 | | | | 11,2 |
| Enbridge Energy Partners, L.P. | | | | | 40,1 | | 40,1 |
| Enbridge Inc | | 7 397 169 | 417,9 | | 264,6 | | 682,5 |
| Enbridge Income Fund Holdings Inc | | | | | 113,0 | | 113,0 |
| Enbridge Pipelines Inc | | | | | 95,0 | | 95,0 |
| Endesa SA | | 1 126 961 | 32,1 | | | | 32,1 |
| Endo International PLC | | 174 568 | 3,9 | | | | 3,9 |
| Enel Americas SA | | 125 714 403 | 27,5 | | | | 27,5 |
| Enel Chile SA | | 84 638 844 | 10,5 | | | | 10,5 |
| Enel SpA | | 16 877 578 | 100,0 | | | | 100,0 |
| Energa SA | | 640 000 | 1,9 | | | | 1,9 |
| Energisa SA | | 937 300 | 7,2 | | | | 7,2 |
| Energy Absolute PCL | | 3 677 878 | 4,1 | | | | 4,1 |
| Energy Development Corp | | 36 230 492 | 5,0 | | | | 5,0 |
| Engie Brasil Energia SA | | 201 603 | 2,9 | | | | 2,9 |
| Engie SA | | 4 510 174 | 77,3 | | | | 77,3 |
| Eni SpA | | 3 246 671 | 71,0 | | | | 71,0 |

| | | | |
|--|-----------|-------|-------|
| ENN Energy Holdings Ltd | 3 052 520 | 16,8 | 16,8 |
| Entergy Corp | 346 606 | 34,2 | 34,2 |
| Entreprise Minière Nouveau Monde | 4 106 736 | 0,9 | 0,9 |
| Entreprises minières Globex Inc | 1 729 000 | 0,7 | 0,7 |
| Envestnet Inc | 205 436 | 9,7 | 9,7 |
| Envision Healthcare Corp | 50 571 | 4,3 | 4,3 |
| EOG Resources Inc | 209 | - | - |
| EPCOR Utilities Inc | | | 95,2 |
| EQT Corp | 25 837 | 2,3 | 2,3 |
| Equatorial Energia SA | 647 406 | 14,5 | 14,5 |
| Equifax Inc | 37 870 | 6,0 | 6,0 |
| Equinix Inc | 4 616 | 2,2 | 2,2 |
| Equity Group Holdings Ltd | 6 007 100 | 2,4 | 2,4 |
| Equity Residential | 121 791 | 10,5 | 10,5 |
| Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS | 3 340 598 | 6,5 | 6,5 |
| Erste Group Bank AG | 113 916 | 4,5 | 4,5 |
| Essex Property Trust Inc | 46 417 | 14,5 | 14,5 |
| Essilor International SA | 102 814 | 15,6 | 15,6 |
| Estee Lauder Cos Inc, The | 6 779 | 0,7 | 0,7 |
| Eurazeo SA | 22 577 | 1,8 | 1,8 |
| Eurobank Ergasias SA | 3 328 688 | 3,0 | 3,0 |
| Eurocash SA | 137 001 | 1,7 | 1,7 |
| EUROFIMA | | | 101,6 |
| Eurofins Scientific SE | 606 061 | 347,2 | 347,2 |
| Euronet Worldwide Inc | 135 088 | 13,1 | 13,1 |
| Eutelsat Communications SA | 220 789 | 5,7 | 5,7 |
| Eva Airways Corp | 1 409 727 | 0,9 | 0,9 |
| Everest Re Group Ltd | 9 100 | 2,6 | 2,6 |
| Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd | 541 457 | 0,3 | 0,3 |
| Eversource Energy | 424 700 | 31,5 | 31,5 |
| Evonik Industries AG | 201 578 | 8,1 | 8,1 |
| Exelon Corp | 1 479 465 | 70,4 | 70,4 |
| Exide Industries Ltd | 3 303 882 | 11,8 | 11,8 |
| EXOR NV | 33 535 | 1,9 | 1,9 |
| Expedia Inc | 83 211 | 12,6 | 12,6 |
| Expeditors International of Washington Inc | 41 633 | 3,0 | 3,0 |
| Experian PLC | 1 115 975 | 29,1 | 29,1 |
| Exploration Azimut Inc | 3 127 803 | 1,0 | 1,0 |
| Exploration Dios Inc | 4 978 436 | 0,4 | 0,4 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|---|-------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Exploration Knick Inc | | 4 226 819 | 0,2 | | | | 0,2 |
| Exploration Midland Inc | | 6 790 106 | 7,5 | | | | 7,5 |
| Exploration Puma Inc | | 9 634 177 | 0,8 | | | | 0,8 |
| Exploration Typhon Inc | | 1 967 500 | 0,2 | | | | 0,2 |
| Explorations Matamec Inc | | 1 517 250 | 0,1 | | | | 0,1 |
| Export-Import Bank of Korea | | | | | 177,6 | | 177,6 |
| Express Scripts Holding Co | | 40 769 | 3,8 | | | | 3,8 |
| Extra Space Storage Inc | | 7 936 | 0,8 | | | | 0,8 |
| Exxaro Resources Ltd | | 1 396 194 | 12,3 | | | | 12,3 |
| Exxon Mobil Corp | | 5 912 515 | 715,7 | | | | 715,7 |
| Ez Tec Empreendimentos e Participacoes SA | | 1 001 601 | 6,5 | | | | 6,5 |
| Ezaki Glico Co Ltd | | 130 000 | 8,2 | | | | 8,2 |
| Ezdan Holding Group QSC | | 2 682 840 | 14,9 | | | | 14,9 |
| F5 Networks Inc | | 21 139 | 4,1 | | | | 4,1 |
| Facebook Inc | | 1 128 792 | 174,2 | | | | 174,2 |
| Fairfax Financial Holdings Ltd | | | | | 194,7 | | 194,7 |
| Fairfax Media Ltd | | 7 020 733 | 6,1 | | | | 6,1 |
| Fairwood Holdings Ltd | | 297 000 | 1,5 | | | | 1,5 |
| Falco Resources Ltd | | 1 632 366 | 1,5 | | | | 1,5 |
| FamilyMart UNY Holdings Co Ltd | | 1 268 | 0,1 | | | | 0,1 |
| Fanhua Inc | | 309 706 | 3,4 | | | | 3,4 |
| FANUC Corp | | 1 791 065 | 408,1 | | | | 408,1 |
| Far East Horizon Ltd | | 4 546 978 | 5,2 | | | | 5,2 |
| Far Eastern New Century Corp | | 10 796 627 | 10,9 | | | | 10,9 |
| Far EasTone Telecommunications Co Ltd | | 5 677 271 | 17,1 | | | | 17,1 |
| Fast Retailing Co Ltd | | 98 318 | 47,3 | | | | 47,3 |
| Fastenal Co | | 9 682 | 0,6 | | | | 0,6 |
| Federal Realty Investment Trust | | 58 421 | 11,1 | | | | 11,1 |
| FedEx Corp | | 81 100 | 20,3 | | | | 20,3 |
| Felda Global Ventures Holdings Bhd | | 1 935 341 | 0,9 | | | | 0,9 |
| Feng TAY Enterprise Co Ltd | | 320 986 | 1,6 | | | | 1,6 |
| Ferrari NV | | 28 201 | 2,2 | | | | 2,2 |
| Ferrovial SA | | 341 290 | 8,2 | | | | 8,2 |

| | | | |
|--|------------|-------|-------|
| FF Group | 59 980 | 1,6 | 1,6 |
| Fiat Chrysler Automobiles NV | 4 401 729 | 53,9 | 53,9 |
| Fiberhome Telecommunication Technologies Co Ltd | 4 079 916 | 19,8 | 19,8 |
| Fibra Shop Portafolios Inmobiliarios SAPI de CV | 8 740 861 | 7,3 | 7,3 |
| Fibra Uno Administracion SA de CV | 28 116 516 | 58,1 | 58,1 |
| Fibria Celulose SA | 128 547 | 1,7 | 1,7 |
| Fidelity National Information Services Inc | 89 733 | 9,1 | 9,1 |
| Fiducie de capital Banque Scotia | | | 43,3 |
| Fifth Third Bancorp | 180 390 | 6,5 | 6,5 |
| Financial Engines Inc | 289 793 | 14,3 | 14,3 |
| Financière Sun Life du Canada, Inc | | | 224,3 |
| Finning International Inc | 550 000 | 14,5 | 14,5 |
| First Asset Morningstar National Bank Québec Index ETF | 1 506 061 | 27,0 | 27,0 |
| First Financial Holding Co Ltd | 23 055 256 | 16,5 | 16,5 |
| First Gulf Bank PJSC | 3 034 392 | 14,2 | 14,2 |
| First Pacific Co Ltd | 2 188 250 | 2,1 | 2,1 |
| First Republic Bank | 13 100 | 1,6 | 1,6 |
| FirstEnergy Corp | 730 493 | 30,3 | 30,3 |
| FirstRand Ltd | 12 439 378 | 64,9 | 64,9 |
| Fiserv Inc | 38 721 | 5,5 | 5,5 |
| FleetCor Technologies Inc | 13 000 | 2,5 | 2,5 |
| Fletcher Building Ltd | 295 700 | 2,9 | 2,9 |
| Fleury SA | 1 467 300 | 21,6 | 21,6 |
| Flex Ltd | 671 300 | 12,9 | 12,9 |
| Flight Centre Travel Group Ltd | 44 192 | 1,3 | 1,3 |
| FLIR Systems Inc | 46 300 | 2,2 | 2,2 |
| Flowserve Corp | 106 901 | 6,9 | 6,9 |
| Fluor Corp | 94 500 | 6,7 | 6,7 |
| FMC Corp | 24 417 | 1,9 | 1,9 |
| FMC Technologies Inc | 166 046 | 7,9 | 7,9 |
| FNF Group | 47 600 | 2,2 | 2,2 |
| Fomento Economico Mexicano SAB de CV | 5 264 720 | 54,0 | 54,0 |
| Foncière des Régions | 14 216 | 1,7 | 1,7 |
| Fonds d'Arbitrage Améthyste Offshore | 13 080 | 46,3 | 46,3 |
| Fonds de placement immobilier Cominar | 8 458 000 | 124,5 | 124,5 |
| Fonds de placement immobilier RioCan | 182 900 | 4,9 | 4,9 |
| Fonds PGEQ II Sec | 6 500 000 | 62,8 | 62,8 |
| Foot Locker Inc | 34 700 | 3,3 | 3,3 |
| Forage Orbit Garant Inc | 3 200 000 | 5,8 | 5,8 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|--|-------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Ford Credit Canada Ltd | | | | | 262,5 | | 262,5 |
| Ford Motor Company | | 2 373 600 | 38,6 | | | | 38,6 |
| Ford Otomotiv Sanayi AS | | 530 016 | 6,2 | | | | 6,2 |
| Forest City Realty Trust Inc | | 218 900 | 6,1 | | | | 6,1 |
| Formosa Chemicals & Fibre Corp | | 11 114 530 | 44,5 | | | | 44,5 |
| Formosa International Hotels Corp | | 157 000 | 1,1 | | | | 1,1 |
| Formosa Petrochemical Corp | | 2 629 122 | 12,3 | | | | 12,3 |
| Formosa Plastics Corp | | 14 440 990 | 53,6 | | | | 53,6 |
| Formosa Taffeta Co Ltd | | 2 491 972 | 3,1 | | | | 3,1 |
| Fort GL Contrarian | | 1 | 208,6 | | | | 208,6 |
| Fortescue Metals Group Ltd | | 1 060 | - | | | | - |
| Fortinet Inc | | 16 800 | 0,7 | | | | 0,7 |
| Fortis Inc | | 398 658 | 16,5 | | | | 16,5 |
| Fortive Corp | | 26 100 | 1,9 | | | | 1,9 |
| Fortress Income Fund Ltd | | 2 058 587 | 6,5 | | | 6,5 | |
| | classe A | 2 575 217 | 4,2 | | | 4,2 | 10,7 |
| Fortum OYJ | | 1 172 560 | 24,2 | | | | 24,2 |
| Fortune Brands Home & Security Inc | | 27 600 | 2,0 | | | | 2,0 |
| Fortune Real Estate Investment Trust | | 3 806 000 | 5,9 | | | | 5,9 |
| Foschini Group Limited, The | | 1 011 247 | 15,8 | | | | 15,8 |
| Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd | | 748 748 | 4,2 | | | | 4,2 |
| Fosun International Ltd | | 6 650 704 | 12,6 | | | | 12,6 |
| Fox Factory Holding Corp | | 318 358 | 11,8 | | | | 11,8 |
| Foxconn Technology Co Ltd | | 1 749 721 | 6,2 | | | | 6,2 |
| Franco-Nevada Corp | | 28 500 | 2,3 | | | | 2,3 |
| Franklin Emerging Market Debt Opportunities Fund | | | | | 280,8 | | 280,8 |
| Franklin Resources Inc | | 166 921 | 8,9 | | | | 8,9 |
| Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide | | 93 188 | 7,4 | | | | 7,4 |
| Frasers Logistics & Industrial Trust | | 4 743 700 | 4,1 | | | | 4,1 |
| Freenet AG | | 188 500 | 7,1 | | | | 7,1 |
| Freeport-McMoRan Inc | | 434 400 | 7,7 | | | | 7,7 |
| Fresenius Medical Care AG & Co KGaA | | 113 294 | 12,9 | | | | 12,9 |
| Fresenius SE & Co KGaA | | 239 889 | 25,2 | | | | 25,2 |
| Fresnillo PLC | | 259 510 | 5,3 | | | | 5,3 |

| | | | | | |
|--|----------|------------|---------|------|---------|
| Frontier Communications Corp | | 2 480 493 | 11,2 | | 11,2 |
| FS Media Holding Co (Jersey) Limited | | 1 | 0,3 | | 0,3 |
| Fubon Financial Holding Co Ltd | | 25 058 769 | 53,2 | | 53,2 |
| Fuchs Petrolub SE | | 24 040 | 1,4 | | 1,4 |
| Fuji Electric Co Ltd | | 505 808 | 3,5 | | 3,5 |
| Fuji Heavy Industries Ltd | | 823 328 | 45,2 | | 45,2 |
| FUJIFILM Holdings Corporation | | 322 261 | 16,4 | | 16,4 |
| Fujitsu Ltd | | 3 457 639 | 25,8 | | 25,8 |
| Fukuoka Financial Group Inc | | 336 612 | 2,0 | | 2,0 |
| Fullshare Holdings Ltd | | 7 889 500 | 4,9 | | 4,9 |
| Fuyao Glass Industry Group Co Ltd | classe A | 2 506 570 | 9,0 | 9,0 | |
| | classe H | 1 106 040 | 4,6 | 4,6 | 13,6 |
| G4S PLC | | 1 802 924 | 7,0 | | 7,0 |
| GAIL India Ltd | | 2 628 420 | 22,8 | | 22,8 |
| Galaxy Entertainment Group Ltd | | 76 119 | 0,4 | | 0,4 |
| Galenica AG | | 1 835 | 2,8 | | 2,8 |
| Galp Energia SGPS SA | | 333 587 | 6,7 | | 6,7 |
| Gamuda Bhd | | 5 567 428 | 8,0 | | 8,0 |
| Gap Inc, The | | 38 400 | 1,2 | | 1,2 |
| Garmin Ltd | | 63 300 | 4,1 | | 4,1 |
| Gartner Inc | | 8 500 | 1,2 | | 1,2 |
| Gas Natural SDG SA | | 1 263 614 | 32,0 | | 32,0 |
| Gazprom PJSC | | 30 571 455 | 103,7 | | 103,7 |
| GCL-Poly Energy Holdings Ltd | | 27 953 205 | 4,5 | | 4,5 |
| GEA Group AG | | 50 928 | 2,8 | | 2,8 |
| Geberit AG | | 5 823 | 3,1 | | 3,1 |
| Gecina SA | | 14 529 973 | 2 701,6 | | 2 701,6 |
| Geely Automobile Holdings Ltd | | 12 183 144 | 15,6 | | 15,6 |
| Gemalto NV | | 79 591 | 6,2 | | 6,2 |
| General Dynamics Corp | | 118 097 | 27,3 | | 27,3 |
| General Electric Co | | 3 019 499 | 128,0 | | 128,0 |
| General Growth Properties Inc | | 966 234 | 32,4 | | 32,4 |
| General Mills Inc | | 42 075 | 3,5 | | 3,5 |
| General Motors Co | | 4 837 000 | 226,0 | | 226,0 |
| General Motors Financial of Canada Ltd | | | | 89,2 | 89,2 |
| Genmab A/S | | 1 724 | 0,4 | | 0,4 |
| Gentera SAB de CV | | 1 700 674 | 3,7 | | 3,7 |
| Gentex Corp | | 24 689 | 0,7 | | 0,7 |
| Gentherm Inc | | 325 797 | 14,8 | | 14,8 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|---|-------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Genting Bhd | | 7 931 779 | 19,0 | | | | 19,0 |
| Genting Malaysia Bhd | | 9 757 575 | 13,4 | | | | 13,4 |
| Genting Plantations Bhd | | 780 527 | 2,5 | | | | 2,5 |
| Genting Singapore PLC | | 4 654 000 | 3,9 | | | | 3,9 |
| Genuine Parts Co | | 2 058 115 | 263,7 | | | | 263,7 |
| George Weston Limitée | | | | | 28,6 | | 28,6 |
| GeoVenCap Inc | | 166 895 | - | | | | - |
| Gerdau SA | | 3 771 643 | 16,8 | | | | 16,8 |
| Gespeg Copper Resources Inc | | 3 560 000 | 0,1 | | | | 0,1 |
| Getinge AB | | 140 264 | 3,0 | | | | 3,0 |
| GF Securities Co Ltd | | 3 133 910 | 8,8 | | | | 8,8 |
| GFK Resources | | 1 937 000 | 0,2 | | | | 0,2 |
| Giant Manufacturing Co Ltd | | 143 456 | 1,1 | | | | 1,1 |
| Gibson Energy Inc | | | | | 53,5 | | 53,5 |
| Gilead Sciences Inc | | 788 901 | 75,8 | | | | 75,8 |
| Givaudan SA | | 1 393 | 3,4 | | | | 3,4 |
| Gjensidige Forsikring ASA | | 16 841 874 | 359,5 | | | | 359,5 |
| GKN PLC | | 846 510 | 4,7 | | | | 4,7 |
| GlaxoSmithKline PLC | | 34 288 302 | 887,5 | | | | 887,5 |
| Glencore PLC | | 22 087 702 | 101,5 | | | | 101,5 |
| Glenmark Pharmaceuticals Ltd | | 211 250 | 3,7 | | | | 3,7 |
| Glitnir HoldCo ehf | | | | | - | | - |
| Global Logistic Properties Ltd | | 6 180 966 | 12,6 | | | | 12,6 |
| Global Payments Inc | | 15 600 | 1,5 | | | | 1,5 |
| Global Telecom Holding SAE | | 8 844 112 | 4,7 | | | | 4,7 |
| Globant SA | | 81 063 | 3,6 | | | | 3,6 |
| Globe Telecom Inc | | 109 528 | 4,5 | | | | 4,5 |
| Globus Medical Inc | | 362 222 | 12,1 | | | | 12,1 |
| Glow Energy PCL | | 2 180 486 | 6,5 | | | | 6,5 |
| GMO Emerging Country Local Debt Investment Fund | | | | | 314,8 | | 314,8 |
| GMO Emerging Markets Fund | | | | | 297,4 | | 297,4 |
| Godrej Consumer Products Ltd | | 359 627 | 10,7 | | | | 10,7 |
| Godrej Industries Ltd | | 844 166 | 7,2 | | | | 7,2 |

| | | | | |
|--|------------|---------|------|---------|
| Godrej Properties Ltd | 576 443 | 3,5 | | 3,5 |
| GoerTek Inc | 11 479 036 | 58,7 | | 58,7 |
| Gold Fields Ltd | 2 876 549 | 12,3 | | 12,3 |
| Goldcorp Inc | 10 045 922 | 183,6 | | 183,6 |
| Golden Agri-Resources Ltd | 16 356 984 | 6,5 | | 6,5 |
| Goldman Sachs Group, Inc., The | 175 144 | 56,3 | 57,6 | 113,9 |
| GoldStar Minerals Inc | 445 000 | - | | - |
| GOME Electrical Appliances Holding Ltd | 35 173 003 | 5,7 | | 5,7 |
| Goodman Group | 1 042 407 | 7,2 | | 7,2 |
| Goodyear Tire & Rubber Company, The | 158 600 | 6,6 | | 6,6 |
| GoviEx Uranium Inc | 2 490 500 | 0,4 | | 0,4 |
| GPT Group, The | 1 429 676 | 7,0 | | 7,0 |
| Graham Absolute Return Fund Ltd | 326 500 | 220,9 | | 220,9 |
| Grand Canyon Education Inc | 346 855 | 27,2 | | 27,2 |
| Grandblue Environment Co Ltd | 6 912 590 | 19,2 | | 19,2 |
| Great Portland Estates PLC | 1 277 100 | 14,1 | | 14,1 |
| Great Wall Motor Co Ltd | 7 537 645 | 9,4 | | 9,4 |
| Great-West Lifeco Inc | 16 400 000 | 576,8 | 49,6 | 626,4 |
| Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai | 1 167 200 | 5,5 | | 5,5 |
| Greencore Group PLC | 1 665 907 | 6,8 | | 6,8 |
| Grifols SA | 261 909 | 7,0 | | 7,0 |
| Groupe Bruxelles Lambert SA | 97 080 | 10,9 | | 10,9 |
| Groupe Canam Inc | 2 310 000 | 20,8 | | 20,8 |
| Groupe CGI Inc | 51 061 663 | 3 290,4 | | 3 290,4 |
| Groupe Colabor Inc | 8 499 121 | 11,2 | | 11,2 |
| Groupe Eurotunnel SA | 559 649 | 7,2 | | 7,2 |
| Groupe HNZ Inc | 1 264 600 | 17,0 | | 17,0 |
| Groupe SNC-Lavalin Inc | 18 504 200 | 1 069,4 | | 1 069,4 |
| Groupe Stingray Digital Inc | 2 623 100 | 22,8 | | 22,8 |
| Groupe TMX Limitée | 2 845 267 | 203,5 | | 203,5 |
| Groupe WSP Global Inc | 18 532 889 | 828,2 | | 828,2 |
| Growthpoint Properties Ltd | 6 387 728 | 16,2 | | 16,2 |
| Gruma SAB de CV | 1 244 695 | 21,3 | | 21,3 |
| Grupa Azoty SA | 79 968 | 1,6 | | 1,6 |
| Grupa Lotos SA | 165 517 | 2,0 | | 2,0 |
| Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV | 966 491 | 10,7 | | 10,7 |
| Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV | 561 566 | 10,9 | | 10,9 |
| Grupo Argos SA | 857 972 | 7,4 | | 7,4 |
| Grupo Aval Acciones y Valores SA | 10 360 905 | 5,6 | | 5,6 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|---|-----------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Grupo Bimbo SAB de CV | | 3 090 675 | 9,5 | | | | 9,5 |
| Grupo Carso SAB de CV | | 980 648 | 5,3 | | | | 5,3 |
| Grupo de Inversiones Suramericana SA | | 692 821 | 11,8 | | | 11,8 | |
| | privilégiées | 298 464 | 4,9 | | | 4,9 | 16,7 |
| Grupo Financiero Banorte SAB de CV | | 4 851 467 | 32,3 | | | | 32,3 |
| Grupo Financiero Inbursa SAB de CV | | 4 724 552 | 9,6 | | | | 9,6 |
| Grupo Financiero Interacciones SA de CV | | 2 102 146 | 11,1 | | | | 11,1 |
| Grupo Financiero Santander Mexico SAB de CV | | 3 883 281 | 7,5 | | | | 7,5 |
| Grupo Herdez SAB de CV | | 1 681 930 | 4,1 | | | | 4,1 |
| Grupo Lala SAB de CV | | 1 070 839 | 2,1 | | | | 2,1 |
| Grupo Lamosa SAB de CV | | 3 400 075 | 8,8 | | | | 8,8 |
| Grupo Mexico SAB de CV | | 12 485 517 | 45,9 | | | | 45,9 |
| Grupo Rotoplas SAB de CV | | 4 971 473 | 8,6 | | | | 8,6 |
| Grupo Supervielle SA | | 392 534 | 6,9 | | | | 6,9 |
| Grupo Televisa SAB | | 733 794 | 20,6 | | | 20,6 | |
| | unités de fonds | 4 715 235 | 26,6 | | | 26,6 | 47,2 |
| GS Engineering & Construction Corp | | 16 647 | 0,5 | | | | 0,5 |
| GS Holdings Corp | | 180 266 | 10,8 | | | | 10,8 |
| GS Retail Co Ltd | | 31 248 | 1,7 | | | | 1,7 |
| GSO European Senior Debt Feeder Fund LP | | 13 168 245 | 19,0 | | 23,8 | | 42,9 |
| GT Capital Holdings Inc | | 258 865 | 8,9 | | | | 8,9 |
| Guangdong Advertising Group Co Ltd | | 2 876 679 | 7,7 | | | | 7,7 |
| Guangdong Haid Group Co Ltd | | 14 939 361 | 43,4 | | | | 43,4 |
| Guangdong Investment Ltd | | 9 996 204 | 17,7 | | | | 17,7 |
| Guangzhou Automobile Group Co Ltd | | 4 839 328 | 7,9 | | | | 7,9 |
| Guangzhou R&F Properties Co Ltd | | 2 865 229 | 4,6 | | | | 4,6 |
| Gudang Garam Tbk PT | | 1 610 455 | 10,2 | | | | 10,2 |
| Guess? Inc | | 216 464 | 3,5 | | | | 3,5 |
| Gujarat Gas Ltd | | 247 292 | 2,6 | | | | 2,6 |
| H&R Block Inc | | 18 177 081 | 560,4 | | | | 560,4 |
| H2O Innovation Inc | | 5 572 774 | 9,8 | | | | 9,8 |
| Hachijuni Bank Ltd, The | | 186 400 | 1,5 | | | | 1,5 |
| Haci Omer Sabanci Holding AS | | 2 351 999 | 8,2 | | | | 8,2 |
| Haemonetics Corp | | 191 923 | 10,3 | | | | 10,3 |

| | | | | |
|--|------------|------|------|------|
| Haier Electronics Group Co Ltd | 3 861 243 | 8,1 | | 8,1 |
| Haitian International Holdings Ltd | 1 468 939 | 3,9 | | 3,9 |
| Haitong Securities Co Ltd | 7 478 252 | 17,2 | | 17,2 |
| Hakuhodo DY Holdings Inc | 165 150 | 2,7 | | 2,7 |
| Halliburton Co | 145 183 | 10,5 | | 10,5 |
| Hamamatsu Photonics KK | 43 600 | 1,5 | | 1,5 |
| Hammerson PLC | 268 021 | 2,5 | | 2,5 |
| Hana Financial Group Inc | 1 021 501 | 35,4 | | 35,4 |
| Handsome Co Ltd | 81 965 | 3,2 | | 3,2 |
| Hanergy Thin Film Power Group Ltd | 15 984 343 | - | | - |
| Hanesbrands Inc | 62 633 | 1,8 | 25,2 | 27,0 |
| Hang Lung Group Ltd | 550 000 | 2,6 | | 2,6 |
| Hang Lung Properties Ltd | 2 562 825 | 7,3 | | 7,3 |
| Hang Seng Bank Ltd | 348 860 | 8,7 | | 8,7 |
| Hangzhou Hikvision Digital Technology Co Ltd | 9 343 868 | 42,9 | | 42,9 |
| Hangzhou Robam Appliances Co Ltd | 1 873 692 | 13,3 | | 13,3 |
| Hanjaya Mandala Sampoerna Tbk PT | 25 919 500 | 9,9 | | 9,9 |
| Hankook Tire Co Ltd | 248 331 | 16,0 | | 16,0 |
| Hankyu Hanshin Holdings Inc | 334 029 | 14,4 | | 14,4 |
| Hanmi Pharm Co Ltd | 2 290 | 0,8 | | 0,8 |
| Hanmi Science Co Ltd | 7 612 | 0,5 | | 0,5 |
| Hannover Rueck SE | 106 104 | 15,4 | | 15,4 |
| Hanon Systems | 902 433 | 10,3 | | 10,3 |
| Han's Laser Technology Industry Group Co Ltd | 1 515 500 | 6,6 | | 6,6 |
| Hanssem Co Ltd | 34 499 | 7,6 | | 7,6 |
| Hanwha Chemical Corp | 355 393 | 9,7 | | 9,7 |
| Hanwha Life Insurance Co Ltd | 654 554 | 4,7 | | 4,7 |
| Hanwha Techwin Co Ltd | 112 121 | 5,4 | | 5,4 |
| Haoxiangni Jujube Co Ltd | 194 900 | 1,3 | | 1,3 |
| HAP Seng Consolidated Bhd | 2 045 700 | 5,4 | | 5,4 |
| Harbinger Capital Partners Offshore Fund I Ltd | 10 854 | 14,6 | | 14,6 |
| Hargreaves Lansdown PLC | 28 741 | 0,6 | | 0,6 |
| Harley-Davidson Inc | 54 180 | 4,2 | | 4,2 |
| Harman International Industries Inc | 19 151 | 2,9 | | 2,9 |
| Harris Corp | 75 008 | 10,3 | | 10,3 |
| Hartalega Holdings Bhd | 1 842 400 | 2,7 | | 2,7 |
| Hartford Financial Services Group Inc, The | 86 189 | 5,5 | | 5,5 |
| Harvey Norman Holdings Ltd | 363 604 | 1,8 | | 1,8 |
| Hasbro Inc | 24 864 | 2,6 | | 2,6 |

au 31 décembre 2016

(juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|--|--------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Havells India Ltd | | 1 381 884 | 9,3 | | | | 9,3 |
| Haw Par Corp Ltd | | 138 300 | 1,2 | | | | 1,2 |
| HCA Holdings Inc | | 342 900 | 34,0 | | | | 34,0 |
| HCL Technologies Ltd | | 900 498 | 14,7 | | | | 14,7 |
| HCP Inc | | 94 140 | 3,8 | | | | 3,8 |
| HDFC Bank Ltd | | 737 360 | 27,6 | | | | 27,6 |
| Healthscope Ltd | | 2 126 | - | | | | - |
| Hebei Sailhero Environmental Protection High-tech Co Ltd | | 2 193 243 | 6,2 | | | | 6,2 |
| Hecla Mining Co | | 2 162 328 | 15,2 | | | | 15,2 |
| HeidelbergCement AG | | 131 954 | 16,5 | | | | 16,5 |
| HeidelbergCement India Ltd | | 2 519 955 | 5,5 | | | | 5,5 |
| Heineken Holding NV | | 1 193 491 | 111,7 | | | | 111,7 |
| Heineken NV | | 3 013 337 | 303,7 | | | | 303,7 |
| Hellenic Exchanges - Athens Stock Exchange SA | | 684 586 | 4,7 | | | | 4,7 |
| Hellenic Telecommunications Organization SA | | 438 952 | 5,5 | | | | 5,5 |
| Helmerich & Payne Inc | | 34 896 | 3,6 | | | | 3,6 |
| Hemas Holdings PLC | | 1 192 476 | 1,0 | | | | 1,0 |
| Henan Shuanghui Investment & Development Co Ltd | | 1 177 428 | 4,8 | | | | 4,8 |
| Henderson Land Development Co Ltd | | 934 965 | 6,7 | | | | 6,7 |
| Hengan International Group Co Ltd | | 17 988 290 | 177,2 | | | | 177,2 |
| HengTen Networks Group Ltd | | 34 824 000 | 2,3 | | | | 2,3 |
| Henkel AG & Co KGaA | | 187 473 | 26,2 | | | 26,2 | |
| | privilégiées | 70 871 | 11,4 | | | 11,4 | 37,6 |
| Hennes & Mauritz AB | | 508 219 | 19,0 | | | | 19,0 |
| Henry Schein Inc | | 25 707 | 5,2 | | | | 5,2 |
| Herman Miller Inc | | 209 890 | 9,6 | | | | 9,6 |
| Hermes International | | 22 776 | 12,6 | | | | 12,6 |
| Hero MotoCorp Ltd | | 460 156 | 27,7 | | | | 27,7 |
| Héroux-Devtek Inc | | 4 807 395 | 70,7 | | | | 70,7 |
| Hershey Co, The | | 45 503 | 6,3 | | | | 6,3 |
| Hess Corp | | 8 000 | 0,7 | | | | 0,7 |
| Hewlett Packard Enterprise Co | | 4 262 200 | 132,3 | | | | 132,3 |
| Hexagon AB | | 86 274 | 4,1 | | | | 4,1 |
| Hexaware Technologies Ltd | | 879 647 | 3,6 | | | | 3,6 |

| | | | |
|---|------------|-------|-------|
| Highwealth Construction Corp | 684 276 | 1,3 | 1,3 |
| Hikari Tsushin Inc | 3 100 | 0,4 | 0,4 |
| Hikma Pharmaceuticals PLC | 42 064 | 1,3 | 1,3 |
| Hilton Worldwide Holdings Inc | 8 600 | 0,3 | 0,3 |
| Hindalco Industries Ltd | 2 488 264 | 7,6 | 7,6 |
| Hindustan Petroleum Corp Ltd | 823 808 | 7,2 | 7,2 |
| Hindustan Unilever Ltd | 1 524 082 | 24,9 | 24,9 |
| Hino Motors Ltd | 418 500 | 5,7 | 5,7 |
| Hirose Electric Co Ltd | 33 997 | 5,7 | 5,7 |
| Hiroshima Bank Ltd, The | 172 000 | 1,1 | 1,1 |
| Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc | 29 200 | 2,0 | 2,0 |
| Hitachi Chemical Co Ltd | 80 898 | 2,7 | 2,7 |
| Hitachi Construction Machinery Co Ltd | 4 227 | 0,1 | 0,1 |
| Hitachi High-Technologies Corp | 82 428 | 4,5 | 4,5 |
| Hitachi Ltd | 4 697 567 | 34,1 | 34,1 |
| Hitachi Metals Ltd | 182 900 | 3,3 | 3,3 |
| Hiwin Technologies Corp | 82 142 | 0,5 | 0,5 |
| HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd | 7 435 800 | 8,2 | 8,2 |
| HKT Trust & HKT Ltd | 2 514 220 | 4,1 | 4,1 |
| HMS Holdings Corp | 470 314 | 11,5 | 11,5 |
| HOCHTIEF AG | 43 982 | 8,3 | 8,3 |
| Hokuriku Electric Power Co | 229 832 | 3,5 | 3,5 |
| HollyFrontier Corp | 106 300 | 4,7 | 4,7 |
| Hologic Inc | 57 400 | 3,1 | 3,1 |
| Home Depot Inc, The | 268 324 | 48,2 | 48,2 |
| Home Product Center PCL | 12 967 597 | 5,0 | 5,0 |
| Hon Hai Precision Industry Co Ltd | 48 805 158 | 171,0 | 171,0 |
| Honda Motor Co Ltd | 6 462 | 0,3 | 0,3 |
| Honeywell International Inc | 197 563 | 30,7 | 30,7 |
| Hong Kong & China Gas Co Ltd | 10 156 952 | 24,1 | 24,1 |
| Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd | 83 129 | 2,6 | 2,6 |
| Hong Leong Bank Bhd | 2 137 607 | 8,6 | 8,6 |
| Hong Leong Financial Group Bhd | 754 181 | 3,2 | 3,2 |
| Hongfa Technology Co Ltd | 921 204 | 5,7 | 5,7 |
| Hongkong & Shanghai Hotels , The | 1 978 500 | 2,9 | 2,9 |
| Hongkong Land Holdings Ltd | 1 907 100 | 16,2 | 16,2 |
| Hormel Foods Corp | 115 500 | 5,4 | 5,4 |
| Hoshizaki Corp | 9 300 | 1,0 | 1,0 |
| Host Hotels & Resorts Inc | 138 733 | 3,5 | 3,5 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|--------------------------------------|-------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Hotai Motor Co Ltd | | 307 914 | 4,7 | | | | 4,7 |
| Hotel Shilla Co Ltd | | 17 580 | 0,9 | | | | 0,9 |
| Hoteles City Express SAB de CV | | 9 437 979 | 10,5 | | | | 10,5 |
| Housing Development Finance Corp Ltd | | 3 968 305 | 99,0 | | | | 99,0 |
| Hoya Corporation | | 381 909 | 21,6 | | | | 21,6 |
| HP Inc | | 3 327 900 | 66,2 | | | | 66,2 |
| Hrvatski Telekom dd | | 81 727 | 2,6 | | | | 2,6 |
| HSBC Holdings PLC | | 7 072 702 | 77,0 | | 278,2 | | 355,2 |
| HTC Corp | | 317 637 | 1,0 | | | | 1,0 |
| Hua Nan Financial Holdings Co Ltd | | 24 204 091 | 16,4 | | | | 16,4 |
| Huadong Medicine Co Ltd | | 755 026 | 10,5 | | | | 10,5 |
| Huaku Development Co Ltd | | 661 000 | 1,7 | | | | 1,7 |
| Huaneng Power International Inc | | 16 730 196 | 14,9 | | | | 14,9 |
| Huaneng Renewables Corp Ltd | | 13 045 534 | 5,7 | | | | 5,7 |
| Huatai Securities Co Ltd | | 3 363 507 | 8,6 | | | | 8,6 |
| Huayu Automotive Systems Co Ltd | | 3 853 729 | 11,9 | | | | 11,9 |
| Hudaco Industries Ltd | | 213 664 | 2,4 | | | | 2,4 |
| Hudson Pacific Properties Inc | | 442 000 | 20,6 | | | | 20,6 |
| Hugo Boss AG | | 34 263 | 2,8 | | | | 2,8 |
| Hulic Co Ltd | | 50 200 | 0,6 | | | | 0,6 |
| Humana Inc | | 306 000 | 83,7 | | | | 83,7 |
| Humanwell Healthcare Group Co Ltd | | 2 915 300 | 11,2 | | | | 11,2 |
| Huntington Bancshares Inc | | 194 591 | 3,4 | | | | 3,4 |
| Husqvarna AB | | 194 147 | 2,0 | | | | 2,0 |
| Hutchison Port Holdings Trust | | 12 877 250 | 7,5 | | | | 7,5 |
| Hybio Pharmaceutical Co Ltd | | 3 243 561 | 11,3 | | | | 11,3 |
| Hydro One Inc | | | | | 394,8 | | 394,8 |
| Hydro One Ltd | | 178 370 | 4,2 | | | | 4,2 |
| Hyflux Ltd | | 2 775 000 | 1,3 | | | | 1,3 |
| Hyosung Corp | | 74 756 | 12,1 | | | | 12,1 |
| Hypermarcas SA | | 1 164 415 | 12,5 | | | | 12,5 |
| Hyprop Investments Ltd | | 672 208 | 7,7 | | | | 7,7 |
| Hysan Development Co Ltd | | 545 000 | 3,0 | | | | 3,0 |

| | | | | |
|---|--------------|---------|-------|-------|
| Hyundai Department Store Co Ltd | 47 866 | 5,8 | | 5,8 |
| Hyundai Development Co-Engineering & Construction | 170 477 | 8,5 | | 8,5 |
| Hyundai Engineering & Construction Co Ltd | 262 245 | 12,5 | | 12,5 |
| Hyundai Glovis Co Ltd | 62 672 | 10,8 | | 10,8 |
| Hyundai Greenfood Co Ltd | 185 364 | 3,2 | | 3,2 |
| Hyundai Heavy Industries Co Ltd | 103 468 | 16,7 | | 16,7 |
| Hyundai Home Shopping Network Corp | 29 852 | 3,7 | | 3,7 |
| Hyundai Marine & Fire Insurance Co Ltd | 248 389 | 8,7 | | 8,7 |
| Hyundai Mobis Co Ltd | 268 245 | 78,6 | | 78,6 |
| Hyundai Motor Co | 608 997 | 98,7 | 98,7 | |
| | privilégiées | 206 176 | 22,4 | 22,4 |
| Hyundai Steel Co | 291 757 | 18,5 | | 18,5 |
| Hyundai Wia Corp | 57 873 | 4,7 | | 4,7 |
| Iberdrola SA | 8 632 015 | 76,1 | | 76,1 |
| ICA Gruppen AB | 114 344 | 4,7 | | 4,7 |
| Icade | 94 622 | 9,1 | | 9,1 |
| ICICI Bank Ltd | 6 488 061 | 32,7 | | 32,7 |
| ICON PLC | 66 830 | 6,7 | | 6,7 |
| Iconix Brand Group Inc | 319 122 | 4,0 | | 4,0 |
| Idea Cellular Ltd | 1 926 022 | 2,8 | | 2,8 |
| Idearc Inc | 450 000 | - | | - |
| Idemitsu Kosan Co Ltd | 1 179 | - | | - |
| IDEXX Laboratories Inc | 8 100 | 1,3 | | 1,3 |
| IDFC Bank Ltd | 2 074 449 | 2,5 | | 2,5 |
| IGM Financial Inc | | | 156,8 | 156,8 |
| IHH Healthcare Bhd | 6 277 845 | 11,9 | | 11,9 |
| IHI Corp | 1 254 609 | 4,4 | | 4,4 |
| IHS Markit Ltd | 59 126 | 2,8 | | 2,8 |
| Iida Group Holdings Co Ltd | 91 216 | 2,3 | | 2,3 |
| IJM Corp Bhd | 9 469 912 | 9,1 | | 9,1 |
| ILG Inc | 532 819 | 13,0 | | 13,0 |
| Iliad SA | 12 116 | 3,1 | | 3,1 |
| Illinois Tool Works Inc | 91 027 | 14,9 | | 14,9 |
| Illumina Inc | 12 195 | 2,1 | | 2,1 |
| Imerys SA | 102 014 | 10,4 | | 10,4 |
| IMI PLC | 117 507 | 2,0 | | 2,0 |
| Immofinanz AG | 6 023 679 | 15,8 | | 15,8 |
| Immunotec Inc | 10 038 617 | 3,6 | | 3,6 |
| Impala Platinum Holdings Ltd | 2 169 959 | 9,1 | | 9,1 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|---|-------------|-------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Imperial Brands PLC | | 633 739 | 37,2 | | | | 37,2 |
| Imperial Holdings Ltd | | 568 220 | 10,2 | | | | 10,2 |
| Incitec Pivot Ltd | | 43 952 | 0,2 | | | | 0,2 |
| Incyte Corp | | 2 000 | 0,3 | | | | 0,3 |
| Independent Bank Corp | | 99 900 | 9,4 | | | | 9,4 |
| Indiabulls Housing Finance Ltd | | 467 902 | 6,0 | | | | 6,0 |
| Indian Hotels Co Ltd, The | | 4 988 115 | 9,7 | | | | 9,7 |
| Indian Oil Corp Ltd | | 2 188 934 | 14,1 | | | | 14,1 |
| Indocement Tunggal Prakarsa Tbk PT | | 2 572 116 | 3,9 | | | | 3,9 |
| Indoco Remedies Ltd | | 1 017 772 | 5,2 | | | | 5,2 |
| Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT | | 7 665 098 | 6,5 | | | | 6,5 |
| Indofood Sukses Makmur Tbk PT | | 14 428 205 | 11,4 | | | | 11,4 |
| Indorama Ventures PCL | | 4 746 558 | 6,0 | | | | 6,0 |
| IndusInd Bank Ltd | | 800 000 | 17,5 | | | | 17,5 |
| Industria de Diseno Textil SA | | 1 584 603 | 72,7 | | | | 72,7 |
| Industrial & Commercial Bank of China Ltd | | 203 247 411 | 163,5 | | | | 163,5 |
| Industrial Bank Co Ltd | | 8 932 884 | 27,8 | | | | 27,8 |
| Industrial Bank of Korea | | 969 941 | 13,7 | | | | 13,7 |
| Industrias Bachoco SAB de CV | | 395 400 | 2,2 | | | | 2,2 |
| Industrias Penoles SAB de CV | | 286 767 | 7,2 | | | | 7,2 |
| Industrielle Alliance, Assurance et Services Financiers Inc | | 9 803 081 | 523,4 | | 83,9 | | 607,3 |
| Industries Qatar QSC | | 509 932 | 22,1 | | | | 22,1 |
| Industrivarden AB | | 105 492 | 2,6 | | | | 2,6 |
| Infineon Technologies AG | | 352 515 | 8,2 | | | | 8,2 |
| Infosys Ltd | | 5 072 774 | 101,3 | | | | 101,3 |
| Infraestructura Energetica Nova SAB de CV | | 3 879 114 | 22,8 | | | | 22,8 |
| ING Groep NV | | 496 566 | 9,4 | | | | 9,4 |
| Ingenico | | 44 609 | 4,8 | | | | 4,8 |
| Ingersoll-Rand PLC | | 76 203 | 7,7 | | | | 7,7 |
| Ingredion Inc | | 22 100 | 3,7 | | | | 3,7 |
| Inmarsat PLC | | 193 035 | 2,4 | | | | 2,4 |
| Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd | | 5 715 372 | 19,4 | | | | 19,4 |
| Inner Mongolia Yitai Coal Co Ltd | | 895 000 | 1,1 | | | | 1,1 |

| | | | | |
|---|-------------|-------|------|-------|
| Innergex Energie Renouvelable Inc | 10 905 827 | 153,0 | | 153,0 |
| Innogy SE | 135 104 | 6,3 | | 6,3 |
| Innolux Corp | 21 872 699 | 10,6 | | 10,6 |
| Innovente Inc | 5 868 182 | 0,2 | | 0,2 |
| Inpex Corp | 896 200 | 12,1 | | 12,1 |
| Insurance Australia Group Ltd | 2 106 | - | | - |
| Intact Financial Corp | 8 011 743 | 769,9 | | 769,9 |
| Integra Gold Corp | 6 456 000 | 3,6 | | 3,6 |
| Intel Corp | 2 026 800 | 98,6 | | 98,6 |
| Inter Pipeline Ltd | 357 434 | 10,6 | 76,9 | 87,5 |
| Inter RAO UES PJSC | 135 612 600 | 11,4 | | 11,4 |
| Inter-American Development Bank | | | 37,8 | 37,8 |
| Interconexion Electrica SA ESP | 1 522 414 | 6,8 | | 6,8 |
| Intercontinental Exchange Inc | 46 550 | 3,5 | | 3,5 |
| InterContinental Hotels Group PLC | 42 912 | 2,6 | | 2,6 |
| Intercorp Financial Services Inc | 203 938 | 8,8 | | 8,8 |
| International Bancshares Corp | 177 400 | 9,7 | | 9,7 |
| International Business Machines Corp | 4 357 642 | 970,0 | | 970,0 |
| International Consolidated Airlines Group SA | 1 217 367 | 8,8 | | 8,8 |
| International Container Terminal Services Inc | 2 056 334 | 4,0 | | 4,0 |
| International Flavors & Fragrances Inc | 9 519 | 1,5 | | 1,5 |
| International Game Technology PLC | 208 600 | 7,1 | | 7,1 |
| International Hospitality Inc | 4 099 831 | - | | - |
| International Paper Co | 153 700 | 10,9 | | 10,9 |
| Interpublic Group of Cos Inc, The | 96 568 | 3,0 | | 3,0 |
| Intertek Group PLC | 2 497 932 | 144,1 | | 144,1 |
| Intesa Sanpaolo SpA | 4 645 760 | 15,9 | | 15,9 |
| Intu Properties PLC | 377 421 | 1,8 | | 1,8 |
| Intuit Inc | 1 293 898 | 198,9 | | 198,9 |
| Intuitive Surgical Inc | 7 547 | 6,4 | | 6,4 |
| Inventec Corp | 10 297 385 | 9,5 | | 9,5 |
| Invesco Ltd | 75 321 | 3,1 | | 3,1 |
| Investec Ltd | 1 846 805 | 16,4 | | 16,4 |
| Investec PLC | 385 511 | 3,4 | | 3,4 |
| Investor AB | 289 099 | 14,5 | | 14,5 |
| IOI Corp Bhd | 8 106 906 | 10,7 | | 10,7 |
| IOI Properties Group Bhd | 5 089 481 | 3,2 | | 3,2 |
| Ionic Pamli Global Credit Strategies Fund | 100 000 | 128,3 | | 128,3 |
| Ipsos | 130 531 | 5,5 | | 5,5 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|-------------------------------------|-------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|---------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| I-Pulse Inc | | 53 035 | 0,2 | | | | 0,2 |
| Iridium Communications Inc | | 852 230 | 11,0 | | | | 11,0 |
| Irish Bank Resolution Corp Ltd | | 302 266 | - | | | | - |
| Iron Mountain Inc | | 130 139 | 5,7 | | | | 5,7 |
| IRPC PCL | | 39 053 037 | 7,0 | | | | 7,0 |
| Is Gayrimenkul Yatirim Ortakligi AS | | 8 531 447 | 5,1 | | | | 5,1 |
| Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd | | 248 940 | 3,6 | | | | 3,6 |
| iShares MSCI Brazil Capped ETF | | 99 025 | 4,4 | | | | 4,4 |
| iShares MSCI Chile Capped ETF | | 7 512 | 0,4 | | | | 0,4 |
| iShares MSCI Emerging Markets ETF | | 22 071 949 | 1 036,3 | | | | 1 036,3 |
| iShares MSCI India ETF | | 74 106 | 2,7 | | | | 2,7 |
| iShares MSCI India Index Fund | | 612 148 | 5,5 | | | | 5,5 |
| iShares MSCI Mexico Capped ETF | | 9 200 | 0,5 | | | | 0,5 |
| iShares MSCI South Africa ETF | | 33 500 | 2,4 | | | | 2,4 |
| iShares MSCI South Korea Capped ETF | | 15 400 | 1,1 | | | | 1,1 |
| Israel Chemicals Ltd | | 1 254 984 | 6,9 | | | | 6,9 |
| ISS A/S | | 99 877 | 4,5 | | | | 4,5 |
| Isuzu Motors Ltd | | 425 100 | 7,2 | | | | 7,2 |
| Itau Unibanco Holding SA | | 13 914 536 | 193,9 | | | | 193,9 |
| Itausa - Investimentos Itau SA | | 13 246 622 | 45,2 | | | | 45,2 |
| ITC Ltd | | 7 823 939 | 37,4 | | | | 37,4 |
| ITOCHU Corp | | 1 486 037 | 26,5 | | | | 26,5 |
| ITV PLC | | 825 338 | 2,8 | | | | 2,8 |
| J Front Retailing Co Ltd | | 158 380 | 2,9 | | | | 2,9 |
| J Sainsbury PLC | | 4 157 327 | 17,2 | | | | 17,2 |
| Jacobs Engineering Group Inc | | 71 600 | 5,5 | | | | 5,5 |
| James Hardie Industries Plc | | 3 636 | 0,1 | | | | 0,1 |
| Japan Airlines Co Ltd | | 250 400 | 9,8 | | | | 9,8 |
| Japan Airport Terminal Co Ltd | | 61 950 | 3,0 | | | | 3,0 |
| Japan Exchange Group Inc | | 41 300 | 0,8 | | | | 0,8 |
| Japan Post Bank Co Ltd | | 327 800 | 5,3 | | | | 5,3 |
| Japan Post Holdings Co Ltd | | 1 887 500 | 31,7 | | | | 31,7 |
| Japan Prime Realty Investment Corp | | 102 | 0,5 | | | | 0,5 |

| | | | | |
|---------------------------------------|-----------|-------|-------|-------|
| Japan Real Estate Investment Corp | 135 | 1,0 | | 1,0 |
| Japan Retail Fund Investment Corp | 307 | 0,8 | | 0,8 |
| Japan Tobacco Inc | 559 800 | 24,7 | | 24,7 |
| Jardine Cycle & Carriage Ltd | 233 155 | 8,9 | | 8,9 |
| Jardine Matheson Holdings Ltd | 288 300 | 21,4 | | 21,4 |
| Jardine Strategic Holdings Ltd | 8 100 | 0,4 | | 0,4 |
| Jasa Marga Persero Tbk PT | 9 273 789 | 4,0 | | 4,0 |
| Jastrzebska Spolka Weglowa SA | 94 617 | 2,0 | | 2,0 |
| Jazz Pharmaceuticals PLC | 9 500 | 1,4 | | 1,4 |
| JB Financial Group Co Ltd | 987 847 | 6,3 | | 6,3 |
| JB Hunt Transport Services Inc | 113 851 | 14,8 | | 14,8 |
| JBS SA | 1 768 332 | 8,3 | | 8,3 |
| JCDecaux SA | 51 951 | 2,1 | | 2,1 |
| JD.com Inc | 1 532 695 | 52,3 | | 52,3 |
| Jefferies Structured Alpha Fund B Ltd | 129 564 | 187,4 | | 187,4 |
| Jeronimo Martins SGPS SA | 318 982 | 6,7 | | 6,7 |
| JFE Holdings Inc | 431 761 | 8,8 | | 8,8 |
| JG Summit Holdings Inc | 9 180 346 | 16,8 | | 16,8 |
| JGC Corp | 1 343 | - | | - |
| Jiangsu Expressway Co Ltd | 4 001 665 | 6,8 | | 6,8 |
| Jiangsu Hengrui Medicine Co Ltd | 8 081 689 | 71,0 | | 71,0 |
| Jiangsu Kanion Pharmaceutical Co Ltd | 450 000 | 1,5 | | 1,5 |
| Jiangxi Copper Co Ltd | 3 820 046 | 7,1 | | 7,1 |
| Jinyu Bio-Technology Co Ltd | 1 508 157 | 9,2 | | 9,2 |
| JM Smucker Company, The | 73 100 | 12,6 | | 12,6 |
| JMFFO Ltd | 100 000 | 136,1 | | 136,1 |
| John Keells Holdings PLC | 773 594 | 1,0 | | 1,0 |
| John Wiley & Sons Inc | 110 984 | 8,1 | | 8,1 |
| Johnson & Johnson | 5 560 159 | 859,1 | | 859,1 |
| Johnson Controls International plc | 177 169 | 9,8 | | 9,8 |
| Johnson Health Tech Co Ltd | 910 915 | 1,8 | | 1,8 |
| Johnson Matthey PLC | 75 564 | 4,0 | | 4,0 |
| Jointown Pharmaceutical Group Co Ltd | 1 891 830 | 7,6 | | 7,6 |
| Jollibee Foods Corp | 1 394 009 | 7,3 | | 7,3 |
| Jones Lang LaSalle Inc | 6 800 | 0,9 | | 0,9 |
| JPMorgan Chase & Co | 1 757 781 | 203,4 | 263,3 | 466,7 |
| JSR Corp | 5 650 | 0,1 | | 0,1 |
| JSW Steel Ltd | 173 539 | 5,6 | | 5,6 |
| JTEKT Corp | 260 500 | 5,6 | | 5,6 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|------------------------------------|-------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Ju Teng International Holdings Ltd | | 3 073 125 | 1,3 | | | | 1,3 |
| Jubilant Foodworks Ltd | | 25 956 | 0,4 | | | | 0,4 |
| Julius Baer Group Ltd | | 365 054 | 21,8 | | | | 21,8 |
| JUMBO SA | | 728 149 | 15,5 | | | | 15,5 |
| Junex Inc | | 4 752 334 | 3,7 | 1,5 | | | 5,2 |
| Juniper Networks Inc | | 152 145 | 5,8 | | | | 5,8 |
| JX Holdings Inc | | 2 649 110 | 15,1 | | | | 15,1 |
| Jyothy Laboratories Ltd | | 605 553 | 4,1 | | | | 4,1 |
| K Wah International Holdings Ltd | | 4 409 000 | 2,7 | | | | 2,7 |
| K+S AG | | 128 108 | 4,1 | | | | 4,1 |
| Kajaria Ceramics Ltd | | 264 000 | 2,4 | | | | 2,4 |
| Kajima Corp | | 500 952 | 4,7 | | | | 4,7 |
| Kakaku.com Inc | | 19 100 | 0,4 | | | | 0,4 |
| Kakao Corp | | 11 601 | 1,0 | | | | 1,0 |
| Kalbe Farma Tbk PT | | 69 324 615 | 10,5 | | | | 10,5 |
| Kamigumi Co Ltd | | 363 723 | 4,7 | | | | 4,7 |
| Kaneka Corp | | 185 306 | 2,0 | | | | 2,0 |
| Kangwon Land Inc | | 354 788 | 14,1 | | | | 14,1 |
| Kansai Electric Power Co Inc, The | | 758 225 | 11,1 | | | | 11,1 |
| Kansai Nerolac Paints Ltd | | 401 515 | 2,5 | | | | 2,5 |
| Kansai Paint Co Ltd | | 47 700 | 1,2 | | | | 1,2 |
| Kansas City Southern | | 131 621 | 15,0 | | | | 15,0 |
| Kao Corporation | | 44 320 | 2,8 | | | | 2,8 |
| Kasikornbank PCL | | 6 069 872 | 40,3 | | | | 40,3 |
| Kawasaki Heavy Industries Ltd | | 1 295 532 | 5,5 | | | | 5,5 |
| KB Financial Group Inc | | 1 346 694 | 64,0 | | | | 64,0 |
| KB Insurance Co Ltd | | 31 782 | 0,9 | | | | 0,9 |
| KBC Group NV | | 90 200 | 7,5 | | | | 7,5 |
| KCC Corp | | 20 062 | 8,0 | | | | 8,0 |
| KCE Electronics PCL | | 943 904 | 4,3 | | | | 4,3 |
| KDDI Corp | | 25 005 400 | 850,9 | | | | 850,9 |
| Keihan Holdings Co Ltd | | 168 000 | 1,5 | | | | 1,5 |
| Keikyu Corp | | 596 293 | 9,3 | | | | 9,3 |

| | | | |
|--|-----------|-------|-------|
| Keio Corp | 768 226 | 8,5 | 8,5 |
| Keisei Electric Railway Co Ltd | 186 795 | 6,1 | 6,1 |
| Kellogg Co | 574 700 | 56,8 | 56,8 |
| Kenedix Office Investment Corp | 571 | 4,4 | 4,4 |
| KEPCO Plant Service & Engineering Co Ltd | 67 837 | 4,1 | 4,1 |
| Keppel Corp Ltd | 1 784 132 | 9,6 | 9,6 |
| Keppel REIT | 6 254 400 | 5,9 | 5,9 |
| Kering | 74 067 | 22,3 | 22,3 |
| Kerry Group PLC | 35 722 | 3,4 | 3,4 |
| Kerry Properties Ltd | 712 729 | 2,6 | 2,6 |
| KeyCorp | 216 062 | 5,3 | 5,3 |
| Keyence Corp | 26 893 | 24,8 | 24,8 |
| KGHM Polska Miedz SA | 370 022 | 11,0 | 11,0 |
| Khalkos Exploration Inc | 4 243 513 | 0,7 | 0,7 |
| Kia Motors Corp | 1 271 842 | 55,4 | 55,4 |
| Kikkoman Corp | 44 235 | 1,9 | 1,9 |
| Kildonan Castle Global Credit Opportunity Fund Ltd | 137 396 | 181,1 | 181,1 |
| Kimberly-Clark Corp | 3 674 336 | 562,3 | 562,3 |
| Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV | 2 639 880 | 6,4 | 6,4 |
| Kimco Realty Corp | 58 669 | 2,0 | 2,0 |
| Kinder Morgan Inc | 2 683 742 | 74,5 | 74,5 |
| Kingenta Ecological Engineering Group Co Ltd | 6 907 862 | 10,5 | 10,5 |
| Kingfisher PLC | 1 620 190 | 9,4 | 9,4 |
| Kingmaker Footwear Holdings Ltd | 2 374 000 | 1,0 | 1,0 |
| Kingsoft Corp Ltd | 1 798 719 | 4,9 | 4,9 |
| Kinnevik AB | 85 008 | 2,7 | 2,7 |
| Kintetsu Group Holdings Co Ltd | 1 735 650 | 8,9 | 8,9 |
| Kirin Holdings Co Ltd | 1 585 | - | - |
| Kite Realty Group Trust | 107 225 | 3,4 | 3,4 |
| Klabin SA | 998 538 | 7,3 | 7,3 |
| KLA-Tencor Corp | 44 037 | 4,6 | 4,6 |
| Klépierre | 204 294 | 10,8 | 10,8 |
| Kobe Steel Ltd | 3 899 | - | - |
| KOC Holding AS | 1 737 708 | 9,1 | 9,1 |
| Kohl's Corp | 158 800 | 10,5 | 10,5 |
| Koito Manufacturing Co Ltd | 34 500 | 2,5 | 2,5 |
| Kolmar BNH Co Ltd | 116 142 | 2,4 | 2,4 |
| Komatsu Ltd | 943 287 | 28,7 | 28,7 |
| Komercni banka as | 472 369 | 21,9 | 21,9 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|----------------------------------|-------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Komet Resources Inc | | 699 500 | 0,3 | | | | 0,3 |
| Konami Holdings Corp | | 51 168 | 2,8 | | | | 2,8 |
| Kone OYJ | | 217 383 | 13,1 | | | | 13,1 |
| Konecranes OYJ | | 155 100 | 7,4 | | | | 7,4 |
| Konica Minolta Inc | | 568 915 | 7,6 | | | | 7,6 |
| Koninklijke Ahold Delhaize NV | | 990 679 | 28,1 | | | | 28,1 |
| Koninklijke DSM NV | | 62 581 | 5,0 | | | | 5,0 |
| Koninklijke KPN NV | | 2 629 795 | 10,5 | | | | 10,5 |
| Koninklijke Philips NV | | 661 950 | 27,2 | | | | 27,2 |
| Koninklijke Vopak NV | | 97 834 | 6,2 | | | | 6,2 |
| Korea Aerospace Industries Ltd | | 205 729 | 15,3 | | | | 15,3 |
| Korea Asset In Trust Co Ltd | | 975 650 | 9,0 | | | | 9,0 |
| Korea Electric Power Corp | | 1 206 536 | 59,0 | | | | 59,0 |
| Korea Gas Corp | | 27 712 | 1,5 | | | | 1,5 |
| Korea Investment Holdings Co Ltd | | 117 619 | 5,5 | | | | 5,5 |
| Korea Kolmar Holdings Co Ltd | | 125 590 | 4,7 | | | | 4,7 |
| Korea Zinc Co Ltd | | 27 687 | 14,6 | | | | 14,6 |
| Korean Air Lines Co Ltd | | 52 293 | 1,6 | | | | 1,6 |
| Kose Corp | | 10 300 | 1,1 | | | | 1,1 |
| Kotak Mahindra Bank Ltd | | 1 817 184 | 25,8 | | | | 25,8 |
| KP Tissue Inc | | 1 048 722 | 16,4 | | | | 16,4 |
| Kraft Heinz Co, The | | 795 002 | 93,1 | | | | 93,1 |
| Krka dd Novo mesto | | 140 800 | 10,5 | | | | 10,5 |
| Kroger Company, The | | 379 700 | 17,6 | | | | 17,6 |
| Kroton Educacional SA | | 12 096 862 | 66,4 | | | | 66,4 |
| Krung Thai Bank PCL | | 12 132 770 | 8,0 | | | | 8,0 |
| KT Corp | | 166 542 | 5,4 | | | | 5,4 |
| KT&G Corp | | 406 706 | 45,6 | | | | 45,6 |
| Kuala Lumpur Kepong Bhd | | 1 403 286 | 10,1 | | | | 10,1 |
| Kubota Corp | | 4 182 | 0,1 | | | | 0,1 |
| Kuehne + Nagel International AG | | 106 969 | 19,0 | | | | 19,0 |
| Kukbo Design Co Ltd | | 99 705 | 1,9 | | | | 1,9 |
| Kulicke & Soffa Industries Inc | | 106 400 | 2,3 | | | | 2,3 |

| | | | | |
|-------------------------------------|------------|-------|------|-------|
| Kumho Petrochemical Co Ltd | 10 124 | 0,9 | | 0,9 |
| Kunlun Energy Co Ltd | 11 890 117 | 11,9 | | 11,9 |
| Kuraray Co Ltd | 1 532 | - | | - |
| Kurita Water Industries Ltd | 50 366 | 1,5 | | 1,5 |
| Kweichow Moutai Co Ltd | 194 738 | 12,6 | | 12,6 |
| Kyocera Corp | 248 482 | 16,6 | | 16,6 |
| Kyowa Hakko Kirin Co Ltd | 1 585 | - | | - |
| Kyushu Electric Power Co Inc | 471 590 | 6,9 | | 6,9 |
| Kyushu Financial Group Inc | 106 000 | 1,0 | | 1,0 |
| Kyushu Railway Co | 650 000 | 22,9 | | 22,9 |
| L Brands Inc | 53 522 | 4,7 | 16,4 | 21,1 |
| L3 Technologies Inc | 28 500 | 5,8 | | 5,8 |
| Laboratory Corp of America Holdings | 36 990 | 6,4 | | 6,4 |
| Lafarge Malaysia Bhd | 1 117 261 | 2,4 | | 2,4 |
| LafargeHolcim Ltd | 489 035 | 34,6 | | 34,6 |
| Lagardere SCA | 123 727 | 4,6 | | 4,6 |
| Lakeside Minerals Inc | 144 743 | - | | - |
| Lam Research Corp | 43 507 | 6,2 | | 6,2 |
| Lamêlée Minerais de Fer Ltée | 200 325 | - | | - |
| Land Securities Group PLC | 1 026 870 | 18,1 | | 18,1 |
| Landsbanki Islands HF | | | 8,3 | 8,3 |
| Lanxess AG | 129 237 | 11,4 | | 11,4 |
| Largan Precision Co Ltd | 131 022 | 20,7 | | 20,7 |
| Larsen & Toubro Ltd | 943 130 | 25,1 | | 25,1 |
| Las Vegas Sands Corp | 36 500 | 2,6 | | 2,6 |
| LaSalle Logiport REIT | 3 305 | 4,2 | | 4,2 |
| Latam Airlines Group SA | 883 378 | 10,0 | | 10,0 |
| Laurion Capital Ltd | 43 748 | 223,8 | | 223,8 |
| Lawson Inc | 121 751 | 11,5 | | 11,5 |
| Lear Corp | 29 800 | 5,3 | | 5,3 |
| LEENO Industrial Inc | 135 915 | 6,5 | | 6,5 |
| Lee's Pharmaceutical Holdings Ltd | 1 310 000 | 1,4 | | 1,4 |
| LEG Immobilien AG | 68 900 | 7,2 | | 7,2 |
| Legal & General Group PLC | 2 193 559 | 9,0 | | 9,0 |
| Leggett & Platt Inc | 31 967 | 2,1 | | 2,1 |
| Legrand SA | 93 062 | 7,1 | | 7,1 |
| Lend Lease Group | 175 208 | 2,5 | | 2,5 |
| Lennar Corp | 54 643 | 3,1 | | 3,1 |
| Lenovo Group Ltd | 19 716 568 | 16,0 | | 16,0 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|--|--------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Leonardo SpA | | 459 562 | 8,7 | | | | 8,7 |
| Lepu Medical Technology Beijing Co Ltd | | 10 734 522 | 37,1 | | | | 37,1 |
| Les Métaux Canadiens Inc. | | 1 471 833 | 0,2 | | | | 0,2 |
| Les Ressources Yorbeau Inc | | 10 212 357 | 1,0 | | | | 1,0 |
| Leucadia National Corp | | 107 331 | 3,3 | | | | 3,3 |
| Level 3 Communications Inc | | 116 840 | 8,8 | | | | 8,8 |
| LG Chem Ltd | | 153 757 | 44,6 | | | 44,6 | |
| | privilégiées | 25 753 | 5,1 | | | 5,1 | 49,7 |
| LG Corp | | 407 422 | 27,1 | | | | 27,1 |
| LG Display Co Ltd | | 951 373 | 33,2 | | | | 33,2 |
| LG Electronics Inc | | 52 942 | 3,0 | | | 3,0 | |
| | privilégiées | 15 203 | 0,4 | | | 0,4 | 3,4 |
| LG Household & Health Care Ltd | | 36 840 | 35,1 | | | 35,1 | |
| | privilégiées | 6 330 | 4,0 | | | 4,0 | 39,1 |
| LG Innotek Co Ltd | | 17 822 | 1,7 | | | | 1,7 |
| LG International Corp | | 26 206 | 0,9 | | | | 0,9 |
| LG Uplus Corp | | 787 321 | 10,0 | | | | 10,0 |
| Li & Fung Ltd | | 10 820 586 | 6,4 | | | | 6,4 |
| Lianhe Chemical Technology Co Ltd | | 1 332 213 | 4,2 | | | | 4,2 |
| Liberty Broadband Corp | | 3 800 | 0,4 | | | | 0,4 |
| Liberty Global PLC | série A | 75 600 | 3,1 | | | 3,1 | |
| | série C | 254 885 | 10,2 | | | 10,2 | 13,3 |
| Liberty Global Plc LiLAC | | 143 558 | 4,1 | | | | 4,1 |
| Liberty Holdings Ltd | | 629 054 | 6,8 | | | | 6,8 |
| Liberty Interactive Corp QVC Group | | 208 100 | 5,6 | | | | 5,6 |
| Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM | | 241 400 | 11,0 | | | | 11,0 |
| Liberty Property Trust | | 25 500 | 1,4 | | | | 1,4 |
| LIC Housing Finance Ltd | | 454 985 | 5,0 | | | | 5,0 |
| Life Healthcare Group Holdings Ltd | | 2 652 776 | 8,5 | | | | 8,5 |
| Lincoln National Corp | | 10 701 | 1,0 | | | | 1,0 |
| Linde AG | | 148 301 | 32,7 | | | | 32,7 |
| Linde India Ltd | | 443 660 | 3,1 | | | | 3,1 |
| Linear Technology Corp | | 106 823 | 8,9 | | | | 8,9 |
| Link REIT, The | | 1 340 240 | 11,7 | | | | 11,7 |

| | | | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|-------|------|-------|
| Linx SA | | 1 760 857 | 12,6 | | 12,6 |
| Lippo Karawaci Tbk PT | | 51 585 243 | 3,7 | | 3,7 |
| Lite-On Technology Corp | | 2 405 065 | 4,9 | | 4,9 |
| Livzon Pharmaceutical Group Inc | | 710 312 | 8,2 | | 8,2 |
| LIXIL Group Corp | | 217 673 | 6,6 | | 6,6 |
| LKQ Corp | | 63 400 | 2,6 | | 2,6 |
| Lloyds Banking Group PLC | | 16 286 838 | 16,9 | | 16,9 |
| Localiza Rent a Car SA | | 1 272 365 | 17,9 | | 17,9 |
| Lockheed Martin Corp | | 1 400 922 | 469,6 | | 469,6 |
| Loews Corp | | 84 501 | 5,3 | | 5,3 |
| Logistec Corporation | classe A | 1 016 400 | 38,6 | 38,6 | |
| | classe B | 486 200 | 17,1 | 17,1 | 55,7 |
| Logo Yazilim Sanayi Ve Ticaret AS | | 126 780 | 2,6 | | 2,6 |
| Lojas Americanas SA | | 1 808 619 | 9,3 | 9,3 | |
| | privilégiées | 225 023 | 1,6 | 1,6 | 10,9 |
| Lojas Renner SA | | 2 080 502 | 19,9 | | 19,9 |
| London Stock Exchange Group PLC | | 31 877 | 1,5 | | 1,5 |
| Longfor Properties Co Ltd | | 3 862 666 | 6,6 | | 6,6 |
| Lonza Group AG | | 15 859 | 3,7 | | 3,7 |
| Loomis AB | | 108 100 | 4,3 | | 4,3 |
| L'Oréal SA | | 138 804 | 34,0 | | 34,0 |
| Lotte Chemical Corp | | 76 391 | 31,3 | | 31,3 |
| Lotte Chilsung Beverage Co Ltd | | 3 677 | 6,0 | | 6,0 |
| Lotte Confectionery Co Ltd | | 17 143 | 3,4 | | 3,4 |
| Lotte Shopping Co Ltd | | 41 606 | 10,2 | | 10,2 |
| Lowe's Cos Inc | | 181 230 | 17,3 | | 17,3 |
| LPP SA | | 2 301 | 4,2 | | 4,2 |
| LS Corp | | 15 358 | 1,0 | | 1,0 |
| Lukoil PJSC | | 2 080 690 | 157,3 | | 157,3 |
| lululemon athletica Inc | | 12 400 | 1,1 | | 1,1 |
| Lumenpulse Inc | | 1 009 100 | 18,7 | | 18,7 |
| Lundin Petroleum AB | | 18 271 | 0,5 | | 0,5 |
| Lung Yen Life Service Corp | | 338 000 | 0,8 | | 0,8 |
| Lupin Ltd | | 877 085 | 25,8 | | 25,8 |
| Luxottica Group SpA | | 190 052 | 13,7 | | 13,7 |
| Luxshare Precision Industry Co Ltd | | 1 640 248 | 6,6 | | 6,6 |
| LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | | 206 576 | 53,0 | | 53,0 |
| LyondellBasell Industries NV | | 145 600 | 16,7 | | 16,7 |
| M Dias Branco SA | | 224 747 | 10,7 | | 10,7 |

au 31 décembre 2016

(juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|--|-------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| M&T Bank Corp | | 26 587 | 5,6 | | | | 5,6 |
| M3 Inc | | 11 500 | 0,4 | | | | 0,4 |
| Mabuchi Motor Co Ltd | | 2 994 | 0,2 | | | | 0,2 |
| Macerich Company, The | | 139 769 | 13,3 | | | | 13,3 |
| Macquarie Group Ltd | | 3 301 | 0,3 | | | | 0,3 |
| Macquarie Infrastructure Corp | | 75 300 | 8,3 | | | | 8,3 |
| Macy's Inc | | 253 743 | 12,2 | | | | 12,2 |
| Magnetar Risk Linked Fund, Ltd | | 1 727 | 0,2 | | | | 0,2 |
| Magnit PJSC | | 1 132 871 | 75,0 | | | | 75,0 |
| Mahindra & Mahindra Financial Services Ltd | | 425 712 | 2,3 | | | | 2,3 |
| Mahindra & Mahindra Ltd | | 634 059 | 14,8 | | | | 14,8 |
| Mahindra Lifespace Developers Ltd | | 15 814 | 0,1 | | | | 0,1 |
| Major Drilling Group International Inc | | 7 760 500 | 54,5 | | | | 54,5 |
| Makita Corp | | 970 | 0,1 | | | | 0,1 |
| Malaga Inc | | 3 784 926 | - | | | | - |
| Malayan Banking Bhd | | 13 153 841 | 32,2 | | | | 32,2 |
| Malaysia Airports Holdings Bhd | | 2 745 072 | 5,0 | | | | 5,0 |
| Mallinckrodt PLC | | 49 655 | 3,3 | | | | 3,3 |
| MAN SE | | 57 375 | 7,7 | | | | 7,7 |
| Manappuram Finance Ltd | | 4 500 000 | 6,0 | | | | 6,0 |
| ManpowerGroup Inc | | 49 400 | 5,9 | | | | 5,9 |
| Manufacturers Life Insurance Company , The | | | | | 134,5 | | 134,5 |
| Manulife Finance Delaware LP | | | | | 75,3 | | 75,3 |
| Mapfre SA | | 1 668 254 | 6,8 | | | | 6,8 |
| Marathon Oil Corp | | 106 300 | 2,5 | | | | 2,5 |
| Marathon Petroleum Corp | | 1 224 331 | 82,7 | | | | 82,7 |
| Marico Ltd | | 1 307 665 | 6,7 | | | | 6,7 |
| Marine Harvest ASA | | 158 451 | 3,8 | | | | 3,8 |
| Markel Corp | | 1 700 | 2,1 | | | | 2,1 |
| MarketAxess Holdings Inc | | 77 111 | 15,2 | | | | 15,2 |
| Marks & Spencer Group PLC | | 1 252 627 | 7,3 | | | | 7,3 |
| Marriott International Inc | | 12 281 | 1,4 | | | | 1,4 |
| Marsh & McLennan Cos Inc | | 48 602 | 4,4 | | | | 4,4 |

| | | | |
|----------------------------------|------------|-------|-------|
| Martin Marietta Materials Inc | 7 691 | 2,3 | 2,3 |
| Marubeni Corp | 1 327 267 | 10,1 | 10,1 |
| Marui Group Co Ltd | 1 916 | - | - |
| Maruichi Steel Tube Ltd | 21 500 | 0,9 | 0,9 |
| Maruti Suzuki India Ltd | 294 387 | 30,9 | 30,9 |
| Marvell Technology Group Ltd | 319 800 | 5,9 | 5,9 |
| Masco Corp | 58 708 | 2,5 | 2,5 |
| Mason Graphite Inc | 2 003 982 | 2,6 | 3,8 |
| Masraf Al Rayan QSC | 1 239 031 | 17,2 | 17,2 |
| Massmart Holdings Ltd | 293 783 | 3,6 | 3,6 |
| Mastercard Inc | 4 882 848 | 676,1 | 676,1 |
| Matahari Department Store Tbk PT | 8 152 076 | 12,3 | 12,3 |
| Mattel Inc | 121 600 | 4,5 | 4,5 |
| Maxim Integrated Products Inc | 94 900 | 4,9 | 4,9 |
| MAXIMUS Inc | 203 024 | 15,2 | 15,2 |
| Maxis Bhd | 1 023 767 | 1,8 | 1,8 |
| Mazda Motor Corp | 544 600 | 12,0 | 12,0 |
| mBank SA | 26 494 | 2,9 | 2,9 |
| McCormick & Co Inc | 26 365 | 3,3 | 3,3 |
| McDonald's Corp | 4 223 880 | 689,5 | 689,5 |
| McDonald's Holdings Co Japan Ltd | 2 000 | 0,1 | 0,1 |
| McKesson Corp | 1 020 797 | 192,3 | 192,3 |
| Mead Johnson Nutrition Co | 5 297 | 0,5 | 0,5 |
| Mebuki Financial Group Inc | 51 800 | 0,3 | 0,3 |
| MED Life SA | 169 059 | 1,4 | 1,4 |
| Media Nusantara Citra Tbk PT | 52 529 859 | 9,2 | 9,2 |
| MediaTek Inc | 3 354 740 | 30,2 | 30,2 |
| Medibank Pvt Ltd | 2 862 064 | 7,8 | 7,8 |
| Mediclinic International PLC | 433 018 | 5,5 | 5,5 |
| Mediobanca SpA | 282 416 | 3,1 | 3,1 |
| Medipal Holdings Corp | 402 499 | 8,5 | 8,5 |
| MEDNAX Inc | 29 500 | 2,6 | 2,6 |
| Medtronic PLC | 7 905 345 | 755,1 | 755,1 |
| MEG Energy Corp | 19 198 403 | 177,2 | 177,2 |
| Mega Financial Holding Co Ltd | 29 715 501 | 28,4 | 28,4 |
| Megacable Holdings SAB de CV | 4 283 034 | 19,4 | 19,4 |
| MegaFon PJSC | 75 450 | 1,0 | 1,0 |
| Megaworld Corp | 37 237 464 | 3,6 | 3,6 |
| Meggitt PLC | 396 078 | 3,0 | 3,0 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|---------------------------------------|-------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| MEIJI Holdings Co Ltd | | 38 170 | 4,0 | | | | 4,0 |
| Melco Crown Entertainment Ltd | | 172 733 | 3,7 | | | | 3,7 |
| Merck & Co Inc | | 2 815 180 | 222,3 | | | | 222,3 |
| Merck KGaA | | 116 618 | 16,4 | | | | 16,4 |
| Mercury NZ Ltd | | 1 366 425 | 3,8 | | | | 3,8 |
| Merida Industry Co Ltd | | 88 086 | 0,5 | | | | 0,5 |
| Meridian Energy Ltd | | 2 522 309 | 6,1 | | | | 6,1 |
| Merlin Entertainments PLC | | 189 299 | 1,4 | | | | 1,4 |
| Merrill Lynch & Co Inc | | | | | 95,4 | | 95,4 |
| Metair Investments Ltd | | 1 015 115 | 2,2 | | | | 2,2 |
| Metalurgica Gerdau SA | | 5 455 000 | 10,8 | | | | 10,8 |
| Methanex Corp | | 150 400 | 8,9 | | | | 8,9 |
| MetLife, Inc. | | 1 010 485 | 73,0 | | | | 73,0 |
| METRO AG | | 594 229 | 26,5 | | | | 26,5 |
| Metro Inc | | | | | 44,5 | | 44,5 |
| Metro Pacific Investments Corp | | 41 995 475 | 7,5 | | | | 7,5 |
| Metropolitan Bank & Trust Co | | 2 099 428 | 4,1 | | | | 4,1 |
| Metso OYJ | | 117 295 | 4,5 | | | | 4,5 |
| Mettler-Toledo International Inc | | 3 800 | 2,1 | | | | 2,1 |
| Mexichem SAB de CV | | 7 174 192 | 22,0 | | | | 22,0 |
| MGM China Holdings Ltd | | 1 299 600 | 3,6 | | | | 3,6 |
| MGM Resorts International | | 163 700 | 6,3 | | | | 6,3 |
| Michael Kors Holdings Ltd | | 31 765 | 1,8 | | | | 1,8 |
| Micro Focus International PLC | | 6 024 | 0,2 | | | | 0,2 |
| Microchip Technology Inc | | 98 591 | 8,5 | | | | 8,5 |
| Micron Technology Inc | | 19 659 900 | 139,5 | | | | 139,5 |
| Microsoft Corp | | 11 657 779 | 971,5 | | | | 971,5 |
| Micro-Star International Co Ltd | | 1 631 200 | 5,0 | | | | 5,0 |
| Mid-America Apartment Communities Inc | | 102 870 | 13,5 | | | | 13,5 |
| Midea Group Co Ltd | | 7 072 956 | 38,4 | | | | 38,4 |
| Midland Holdings Ltd | | 3 204 000 | 1,1 | | | | 1,1 |
| Midland IC&I Ltd | | 16 020 000 | 0,1 | | | | 0,1 |
| Millicom International Cellular SA | | 86 020 | 4,9 | | | | 4,9 |

| | | | |
|--|------------|------|------|
| Mills Estruturas e Servicos de Engenharia SA | 3 666 900 | 5,9 | 5,9 |
| Mincom Capital Inc | 745 167 | - | - |
| Minebea Co Ltd | 176 200 | 2,2 | 2,2 |
| Mineral Resources Ltd | 400 000 | 4,7 | 4,7 |
| Mines Agnico-Eagle Limitée | 55 586 | 3,1 | 3,1 |
| Mines de la Vallée de l'Or Ltée | 698 000 | 0,2 | 0,2 |
| Mines Indépendantes Chibougamau Inc | 842 910 | 0,1 | 0,1 |
| Mines Richmont Inc | 583 834 | 5,1 | 5,1 |
| Minor International PCL | 7 098 154 | 9,5 | 9,5 |
| Miraca Holdings Inc | 92 365 | 5,6 | 5,6 |
| Mirae Asset Daewoo Co Ltd | 1 885 102 | 15,2 | 15,2 |
| Mirvac Group | 846 644 | 1,8 | 1,8 |
| MISC Bhd | 4 071 567 | 8,9 | 8,9 |
| Mitsubishi Chemical Holdings Corp | 5 938 432 | 51,8 | 51,8 |
| Mitsubishi Corp | 1 850 914 | 53,0 | 53,0 |
| Mitsubishi Electric Corp | 1 013 152 | 19,0 | 19,0 |
| Mitsubishi Estate Co Ltd | 1 064 181 | 28,5 | 28,5 |
| Mitsubishi Gas Chemical Co Inc | 126 957 | 2,9 | 2,9 |
| Mitsubishi Heavy Industries Ltd | 2 626 195 | 16,1 | 16,1 |
| Mitsubishi Logistics Corp | 187 089 | 3,6 | 3,6 |
| Mitsubishi Materials Corp | 117 225 | 4,8 | 4,8 |
| Mitsubishi Motors Corp | 1 706 000 | 13,1 | 13,1 |
| Mitsubishi Tanabe Pharma Corp | 258 213 | 6,8 | 6,8 |
| Mitsubishi UFJ Financial Group Inc | 7 338 203 | 60,8 | 60,8 |
| Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co Ltd | 400 300 | 2,8 | 2,8 |
| Mitsui & Co Ltd | 1 862 074 | 34,4 | 34,4 |
| Mitsui Chemicals Inc | 657 381 | 4,0 | 4,0 |
| Mitsui Fudosan Co Ltd | 654 817 | 20,4 | 20,4 |
| Mitsui OSK Lines Ltd | 9 783 | - | - |
| Mixi Inc | 12 928 | 0,6 | 0,6 |
| Mizrahi Tefahot Bank Ltd | 53 795 | 1,1 | 1,1 |
| Mizuho Financial Group Inc | 17 532 434 | 42,3 | 42,3 |
| MMC Norilsk Nickel PJSC | 208 801 | 46,4 | 46,4 |
| MMI Holdings Ltd | 3 267 104 | 7,6 | 7,6 |
| Mobile TeleSystems PJSC | 2 720 320 | 26,4 | 26,4 |
| Mobileye NV | 7 538 | 0,4 | 0,4 |
| Mohawk Industries Inc | 15 849 | 4,2 | 4,2 |
| MOL Hungarian Oil & Gas PLC | 64 210 | 6,1 | 6,1 |
| Molson Coors Brewing Co | 44 425 | 5,8 | 5,8 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|---|-------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Mondelez International Inc | | 5 049 682 | 300,2 | | | | 300,2 |
| Mondi Ltd | | 320 161 | 8,8 | | | | 8,8 |
| Mondi PLC | | 263 569 | 7,3 | | | | 7,3 |
| Moneta Money Bank AS | | 796 162 | 3,5 | | | | 3,5 |
| MonoGen, Inc. | | 18 574 045 | - | | | | - |
| Monsanto Co | | 612 263 | 86,4 | | | | 86,4 |
| Monster Beverage Corp | | 54 343 | 3,2 | | | | 3,2 |
| Moody's Corp | | 9 722 | 1,2 | | | | 1,2 |
| Morgan Stanley | | 493 100 | 27,9 | | | | 27,9 |
| Mori Hills REIT Investment Corp | | 3 022 | 5,5 | | | | 5,5 |
| Mosaic Company, The | | 105 627 | 4,2 | | | | 4,2 |
| Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC | | 4 589 310 | 12,6 | | | | 12,6 |
| Motherson Sumi Systems Ltd | | 643 255 | 4,1 | | | | 4,1 |
| Motorola Solutions Inc | | 55 658 | 6,2 | | | | 6,2 |
| Mphasis Ltd | | 574 509 | 6,4 | | | | 6,4 |
| Mr Price Group Ltd | | 895 597 | 14,0 | | | | 14,0 |
| MRC Global Inc | | 377 830 | 10,3 | | | | 10,3 |
| MRV Engenharia e Participacoes SA | | 817 000 | 3,7 | | | | 3,7 |
| MS&AD Insurance Group Holdings Inc | | 598 495 | 24,9 | | | | 24,9 |
| MSCI Inc | | 4 900 | 0,5 | | | | 0,5 |
| MTN Group Ltd | | 6 703 976 | 82,9 | | | | 82,9 |
| MTR Corp Ltd | | 3 436 182 | 22,4 | | | | 22,4 |
| Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG | | 125 884 | 32,0 | | | | 32,0 |
| Multi Commodity Exchange of India Ltd | | 360 000 | 9,0 | | | | 9,0 |
| Multiplan Empreendimentos Imobiliarios SA | | 1 647 113 | 40,3 | | | | 40,3 |
| Multiplus SA | | 364 000 | 5,1 | | | | 5,1 |
| Murata Manufacturing Co Ltd | | 3 660 | 0,7 | | | | 0,7 |
| Murphy Oil Corp | | 5 000 | 0,2 | | | | 0,2 |
| Murphy USA Inc | | 32 250 | 2,7 | | | | 2,7 |
| MW Eureka Fund | | 962 011 | 224,3 | | | | 224,3 |
| Mylan NV | | 75 320 | 3,9 | | | | 3,9 |
| Nabtesco Corp | | 35 854 | 1,1 | | | | 1,1 |
| Nagoya Railroad Co Ltd | | 1 154 521 | 7,5 | | | | 7,5 |

| | | | |
|---|------------|-------|-------|
| Nampak Ltd | 1 904 500 | 3,5 | 3,5 |
| Nan Ya Plastics Corp | 16 646 848 | 49,3 | 49,3 |
| Nanya Technology Corp | 759 000 | 1,5 | 1,5 |
| NAPEC Inc | 14 849 327 | 14,0 | 14,0 |
| NARI Technology Co Ltd | 3 567 423 | 11,4 | 11,4 |
| Nasdaq Inc | 17 827 | 1,6 | 1,6 |
| Naspers Ltd | 1 466 285 | 289,6 | 289,6 |
| National Australia Bank Ltd | 182 813 | 5,4 | 5,4 |
| National Bank of Abu Dhabi PJSC | 2 302 810 | 8,4 | 8,4 |
| National Bank of Greece SA | 9 832 704 | 3,4 | 3,4 |
| National Grid PLC | 31 170 375 | 491,5 | 491,5 |
| National Health Investors Inc | 92 900 | 9,2 | 9,2 |
| National Oilwell Varco Inc | 238 232 | 12,0 | 12,0 |
| Natixis SA | 1 065 562 | 8,1 | 8,1 |
| Natura Cosmeticos SA | 2 478 192 | 23,5 | 23,5 |
| NAVER Corp | 102 544 | 88,2 | 88,2 |
| Navient Corp | 124 300 | 2,7 | 2,7 |
| Navitas Ltd | 1 607 100 | 7,8 | 7,8 |
| NCSOFT Corp | 52 895 | 14,5 | 14,5 |
| NEC Corp | 3 954 065 | 14,1 | 14,1 |
| Nedbank Group Ltd | 633 781 | 14,8 | 14,8 |
| Nemak SAB de CV | 4 186 120 | 5,0 | 5,0 |
| Neopost SA | 14 245 | 0,6 | 0,6 |
| Neste Oyj | 89 434 | 4,6 | 4,6 |
| Nestle India Ltd | 139 561 | 16,6 | 16,6 |
| Nestlé SA | 7 818 446 | 753,6 | 753,6 |
| NetApp Inc | 158 808 | 7,5 | 7,5 |
| Netcare Ltd | 5 845 150 | 18,3 | 18,3 |
| NetEase Inc | 180 735 | 52,2 | 52,2 |
| Netflix Inc | 6 168 | 1,0 | 1,0 |
| Neuberger Berman CLO Ltd | | | 63,6 |
| NeuStar Inc | 384 241 | 17,2 | 17,2 |
| New China Life Insurance Co Ltd | 1 784 959 | 11,0 | 11,0 |
| New Europe Property Investments PLC | 647 066 | 10,1 | 10,1 |
| New Oriental Education & Technology Group Inc | 305 606 | 17,3 | 17,3 |
| New World Development Co Ltd | 4 113 144 | 5,8 | 5,8 |
| New York Community Bancorp Inc | 120 700 | 2,6 | 2,6 |
| Newcrest Mining Ltd | 1 190 811 | 23,4 | 23,4 |
| Newell Brands Inc | 1 171 184 | 70,1 | 70,1 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|--|-------------|-----------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Newfield Exploration Co | | 31 600 | 1,7 | | | | 1,7 |
| Newmont Mining Corp | | 146 300 | 6,7 | | | | 6,7 |
| Newport Mount Royal Opportunity Fund Ltd | | 101 155 | 126,2 | | | | 126,2 |
| News Corp | | 14 375 | 0,2 | | | | 0,2 |
| NEX Group PLC | | 93 050 | 0,7 | | | | 0,7 |
| Nexon Co Ltd | | 132 500 | 2,6 | | | | 2,6 |
| Next PLC | | 40 271 | 3,3 | | | | 3,3 |
| NextEra Energy Inc | | 3 439 726 | 551,1 | | | | 551,1 |
| NGK Insulators Ltd | | 84 793 | 2,2 | | | | 2,2 |
| NGK Spark Plug Co Ltd | | 1 686 | - | | | | - |
| NH Foods Ltd | | 1 501 | - | | | | - |
| NH Investment & Securities Co Ltd | | 424 292 | 4,5 | | | | 4,5 |
| NICE Information Service Co Ltd | | 485 296 | 3,7 | | | | 3,7 |
| Nice Ltd | | 15 916 | 1,5 | | | | 1,5 |
| Nidec Corp | | 53 573 | 6,2 | | | | 6,2 |
| Nielsen Holdings PLC | | 72 568 | 4,1 | | | | 4,1 |
| Nien Made Enterprise Co Ltd | | 482 000 | 6,7 | | | | 6,7 |
| NIKE Inc | | 85 581 | 5,8 | | | | 5,8 |
| Nikon Corp | | 66 734 | 1,4 | | | | 1,4 |
| Nine Dragons Paper Holdings Ltd | | 3 759 621 | 4,6 | | | | 4,6 |
| Ningbo Xinhai Electric Co Ltd | | 813 540 | 7,9 | | | | 7,9 |
| Nintendo Co Ltd | | 38 984 | 11,0 | | | | 11,0 |
| Niobay Metals Inc | | 1 879 854 | 1,4 | | | | 1,4 |
| Nippon Building Fund Inc | | 175 | 1,3 | | | | 1,3 |
| Nippon Electric Glass Co Ltd | | 4 764 | - | | | | - |
| Nippon Express Co Ltd | | 1 810 145 | 13,1 | | | | 13,1 |
| Nippon Kanzai Co Ltd | | 123 800 | 2,6 | | | | 2,6 |
| Nippon Paint Holdings Co Ltd | | 13 900 | 0,5 | | | | 0,5 |
| Nippon Prologis REIT Inc | | 161 | 0,4 | | | | 0,4 |
| Nippon Steel & Sumitomo Metal Corp | | 13 356 | 0,4 | | | | 0,4 |
| Nippon Telegraph & Telephone Corp | | 1 909 200 | 107,8 | | | | 107,8 |
| Nippon Yusen KK | | 6 437 | - | | | | - |
| NiSource Inc | | 475 645 | 14,1 | | | | 14,1 |

| | | | |
|--|------------|---------|---------|
| Nissan Motor Co Ltd | 3 342 330 | 45,2 | 45,2 |
| Nisshin Seifun Group Inc | 139 168 | 2,8 | 2,8 |
| Nissin Foods Holdings Co Ltd | 59 550 | 4,2 | 4,2 |
| Nitori Holdings Co Ltd | 14 342 | 2,2 | 2,2 |
| Nitto Denko Corp | 42 793 | 4,4 | 4,4 |
| NN Group NV | 161 666 | 7,4 | 7,4 |
| Noble Energy Inc | 112 379 | 5,7 | 5,7 |
| NOK Corp | 108 289 | 2,9 | 2,9 |
| Nokia OYJ | 2 893 836 | 18,8 | 18,8 |
| Nokian Renkaat OYJ | 48 547 | 2,4 | 2,4 |
| Nomura Holdings Inc | 1 238 289 | 9,8 | 9,8 |
| Nomura Real Estate Holdings Inc | 56 600 | 1,3 | 1,3 |
| Nomura Research Institute Ltd | 98 205 | 4,0 | 4,0 |
| Nordea Bank AB | 1 088 596 | 16,3 | 16,3 |
| Nordstrom Inc | 88 300 | 5,7 | 5,7 |
| Norfolk Southern Corp | 394 417 | 57,2 | 57,2 |
| Norsk Hydro ASA | 984 090 | 6,3 | 6,3 |
| North Battleford Power LP | | | 70,6 |
| North West Redwater Partnership / NWR Financing Co Ltd | | | 80,2 |
| Northern Trust Corp | 80 782 | 9,6 | 9,6 |
| Northland Power Solar Finance One LP | | | 36,0 |
| Northrop Grumman Corp | 41 269 | 12,9 | 12,9 |
| Norwegian Cruise Line Holdings Ltd | 47 500 | 2,7 | 2,7 |
| Novartis AG | 12 176 470 | 1 190,5 | 1 190,5 |
| Novatek Microelectronics Corp | 1 174 893 | 5,2 | 5,2 |
| Novatek OAO | 235 261 | 41,0 | 41,0 |
| Noveko International Inc | 10 183 200 | - | - |
| Novo Nordisk AS | 3 091 147 | 149,8 | 149,8 |
| Novozymes AS | 186 549 | 8,6 | 8,6 |
| NOW Inc | 48 400 | 1,3 | 1,3 |
| NQ Exploration Inc | 2 258 333 | - | - |
| NSK Ltd | 96 701 | 1,5 | 1,5 |
| NTT Data Corp | 165 200 | 10,7 | 10,7 |
| NTT DOCOMO Inc | 13 707 261 | 419,7 | 419,7 |
| Nuance Communications Inc | 98 800 | 2,0 | 2,0 |
| Nucor Corp | 110 600 | 8,8 | 8,8 |
| NuVista Energy Ltd | 14 646 400 | 101,6 | 101,6 |
| NVIDIA Corp | 10 278 | 1,5 | 1,5 |
| NWS Holdings Ltd | 2 072 654 | 4,5 | 4,5 |

au 31 décembre 2016

(juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|---|-------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| NXP Semiconductors NV | | 85 026 | 11,2 | | | | 11,2 |
| O2 Czech Republic AS | | 111 109 | 1,5 | | | | 1,5 |
| Obayashi Corp | | 577 119 | 7,4 | | | | 7,4 |
| Oberoi Realty Ltd | | 796 003 | 4,6 | | | | 4,6 |
| OBI Pharma Inc | | 85 000 | 1,0 | | | | 1,0 |
| Obic Co Ltd | | 17 200 | 1,0 | | | | 1,0 |
| Occidental Petroleum Corp | | 288 920 | 27,6 | | | | 27,6 |
| OCI Co Ltd | | 9 582 | 0,8 | | | | 0,8 |
| O'Connor Global Fundamental Market Neutral Long Short Ltd | | 144 846 | 170,0 | | | | 170,0 |
| Odakyu Electric Railway Co Ltd | | 282 211 | 7,5 | | | | 7,5 |
| Odontoprev SA | | 114 408 | 0,6 | | | | 0,6 |
| OGE Energy Corp | | 281 220 | 12,6 | | | | 12,6 |
| OHL Mexico SAB de CV | | 2 106 287 | 2,8 | | | | 2,8 |
| Oil & Natural Gas Corp Ltd | | 6 183 991 | 23,4 | | | | 23,4 |
| Oil Search Ltd | | 1 808 | - | | | | - |
| Oji Holdings Corp | | 798 426 | 4,4 | | | | 4,4 |
| Old Mutual PLC | | 4 680 329 | 16,1 | | | | 16,1 |
| Olympus Corp | | 8 217 | 0,4 | | | | 0,4 |
| Omnicom Group Inc | | 97 731 | 11,2 | | | | 11,2 |
| Omron Corp | | 3 783 | 0,2 | | | | 0,2 |
| OMV AG | | 361 772 | 17,2 | | | | 17,2 |
| OMV Petrom SA | | 65 556 456 | 5,3 | | | | 5,3 |
| ONEOK Inc | | 270 607 | 20,8 | | | | 20,8 |
| Onex Corp | | 4 526 600 | 413,6 | | | | 413,6 |
| Ono Pharmaceutical Co Ltd | | 81 450 | 2,4 | | | | 2,4 |
| Ooredoo QSC | | 269 990 | 10,1 | | | | 10,1 |
| OPAP SA | | 400 031 | 4,8 | | | | 4,8 |
| Open Text Corp | | 8 778 400 | 727,9 | | | | 727,9 |
| Opsens Inc | | 4 752 000 | 7,7 | | | | 7,7 |
| Oracle Corp | | 18 379 243 | 947,7 | | | | 947,7 |
| Oracle Corp Japan | | 36 135 | 2,4 | | | | 2,4 |
| Orange Polska SA | | 2 196 672 | 3,9 | | | | 3,9 |
| Orange SA | | 43 556 865 | 889,3 | | | | 889,3 |

| | | | |
|----------------------------------|------------|-------|-------|
| Orbital ATK Inc | 31 302 | 3,7 | 3,7 |
| O'Reilly Automotive Inc | 9 557 | 3,6 | 3,6 |
| Organizacion Cultiba SAB de CV | 4 690 327 | 5,8 | 5,8 |
| Organizacion Soriana SAB de CV | 2 181 540 | 6,4 | 6,4 |
| Orica Ltd | 8 720 292 | 149,7 | 149,7 |
| Oriental Land Co Ltd | 1 696 | 0,1 | 0,1 |
| Origin Energy Ltd | 466 767 | 3,0 | 3,0 |
| Orion Corp | 22 382 | 16,3 | 16,3 |
| Orion Oyj | 58 597 | 3,5 | 3,5 |
| ORIX Corp | 336 130 | 7,0 | 7,0 |
| Orix Jreit Inc | 2 190 | 4,6 | 4,6 |
| Orkla ASA | 820 035 | 10,0 | 10,0 |
| Orora Ltd | 800 000 | 2,3 | 2,3 |
| Osaka Gas Co Ltd | 929 765 | 4,8 | 4,8 |
| Osisko Mining Inc | 400 449 | 1,0 | 1,0 |
| OSRAM Licht AG | 43 931 | 3,1 | 3,1 |
| OTP Bank PLC | 426 324 | 16,4 | 16,4 |
| Otsuka Corp | 574 | - | - |
| Otsuka Holdings Co Ltd | 4 000 | 0,2 | 0,2 |
| Ottogi Corp | 1 130 | 0,8 | 0,8 |
| Oversea-Chinese Banking Corp Ltd | 960 632 | 8,0 | 8,0 |
| OxAM Quant Fund Limited | 38 565 | 152,5 | 152,5 |
| OZ Minerals Ltd | 500 000 | 3,8 | 3,8 |
| OZ Overseas Fund II Ltd | 1 | 3,4 | 3,4 |
| P2 Capital Master Fund XII LP | 1 | 282,0 | 282,0 |
| PACCAR Inc | 124 800 | 10,7 | 10,7 |
| Pacific Radiance Ltd | 3 264 500 | 0,4 | 0,4 |
| Packaging Corp of America | 21 400 | 2,4 | 2,4 |
| Pact Group Holdings Ltd | 550 000 | 3,6 | 3,6 |
| Paddy Power Betfair PLC | 5 106 | 0,7 | 0,7 |
| Pakuwon Jati Tbk PT | 79 148 460 | 4,5 | 4,5 |
| Palo Alto Networks Inc | 24 246 | 4,1 | 4,1 |
| Panasonic Corp | 1 691 385 | 23,1 | 23,1 |
| Pandora A/S | 9 517 | 1,7 | 1,7 |
| Paramount Group Inc | 852 000 | 18,3 | 18,3 |
| Parex Resources Inc | 8 974 000 | 151,7 | 151,7 |
| Pargesa Holding SA | 26 345 | 2,3 | 2,3 |
| Park24 Co Ltd | 25 400 | 0,9 | 0,9 |
| Parker-Hannifin Corp | 43 800 | 8,2 | 8,2 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|---|--------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Parque Arauco SA | | 2 562 232 | 7,8 | | | | 7,8 |
| Partners Group Holding AG | | 1 589 | 1,0 | | | | 1,0 |
| Pason Systems Inc | | 7 166 000 | 140,7 | | | | 140,7 |
| Patterson Cos Inc | | 38 800 | 2,1 | | | | 2,1 |
| Paychex Inc | | 87 899 | 7,2 | | | | 7,2 |
| PayPal Holdings Inc | | 251 812 | 13,3 | | | | 13,3 |
| PAZ Corp SA | | 470 226 | 0,5 | | | | 0,5 |
| PCCW Ltd | | 3 730 000 | 2,7 | | | | 2,7 |
| PChome Online Inc | | 46 732 | 0,6 | | | | 0,6 |
| Pearson PLC | | 539 336 | 7,3 | | | | 7,3 |
| Pegatron Corp | | 5 010 998 | 16,1 | | | | 16,1 |
| Pembina Pipeline Corp | | 8 615 596 | 361,5 | | 149,1 | | 510,6 |
| Pentair PLC | | 44 549 | 3,3 | | | | 3,3 |
| People's Insurance Co Group of China Ltd, The | | 18 725 427 | 9,9 | | | | 9,9 |
| People's United Financial Inc | | 197 288 | 5,1 | | | | 5,1 |
| PepsiCo Inc | | 3 092 961 | 434,0 | | | | 434,0 |
| Perella Weinberg Partners Xerion Fund Ltd | | 170 | 0,2 | | | | 0,2 |
| Pernod Ricard SA | | 111 416 | 16,2 | | | | 16,2 |
| Perrigo Co PLC | | 46 121 | 5,1 | | | | 5,1 |
| Persimmon PLC | | 351 331 | 10,3 | | | | 10,3 |
| Perusahaan Gas Negara Persero Tbk | | 51 269 192 | 13,8 | | | | 13,8 |
| Petkim Petrokimya Holding AS | | 1 208 468 | 1,7 | | | | 1,7 |
| PetroChina Co Ltd | | 58 574 056 | 58,6 | | | | 58,6 |
| Petrofac Ltd | | 15 098 597 | 217,4 | | | | 217,4 |
| Petroleo Brasileiro SA | | 9 005 138 | 62,9 | | | 62,9 | |
| | privilégiées | 22 031 973 | 135,0 | | | 135,0 | 197,9 |
| Petronas Chemicals Group Bhd | | 8 558 343 | 17,9 | | | | 17,9 |
| Petronas Dagangan Bhd | | 653 018 | 4,6 | | | | 4,6 |
| Petronas Gas Bhd | | 3 148 442 | 20,0 | | | | 20,0 |
| Petronet LNG Ltd | | 971 605 | 7,1 | | | | 7,1 |
| Peugeot SA | | 1 106 612 | 24,3 | | | | 24,3 |
| Pfizer Inc | | 3 794 618 | 165,3 | | | | 165,3 |
| PG&E Corp | | 705 994 | 57,5 | | | | 57,5 |
| PGE Polska Grupa Energetyczna SA | | 2 987 354 | 10,0 | | | | 10,0 |

| | | | | | |
|---|----------|------------|-------|-------|-------|
| Philip Morris International Inc | | 702 402 | 86,2 | | 86,2 |
| Phillips 66 | | 20 050 | 2,3 | | 2,3 |
| Phison Electronics Corp | | 486 367 | 5,2 | | 5,2 |
| PhosAgro PJSC | | 326 047 | 6,7 | | 6,7 |
| PICC Property & Casualty Co Ltd | | 11 583 388 | 24,2 | | 24,2 |
| Pick n Pay Stores Ltd | | 991 406 | 6,2 | | 6,2 |
| Pictet - Emerging Local Currency Debt | | | | 286,0 | 286,0 |
| Pictet - Global Emerging Debt | | | | 134,6 | 134,6 |
| Ping An Insurance Group Co of China Ltd | classe A | 9 885 964 | 67,6 | | 67,6 |
| | classe H | 14 942 646 | 100,3 | | 100,3 |
| Pinnacle Park CLO Ltd | | | | 100,6 | 100,6 |
| Pinnacle West Capital Corp | | 154 456 | 16,2 | | 16,2 |
| Pioneer Foods Group Ltd | | 345 921 | 5,2 | | 5,2 |
| Pioneer Natural Resources Co | | 15 444 | 3,7 | | 3,7 |
| Piraeus Bank SA | | 11 735 668 | 3,5 | | 3,5 |
| Piramal Enterprises Ltd | | 118 683 | 3,8 | | 3,8 |
| PLDT Inc | | 311 523 | 11,5 | | 11,5 |
| PNC Financial Services Group Inc, The | | 263 346 | 41,3 | | 41,3 |
| Pola Orbis Holdings Inc | | 1 900 | 0,2 | | 0,2 |
| Polaris Industries Inc | | 18 400 | 2,0 | | 2,0 |
| Polski Koncern Naftowy Orlen SA | | 735 614 | 20,2 | | 20,2 |
| Polskie Gornictwo Naftowe i Gazownictwo SA | | 3 836 706 | 6,9 | | 6,9 |
| Poly Real Estate Group Co Ltd | | 11 467 706 | 20,2 | | 20,2 |
| Popular Inc | | 138 600 | 8,1 | | 8,1 |
| Porsche Automobil Holding SE | | 59 719 | 4,4 | | 4,4 |
| Porto Seguro SA | | 79 145 | 0,9 | | 0,9 |
| Portobello SA | | 3 134 500 | 2,6 | | 2,6 |
| POSCO | | 317 772 | 90,9 | | 90,9 |
| Posco Daewoo Corp | | 118 065 | 3,5 | | 3,5 |
| Poste Italiane SpA | | 631 186 | 5,6 | | 5,6 |
| Potash Corporation of Saskatchewan Inc | | 14 438 967 | 350,7 | | 350,7 |
| Pou Chen Corp | | 8 158 314 | 13,6 | | 13,6 |
| Power Assets Holdings Ltd | | 2 313 247 | 27,3 | | 27,3 |
| Power Corporation du Canada | | 12 017 600 | 361,1 | | 361,1 |
| Power Finance Corp Ltd | | 968 570 | 2,3 | | 2,3 |
| Power Grid Corp of India Ltd | | 3 467 167 | 12,6 | | 12,6 |
| Powertech Technology Inc | | 1 076 251 | 3,9 | | 3,9 |
| Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA | | 2 991 279 | 27,0 | | 27,0 |
| Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA | | 1 317 646 | 14,1 | | 14,1 |

au 31 décembre 2016

(juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|--|-------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| PPB Group Bhd | | 1 558 471 | 7,4 | | | | 7,4 |
| PPG Industries Inc | | 164 714 | 20,9 | | | | 20,9 |
| PPL Corp | | 10 811 328 | 493,7 | | | | 493,7 |
| Praxair Inc | | 5 083 180 | 798,9 | | | | 798,9 |
| President Chain Store Corp | | 2 013 922 | 19,4 | | | | 19,4 |
| Prestige Télécom Inc | | 970 420 | - | | | | - |
| Priceline Group Inc, The | | 4 185 | 8,2 | | | | 8,2 |
| Prime Car Management SA | | 87 000 | 0,9 | | | | 0,9 |
| Primoris Services Corp | | 343 242 | 10,5 | | | | 10,5 |
| Principal Financial Group Inc | | 23 356 | 1,8 | | | | 1,8 |
| Probe Metals Inc | | 2 919 822 | 3,9 | | | | 3,9 |
| Procter & Gamble Company, The | | 965 913 | 108,9 | | | | 108,9 |
| Progressive Corp, The | | 791 048 | 37,7 | | | | 37,7 |
| Prologis Inc | | 328 446 | 23,3 | | | | 23,3 |
| Promet Bhd | | 127 000 | - | | | | - |
| Promotora y Operadora de Infraestructura SAB de CV | | 3 684 124 | 38,2 | | | | 38,2 |
| Propriétés Genius Ltée, Les | | 961 000 | - | | | | - |
| ProSiebenSat.1 Media SE | | 75 985 | 3,9 | | | | 3,9 |
| Provident Financial PLC | | 178 626 | 8,4 | | | | 8,4 |
| Proximus SADP | | 236 719 | 9,2 | | | | 9,2 |
| Prudential Financial Inc | | 11 170 | 1,6 | | | | 1,6 |
| Prudential PLC | | 805 802 | 21,7 | | | | 21,7 |
| Prysmian SpA | | 89 500 | 3,1 | | | | 3,1 |
| PSG Group Ltd | | 249 757 | 5,4 | | | | 5,4 |
| PTC India Ltd | | 4 869 917 | 7,1 | | | | 7,1 |
| PTT Exploration & Production PCL | | 5 388 187 | 19,4 | | | | 19,4 |
| PTT Global Chemical PCL | | 7 715 932 | 18,2 | | | | 18,2 |
| PTT PCL | | 3 852 929 | 53,7 | | | | 53,7 |
| Public Bank Bhd | | 9 806 648 | 57,8 | | | | 57,8 |
| Public Service Enterprise Group Inc | | 733 681 | 43,2 | | | | 43,2 |
| Public Storage | | 273 152 | 81,9 | | | | 81,9 |
| Publicis Groupe SA | | 188 434 | 17,5 | | | | 17,5 |
| PulteGroup Inc | | 4 900 | 0,1 | | | | 0,1 |

| | | | | |
|---------------------------------------|-----------|---------|-------|-------|
| PVH Corp | 20 713 | 2,5 | | 2,5 |
| Qantas Airways Ltd | 4 913 023 | 15,9 | | 15,9 |
| Qatar Electricity & Water Co QSC | 121 874 | 10,2 | | 10,2 |
| Qatar Gas Transport Co Ltd | 1 203 015 | 10,2 | | 10,2 |
| Qatar Insurance Co SAQ | 398 361 | 12,4 | | 12,4 |
| Qatar Islamic Bank SAQ | 199 175 | 7,6 | | 7,6 |
| Qatar National Bank SAQ | 707 713 | 42,5 | | 42,5 |
| QBE Insurance Group Ltd | 2 390 847 | 28,8 | | 28,8 |
| QIAGEN NV | 153 271 | 5,8 | | 5,8 |
| Qinqin Foodstuffs Group Cayman Co Ltd | 10 000 | - | | - |
| Qlik Technologies Inc | | | 33,4 | 33,4 |
| QMX Gold Corporation | 6 718 685 | 1,1 | | 1,1 |
| Qorvo Inc | 49 300 | 3,5 | | 3,5 |
| Qualcomm Inc | 9 654 175 | 844,1 | | 844,1 |
| Qualicorp SA | 402 405 | 3,2 | | 3,2 |
| Quanta Computer Inc | 3 970 747 | 10,0 | | 10,0 |
| Québecor Inc | | | 313,2 | 313,2 |
| | classe A | 621 130 | 23,2 | 23,2 |
| Quest Diagnostics Inc | 122 900 | 15,1 | | 15,1 |
| Quintiles IMS Holdings Inc | 43 729 | 4,5 | | 4,5 |
| Qunar Cayman Islands Ltd | 81 527 | 3,3 | | 3,3 |
| Rackspace Hosting Inc | | | 241,0 | 241,0 |
| Raia Drogasil SA | 1 329 810 | 33,5 | | 33,5 |
| Raiffeisen Bank International AG | 191 189 | 4,4 | | 4,4 |
| Rakuten Inc | 448 933 | 5,9 | | 5,9 |
| Ralph Lauren Corp | 4 300 | 0,5 | | 0,5 |
| Ramsay Health Care Ltd | 2 333 | 0,2 | | 0,2 |
| Rand Merchant Investment Holdings Ltd | 1 808 962 | 7,1 | | 7,1 |
| Randgold Resources Ltd | 12 076 | 1,3 | | 1,3 |
| Randon SA Implementos e Participacoes | 2 566 200 | 3,6 | | 3,6 |
| Randstad Holding NV | 109 826 | 8,0 | | 8,0 |
| Range Resources Corp | 35 035 | 1,6 | | 1,6 |
| Rassini SAB de CV | 1 353 599 | 6,9 | | 6,9 |
| Raymond James Financial Inc | 19 700 | 1,8 | | 1,8 |
| Raytheon Co | 75 655 | 14,4 | | 14,4 |
| RB Energy Inc | 1 500 000 | 0,1 | | 0,1 |
| RE/MAX Holdings Inc | 192 082 | 14,4 | | 14,4 |
| REA Group Ltd | 10 565 | 0,6 | | 0,6 |
| Realtek Semiconductor Corp | 1 095 404 | 4,6 | | 4,6 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|----------------------------------|-------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Realty Income Corp | | 27 424 | 2,1 | | | | 2,1 |
| Reckitt Benckiser Group PLC | | 383 349 | 43,7 | | | | 43,7 |
| Recruit Holdings Co Ltd | | 115 700 | 6,2 | | | | 6,2 |
| Red Electrica Corp SA | | 607 502 | 15,4 | | | | 15,4 |
| Red Hat Inc | | 16 004 | 1,5 | | | | 1,5 |
| Redefine International PLC | | 3 482 911 | 2,3 | | | | 2,3 |
| Redefine Properties Ltd | | 13 454 407 | 14,8 | | | | 14,8 |
| Redevances Aurifères Osisko Ltée | | 4 983 862 | 65,2 | | | | 65,2 |
| Regal Entertainment Group | | 361 790 | 10,0 | | | | 10,0 |
| Regency Centers Corp | | 8 900 | 0,8 | | | | 0,8 |
| Regeneron Pharmaceuticals Inc | | 7 449 | 3,7 | | | | 3,7 |
| Regions Financial Corp | | 298 080 | 5,7 | | | | 5,7 |
| Regis Resources Ltd | | 575 000 | 1,7 | | | | 1,7 |
| Reinet Investments SCA | | 2 663 314 | 7,0 | | | | 7,0 |
| Reinsurance Group of America Inc | | 1 163 641 | 196,4 | | | | 196,4 |
| Reitmans Canada Ltée | | 90 600 | 0,5 | | | 0,5 | |
| | classe A | 2 100 000 | 12,2 | | | 12,2 | 12,7 |
| Reliance Communications Ltd | | 1 098 189 | 0,7 | | | | 0,7 |
| Reliance Industries Ltd | | 2 524 565 | 54,7 | | | | 54,7 |
| Reliance LP | | | | | 79,3 | | 79,3 |
| RELX NV | | 186 855 | 4,2 | | | | 4,2 |
| RELX PLC | | 361 881 | 8,7 | | | | 8,7 |
| Remgro Ltd | | 1 518 061 | 33,2 | | | | 33,2 |
| Remy Cointreau SA | | 13 506 | 1,5 | | | | 1,5 |
| RenaissanceRe Holdings Ltd | | 6 700 | 1,2 | | | | 1,2 |
| Renault SA | | 226 946 | 27,1 | | | | 27,1 |
| Reno de Medici SpA | | 34 450 000 | 14,9 | | | | 14,9 |
| Repsol SA | | 1 416 174 | 26,9 | | | | 26,9 |
| Republic Services Inc | | 114 700 | 8,8 | | | | 8,8 |
| Resilient REIT Ltd | | 799 538 | 9,0 | | | | 9,0 |
| ResMed Inc | | 374 205 | 5,6 | | | | 5,6 |
| Resona Holdings Inc | | 1 795 200 | 12,4 | | | | 12,4 |
| Ressources Appalaches Inc | | 6 053 000 | 0,1 | | | | 0,1 |
| Ressources Brionor Inc | | 2 955 555 | 0,1 | | | | 0,1 |

| | | | | |
|----------------------------------|-----------|-------|-------|-------|
| Ressources Cartier Inc | 6 135 149 | 1,2 | 0,1 | 1,3 |
| Ressources Géoméga Inc | 3 443 246 | 0,3 | | 0,3 |
| Ressources Minières Radisson Inc | 6 152 348 | 1,0 | | 1,0 |
| Ressources Monarques Inc | 5 768 717 | 2,2 | | 2,2 |
| Ressources Sirios Inc | 8 145 754 | 3,6 | | 3,6 |
| Ressources Strateco Inc | 1 096 745 | - | | - |
| Ressources Threegold Inc, Les | 1 615 666 | - | | - |
| Rexel SA | 396 104 | 8,8 | | 8,8 |
| Reynolds American Inc | 449 049 | 33,7 | | 33,7 |
| RHB Bank Bhd | 2 635 800 | 3,7 | | 3,7 |
| Richter Gedeon Nyrt | 580 263 | 16,5 | | 16,5 |
| Ricoh Co Ltd | 83 265 | 0,9 | | 0,9 |
| Rinnai Corp | 12 600 | 1,4 | | 1,4 |
| Rio Tinto Ltd | 525 | - | | - |
| Rio Tinto PLC | 654 675 | 34,3 | | 34,3 |
| Ritchie Bros Auctioneers Inc | 7 804 800 | 355,5 | | 355,5 |
| Rite Aid Corp | 1 508 600 | 16,7 | | 16,7 |
| RLI Corp | 113 354 | 9,6 | | 9,6 |
| RMB Holdings Ltd | 2 199 160 | 14,3 | | 14,3 |
| Robert Half International Inc | 37 111 | 2,4 | | 2,4 |
| Robinson Department Store PCL | 1 642 959 | 3,9 | | 3,9 |
| Robinsons Land Corp | 2 486 600 | 1,7 | | 1,7 |
| Robinsons Retail Holdings Inc | 2 480 550 | 5,0 | | 5,0 |
| Roche Holding AG | 2 017 509 | 619,2 | | 619,2 |
| Rockwell Automation Inc | 48 477 | 8,7 | | 8,7 |
| Rockwell Collins Inc | 65 390 | 8,1 | | 8,1 |
| Rogers Communications Inc | 91 605 | 4,7 | 117,2 | 121,9 |
| Rohm Co Ltd | 78 026 | 6,0 | | 6,0 |
| Rokos Global Macro Fund Ltd | 1 082 129 | 227,3 | | 227,3 |
| Rolls-Royce Holdings PLC | 997 447 | 11,0 | | 11,0 |
| Roper Technologies Inc | 14 645 | 3,6 | | 3,6 |
| Rosneft Oil Co PJSC | 2 836 332 | 25,1 | | 25,1 |
| Ross Stores Inc | 50 853 | 4,5 | | 4,5 |
| Rostelecom PJSC | 3 024 855 | 5,6 | | 5,6 |
| Rotam Global Agrosociences Ltd | 444 914 | 0,6 | | 0,6 |
| Royal Bank of Scotland Group PLC | 4 913 638 | 18,3 | 213,4 | 231,7 |
| Royal Bank of Scotland PLC, The | | | 38,2 | 38,2 |
| Royal Boskalis Westminster NV | 90 866 | 4,2 | | 4,2 |
| Royal Caribbean Cruises Ltd | 57 711 | 6,3 | | 6,3 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|--|--------------|-------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Royal Dutch Shell PLC | classe A | 3 280 453 | 121,9 | | | 121,9 | |
| | classe B | 2 278 890 | 88,9 | | | 88,9 | 210,8 |
| Royal Gold Inc | | 10 500 | 0,9 | | | | 0,9 |
| Royal Mail PLC | | 805 027 | 6,2 | | | | 6,2 |
| RSA Insurance Group PLC | | 397 292 | 3,9 | | | | 3,9 |
| RTL Group SA | | 69 262 | 6,8 | | | | 6,8 |
| Ruentex Development Co Ltd | | 1 656 367 | 2,5 | | | | 2,5 |
| Ruentex Industries Ltd | | 484 223 | 1,1 | | | | 1,1 |
| Rumo Logistica Operadora Multimodal SA | | 9 782 555 | 24,7 | | | | 24,7 |
| RusHydro PJSC | | 501 687 646 | 10,2 | | | | 10,2 |
| RWE AG | | 1 888 885 | 31,6 | | | | 31,6 |
| Ryanair Holdings PLC | | 59 085 | 6,6 | | | | 6,6 |
| Ryman Healthcare Ltd | | 109 696 | 0,8 | | | | 0,8 |
| Ryman Hospitality Properties Inc | | 76 800 | 6,5 | | | | 6,5 |
| Ryohin Keikaku Co Ltd | | 3 300 | 0,9 | | | | 0,9 |
| S&P Global Inc | | 162 005 | 23,4 | | | | 23,4 |
| S1 Corporation | | 57 284 | 5,6 | | | | 5,6 |
| Sabre Corp | | 232 047 | 7,8 | | | | 7,8 |
| SACI Falabella | | 1 809 828 | 19,2 | | | | 19,2 |
| Safeway Inc | | 223 536 | 0,2 | | | | 0,2 |
| Safran SA | | 228 791 | 22,1 | | | | 22,1 |
| Sage Group PLC, The | | 492 756 | 5,3 | | | | 5,3 |
| SAIC Motor Corp Ltd | | 5 100 359 | 23,1 | | | | 23,1 |
| Saipem SpA | | 9 400 937 | 7,1 | | | | 7,1 |
| salesforce.com inc | | 34 874 | 3,2 | | | | 3,2 |
| Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc | | | | | 171,9 | | 171,9 |
| Sampo Oyj | | 108 846 | 6,6 | | | | 6,6 |
| Samsonite International SA | | 571 400 | 2,2 | | | | 2,2 |
| Samsung Biologics Co Ltd | | 35 441 | 5,9 | | | | 5,9 |
| Samsung C&T Corp | | 208 773 | 29,1 | | | | 29,1 |
| Samsung Card Co Ltd | | 104 811 | 4,6 | | | | 4,6 |
| Samsung Electro-Mechanics Co Ltd | | 197 938 | 11,2 | | | | 11,2 |
| Samsung Electronics Co Ltd | | 365 357 | 731,0 | | | 731,0 | |
| | privilégiées | 61 446 | 97,8 | | | 97,8 | 828,8 |

| | | | | | |
|--|--------------|------------|-------|-------|-------|
| Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd | | 115 277 | 34,4 | 34,4 | |
| | privilégiées | 744 | 0,2 | 0,2 | 34,6 |
| Samsung Heavy Industries Co Ltd | | 151 148 | 1,6 | | 1,6 |
| Samsung Life Insurance Co Ltd | | 242 286 | 30,3 | | 30,3 |
| Samsung SDI Co Ltd | | 185 160 | 22,4 | | 22,4 |
| Samsung SDS Co Ltd | | 104 985 | 16,3 | | 16,3 |
| Samsung Securities Co Ltd | | 172 819 | 6,1 | | 6,1 |
| Sanan Optoelectronics Co Ltd | | 3 690 336 | 9,5 | | 9,5 |
| Sands China Ltd | | 1 910 000 | 11,1 | | 11,1 |
| Sandvik AB | | 627 020 | 10,4 | | 10,4 |
| Sankyo Co Ltd | | 42 262 | 1,8 | | 1,8 |
| Sanlam Ltd | | 4 461 496 | 27,5 | | 27,5 |
| Sanofi SA | | 6 196 534 | 674,0 | | 674,0 |
| Santen Pharmaceutical Co Ltd | | 110 980 | 1,8 | | 1,8 |
| Santos Brasil Participacoes SA | | 3 474 200 | 3,4 | | 3,4 |
| Santos Ltd | | 5 638 010 | 22,0 | | 22,0 |
| SAP SE | | 429 639 | 50,3 | | 50,3 |
| Sappi Ltd | | 1 742 664 | 15,4 | | 15,4 |
| SapuraKencana Petroleum Bhd | | 12 800 282 | 6,2 | | 6,2 |
| Saputo Inc | | 8 040 000 | 382,0 | | 382,0 |
| Sasol Ltd | | 2 112 845 | 82,7 | | 82,7 |
| SATS Ltd | | 656 000 | 3,0 | | 3,0 |
| SBA Communications Corp | | 7 400 | 1,0 | | 1,0 |
| Sberbank of Russia PJSC | | 27 723 162 | 105,4 | 105,4 | |
| | privilégiées | 2 568 519 | 7,3 | 7,3 | 112,7 |
| SBI Holdings Inc | | 60 430 | 1,0 | | 1,0 |
| SCANA Corp | | 189 074 | 18,6 | | 18,6 |
| Scentre Group | | 3 746 | - | | - |
| Schaeffler AG | | 281 094 | 5,6 | | 5,6 |
| Schibsted ASA | | 14 861 | 0,5 | 0,5 | |
| | classe B | 17 522 | 0,5 | 0,5 | 1,0 |
| Schindler Holding AG | | 18 367 | 4,3 | | 4,3 |
| Schlumberger Ltd | | 1 828 948 | 205,9 | | 205,9 |
| Schneider Electric SE | | 2 474 779 | 231,4 | | 231,4 |
| Schooner Trust | | | | 19,1 | 19,1 |
| Schroders PLC | | 39 432 | 2,0 | | 2,0 |
| SCOR SE | | 339 114 | 15,7 | | 15,7 |
| Scotiabank Tier I Trust | | | | 19,9 | 19,9 |
| Scotts Miracle-Gro Company , The | | 21 717 | 2,8 | | 2,8 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|--|-------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| SCREEN Holdings Co Ltd | | 22 560 | 1,9 | | | | 1,9 |
| Scripps Networks Interactive Inc | | 24 937 | 2,4 | | | | 2,4 |
| Seagate Technology PLC | | 239 600 | 12,3 | | | | 12,3 |
| Sealed Air Corp | | 29 344 | 1,8 | | 76,9 | | 78,7 |
| SeaWorld Entertainment Inc | | 454 182 | 11,5 | | | | 11,5 |
| Secom Co Ltd | | 271 405 | 26,7 | | | | 26,7 |
| Secure Energy Services Inc | | 13 153 851 | 154,0 | | | | 154,0 |
| Securitas AB | | 170 136 | 3,6 | | | | 3,6 |
| Security Bank Corp | | 273 010 | 1,4 | | | | 1,4 |
| SEEK Ltd | | 1 072 | - | | | | - |
| Sega Sammy Holdings Inc | | 136 969 | 2,7 | | | | 2,7 |
| Segro PLC | | 205 427 | 1,6 | | | | 1,6 |
| SEI Investments Co | | 10 600 | 0,7 | | | | 0,7 |
| Seibu Holdings Inc | | 7 086 | 0,2 | | | | 0,2 |
| Seiko Epson Corp | | 2 064 | 0,1 | | | | 0,1 |
| Sekisui Chemical Co Ltd | | 229 500 | 4,9 | | | | 4,9 |
| Sekisui House Ltd | | 307 856 | 6,9 | | | | 6,9 |
| Sembcorp Industries Ltd | | 1 867 100 | 4,9 | | | | 4,9 |
| Semen Indonesia Persero Tbk PT | | 5 298 014 | 4,8 | | | | 4,8 |
| Semiconductor Manufacturing International Corp | | 6 312 752 | 13,3 | | | | 13,3 |
| Sempra Energy | | 241 395 | 32,6 | | | | 32,6 |
| Seneca Park CLO Ltd | | | | | 134,4 | | 134,4 |
| Sensata Technologies Holding NV | | 38 100 | 2,0 | | | | 2,0 |
| Sensato Asia Pacific Offshore Fund Ltd | | 374 | 0,6 | | | | 0,6 |
| Service Corp International | | | | | 65,5 | | 65,5 |
| ServiceNow Inc | | 4 500 | 0,4 | | | | 0,4 |
| SES SA | | 14 099 532 | 417,3 | | | | 417,3 |
| Seven & i Holdings Co Ltd | | 677 252 | 34,7 | | | | 34,7 |
| Seven Bank Ltd | | 166 500 | 0,6 | | | | 0,6 |
| Seven Generations Energy Ltd | | 16 199 600 | 507,2 | | | | 507,2 |
| Severn Trent PLC | | 320 404 | 11,8 | | | | 11,8 |
| Severstal PAO | | 703 001 | 14,5 | | | | 14,5 |
| SFR Group SA | | 128 065 | 4,9 | | | | 4,9 |

| | | | | | |
|---|-------------------|------------|-------|-------|-------|
| SGS SA | | 5 356 | 14,6 | | 14,6 |
| Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd | | 4 334 009 | 3,9 | | 3,9 |
| Shanghai Electric Group Co Ltd | | 6 502 637 | 3,9 | | 3,9 |
| Shanghai Feilo Acoustics Co Ltd | | 1 466 469 | 3,0 | | 3,0 |
| Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd | classe A | 9 872 599 | 44,1 | 44,1 | |
| | classe H | 928 360 | 3,8 | 3,8 | 47,9 |
| Shanghai Industrial Holdings Ltd | | 1 126 010 | 4,1 | | 4,1 |
| Shanghai International Airport Co Ltd | | 4 833 070 | 24,7 | | 24,7 |
| Shanghai Jahwa United Co Ltd | | 148 000 | 0,8 | | 0,8 |
| Shanghai Jiabao Industry & Commerce Group Co Ltd | | 4 548 646 | 12,6 | | 12,6 |
| Shanghai Lujiazui Finance & Trade Zone Development Co Ltd | | 2 111 072 | 4,1 | | 4,1 |
| Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd | classe A | 3 208 703 | 12,1 | 12,1 | |
| | classe spéciale H | 1 586 509 | 4,9 | 4,9 | 17,0 |
| Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd | | 3 459 369 | 10,8 | | 10,8 |
| Shangri-La Asia Ltd | | 1 834 833 | 2,6 | | 2,6 |
| Sharp Corp | | 1 065 000 | 3,3 | | 3,3 |
| Shaw Communications Inc | | 3 845 473 | 103,6 | 164,5 | 268,1 |
| Shenzhen Inovance Technology Co Ltd | | 3 500 748 | 13,7 | | 13,7 |
| Shenzhen Tianyuan Dic Information Technology Co Ltd | | 2 500 570 | 9,6 | | 9,6 |
| Shenzhou International Group Holdings Ltd | | 1 287 623 | 10,9 | | 10,9 |
| Sherwin-Williams Co, The | | 8 623 | 3,1 | | 3,1 |
| Shimadzu Corp | | 97 000 | 2,1 | | 2,1 |
| Shimamura Co Ltd | | 11 919 | 2,0 | | 2,0 |
| Shimano Inc | | 892 971 | 188,3 | | 188,3 |
| Shimao Property Holdings Ltd | | 3 623 957 | 6,4 | | 6,4 |
| Shimizu Corp | | 359 000 | 4,4 | | 4,4 |
| Shin Kong Financial Holding Co Ltd | | 25 136 337 | 8,3 | | 8,3 |
| Shin-Etsu Chemical Co Ltd | | 240 390 | 25,1 | | 25,1 |
| Shinhan Financial Group Co Ltd | | 1 424 360 | 71,6 | | 71,6 |
| Shinsegae Inc | | 51 570 | 10,1 | | 10,1 |
| Shinsei Bank Ltd | | 8 280 | - | | - |
| Shionogi & Co Ltd | | 65 169 | 4,2 | | 4,2 |
| Shire PLC | | 164 083 | 12,9 | | 12,9 |
| Shiseido Co Ltd | | 136 094 | 4,6 | | 4,6 |
| Shizuoka Bank Ltd, The | | 183 457 | 2,1 | | 2,1 |
| Shoprite Holdings Ltd | | 1 966 259 | 33,1 | | 33,1 |
| Showa Denko KK | | 408 600 | 7,9 | | 7,9 |
| Showa Shell Sekiyu KK | | 741 | - | | - |
| Shree Cement Ltd | | 12 775 | 3,7 | | 3,7 |

au 31 décembre 2016

(juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|---|-------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Shriram Transport Finance Co Ltd | | 225 345 | 3,8 | | | | 3,8 |
| Shutterstock Inc | | 181 398 | 11,6 | | | | 11,6 |
| Siam Cement PCL, The | | 1 447 649 | 27,0 | | | | 27,0 |
| Siam Commercial Bank PCL, The | | 7 571 570 | 43,2 | | | | 43,2 |
| Sibanye Gold Ltd | | 2 273 960 | 5,7 | | | | 5,7 |
| Siemens AG | | 1 073 781 | 177,4 | | | | 177,4 |
| Siemens Ltd | | 108 836 | 2,4 | | | | 2,4 |
| Sigma Pharmaceuticals Ltd | | 1 000 000 | 1,3 | | | | 1,3 |
| Signature Bank | | 5 000 | 1,0 | | | | 1,0 |
| Signet Jewelers Ltd | | 18 591 | 2,4 | | | | 2,4 |
| Sika AG | | 405 | 2,6 | | | | 2,6 |
| Silicon Laboratories Inc | | 133 096 | 11,6 | | | | 11,6 |
| Siliconware Precision Industries Co Ltd | | 4 001 712 | 8,0 | | | | 8,0 |
| Sime Darby Bhd | | 8 282 527 | 20,1 | | | | 20,1 |
| Simon Property Group Inc | | 24 400 | 5,8 | | | | 5,8 |
| SINA Corp | | 129 830 | 10,6 | | | | 10,6 |
| Singapore Airlines Ltd | | 798 310 | 7,2 | | | | 7,2 |
| Singapore Exchange Ltd | | 478 072 | 3,2 | | | | 3,2 |
| Singapore Press Holdings Ltd | | 598 787 | 2,0 | | | | 2,0 |
| Singapore Telecommunications Ltd | | 7 590 308 | 25,7 | | | | 25,7 |
| Sino Biopharmaceutical Ltd | | 10 237 331 | 9,7 | | | | 9,7 |
| Sino Land Co Ltd | | 1 827 190 | 3,7 | | | | 3,7 |
| Sino-Ocean Group Holding Ltd | | 8 631 934 | 5,2 | | | | 5,2 |
| SinoPac Financial Holdings Co Ltd | | 35 852 748 | 13,5 | | | | 13,5 |
| Sinopec Engineering Group Co Ltd | | 2 857 209 | 3,2 | | | | 3,2 |
| Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd | | 8 043 130 | 5,8 | | | | 5,8 |
| Sinopharm Group Co Ltd | | 3 124 188 | 17,3 | | | | 17,3 |
| Sinotrans Ltd | | 7 551 000 | 4,5 | | | | 4,5 |
| Sirius XM Holdings Inc | | 522 900 | 3,1 | | | | 3,1 |
| Sistema PJSC FC | | 566 868 | 6,8 | | | | 6,8 |
| SJM Holdings Ltd | | 5 519 786 | 5,8 | | | | 5,8 |
| SK Chemicals Co Ltd | | 32 131 | 2,4 | | | | 2,4 |
| SK Holdings Co Ltd | | 177 859 | 45,3 | | | | 45,3 |

| | | | |
|---|-------------|---------|---------|
| SK Hynix Inc | 1 897 069 | 94,2 | 94,2 |
| SK Innovation Co Ltd | 235 992 | 38,4 | 38,4 |
| SK Networks Co Ltd | 573 568 | 4,4 | 4,4 |
| SK Telecom Co Ltd | 109 235 | 18,6 | 18,6 |
| Skandinaviska Enskilda Banken AB | 547 549 | 7,7 | 7,7 |
| Skanska AB | 248 538 | 7,9 | 7,9 |
| SKF AB | 243 128 | 6,0 | 6,0 |
| SKF India Ltd | 216 222 | 5,4 | 5,4 |
| Sky PLC | 930 428 | 15,3 | 15,3 |
| Skyworks Solutions Inc | 35 276 | 3,5 | 3,5 |
| SL Green Realty Corp | 58 353 | 8,4 | 8,4 |
| SM Investments Corp | 795 099 | 14,0 | 14,0 |
| SM Prime Holdings Inc | 27 365 226 | 20,9 | 20,9 |
| SMC Corp | 31 212 | 10,0 | 10,0 |
| Smiles SA | 500 000 | 9,2 | 9,2 |
| Smith & Nephew PLC | 456 128 | 9,2 | 9,2 |
| Smiths Group PLC | 166 919 | 3,9 | 3,9 |
| Snam SpA | 4 428 143 | 24,5 | 24,5 |
| Snap-on Inc | 11 567 | 2,7 | 2,7 |
| SNCF Réseau | | | 235,6 |
| Sobeys Inc | | | 133,8 |
| Sociedad Quimica y Minera de Chile SA | 283 502 | 10,8 | 10,8 |
| Societatea Nationala de Gaze Naturale ROMGAZ SA | 749 600 | 5,8 | 5,8 |
| Societatea Nationala Nuclearelectrica SA | 1 076 700 | 1,6 | 1,6 |
| Société Asbestos Ltée | 259 065 | - | - |
| Société Aurifère Barrick | 145 300 | 3,1 | 3,1 |
| Société BIC SA | 13 285 | 2,4 | 2,4 |
| Société d'exploration minière Vior Inc | 1 761 874 | 0,2 | 0,2 |
| Société Financière Manuvie | 57 352 024 | 1 371,3 | 1 371,3 |
| Société Générale SA | 440 495 | 29,1 | 29,1 |
| Socovesa SA | 4 411 071 | 1,7 | 1,7 |
| Sodexo SA | 91 984 | 14,2 | 14,2 |
| SoftBank Group Corp | 1 120 794 | 100,1 | 100,1 |
| Sohgo Security Services Co Ltd | 21 800 | 1,1 | 1,1 |
| SOHO China Ltd | 4 787 738 | 3,2 | 3,2 |
| S-Oil Corp | 47 793 | 4,5 | 4,5 |
| Solutions Extenway Inc | 61 877 444 | 0,6 | - |
| Solvay SA | 97 254 | 15,3 | 15,3 |
| Somos Educacao SA | 118 339 619 | 104,6 | 104,6 |

au 31 décembre 2016

(juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|--------------------------------|-------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Sompo Holdings Inc | | 286 990 | 13,1 | | | | 13,1 |
| Songwon Industrial Co Ltd | | 264 532 | 5,0 | | | | 5,0 |
| Sonic Healthcare Ltd | | 330 992 | 6,9 | | | | 6,9 |
| Sonova Holding AG | | 15 741 | 2,6 | | | | 2,6 |
| Sony Corp | | 500 338 | 18,8 | | | | 18,8 |
| Sony Financial Holdings Inc | | 137 900 | 2,9 | | | | 2,9 |
| Sotheby's | | 222 845 | 11,9 | | | | 11,9 |
| South32 Ltd | | 7 888 525 | 21,1 | | | | 21,1 |
| Southern Company, The | | 2 266 583 | 149,5 | | | | 149,5 |
| Southern Copper Corp | | 250 599 | 10,7 | | | | 10,7 |
| Southern Cross Media Group Ltd | | 1 291 800 | 1,9 | | | | 1,9 |
| Southwest Airlines Co | | 141 318 | 9,4 | | | | 9,4 |
| Southwest Bancorp Inc | | 40 000 | 1,6 | | | | 1,6 |
| Southwestern Energy Co | | 173 171 | 2,5 | | | | 2,5 |
| Spar Group Limited, The | | 586 616 | 11,4 | | | | 11,4 |
| SpareBank 1 SR-Bank ASA | | 668 400 | 6,3 | | | | 6,3 |
| Spark New Zealand Ltd | | 1 067 697 | 3,4 | | | | 3,4 |
| SPDR Gold Shares | | 222 665 | 32,7 | | | | 32,7 |
| SPDR S&P500 ETF Trust | | 501 000 | 150,2 | | | | 150,2 |
| Spectra Energy Corp | | 857 177 | 47,2 | | | | 47,2 |
| Sphinx Ressources Ltd | | 1 534 042 | 0,1 | | | | 0,1 |
| SPIE SA | | 20 369 031 | 576,7 | | | | 576,7 |
| Spirit Realty Capital Inc | | 742 600 | 10,8 | | | | 10,8 |
| Splunk Inc | | 6 500 | 0,4 | | | | 0,4 |
| Sprint Corp | | 3 175 200 | 35,9 | | | | 35,9 |
| SSE PLC | | 1 879 268 | 48,4 | | | | 48,4 |
| St James's Place PLC | | 78 338 | 1,3 | | | | 1,3 |
| St. Jude Medical Inc | | 1 120 345 | 120,5 | | | | 120,5 |
| Standard Bank Group Ltd | | 4 088 964 | 60,8 | | | | 60,8 |
| Standard Chartered PLC | | 3 202 545 | 35,2 | | | | 35,2 |
| Standard Foods Corp | | 1 300 770 | 4,1 | | | | 4,1 |
| Standard Life PLC | | 806 870 | 5,0 | | | | 5,0 |
| Stanley Black & Decker Inc | | 1 232 844 | 189,6 | | | | 189,6 |

| | | | | |
|--------------------------------------|------------|-------|------|-------|
| Stanley Electric Co Ltd | 57 040 | 2,1 | | 2,1 |
| Staples Inc | 691 000 | 8,4 | | 8,4 |
| Starbucks Corp | 132 422 | 9,9 | | 9,9 |
| StarHub Ltd | 751 900 | 2,0 | | 2,0 |
| Start Today Co Ltd | 13 300 | 0,3 | | 0,3 |
| State Bank of India | 6 104 973 | 30,6 | | 30,6 |
| State Street Corp | 1 924 283 | 200,6 | | 200,6 |
| Statoil ASA | 2 625 545 | 64,8 | | 64,8 |
| Steinhoff International Holdings NV | 9 629 882 | 67,3 | | 67,3 |
| Stericycle Inc | 17 717 | 1,8 | | 1,8 |
| STMicroelectronics NV | 965 909 | 14,7 | | 14,7 |
| Stockland | 591 506 | 2,6 | | 2,6 |
| Stone Milliner Macro Fund LP | 2 039 408 | 286,8 | | 286,8 |
| Stora Enso Oyj | 469 808 | 6,8 | | 6,8 |
| Storm Resources Ltd | 15 001 000 | 79,5 | | 79,5 |
| Stornoway Diamond Corporation | 44 724 660 | 44,7 | 94,4 | 139,1 |
| Stratus Fund Ltd | 87 014 | 269,2 | | 269,2 |
| Stryker Corp | 81 229 | 13,1 | | 13,1 |
| Student Transportation Inc | 7 997 018 | 60,1 | | 60,1 |
| Suez | 833 355 | 16,5 | | 16,5 |
| Sul America SA | 265 233 | 2,0 | | 2,0 |
| Sumitomo Chemical Co Ltd | 1 058 799 | 6,8 | | 6,8 |
| Sumitomo Corp | 2 267 172 | 35,9 | | 35,9 |
| Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd | 250 | - | | - |
| Sumitomo Electric Industries Ltd | 512 180 | 9,9 | | 9,9 |
| Sumitomo Heavy Industries Ltd | 437 646 | 3,8 | | 3,8 |
| Sumitomo Metal Mining Co Ltd | 20 316 | 0,4 | | 0,4 |
| Sumitomo Mitsui Financial Group Inc | 2 120 294 | 108,7 | | 108,7 |
| Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc | 266 078 | 12,8 | | 12,8 |
| Sumitomo Realty & Development Co Ltd | 72 586 | 2,6 | | 2,6 |
| Sumitomo Rubber Industries Ltd | 1 421 | - | | - |
| Summarecon Agung Tbk PT | 7 371 826 | 1,0 | | 1,0 |
| Sun Art Retail Group Ltd | 5 489 439 | 6,5 | | 6,5 |
| Sun Hung Kai Properties Ltd | 1 191 382 | 20,2 | | 20,2 |
| Sun International Ltd | 645 005 | 5,5 | | 5,5 |
| Sun Pharmaceutical Industries Ltd | 1 597 602 | 19,9 | | 19,9 |
| Sun TV Network Ltd | 1 350 000 | 13,1 | | 13,1 |
| Sunac China Holdings Ltd | 4 440 569 | 5,0 | | 5,0 |
| Suncor Énergie Inc | 22 327 100 | 980,2 | | 980,2 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|---------------------------------------|--------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Suncorp Group Ltd | | 413 859 | 5,4 | | | | 5,4 |
| Sundrug Co Ltd | | 15 700 | 1,5 | | | | 1,5 |
| SUNeVision Holdings Ltd | | 1 914 000 | 1,1 | | | | 1,1 |
| Sungshin Cement Co Ltd | | 358 708 | 2,8 | | | | 2,8 |
| Sunny Optical Technology Group Co Ltd | | 1 641 600 | 9,6 | | | | 9,6 |
| Sunstone Hotel Investors Inc | | 547 103 | 11,2 | | | | 11,2 |
| Suntec Real Estate Investment Trust | | 730 500 | 1,1 | | | | 1,1 |
| Suntory Beverage & Food Ltd | | 4 792 400 | 267,5 | | | | 267,5 |
| SunTrust Banks Inc | | 997 271 | 73,4 | | | | 73,4 |
| Suofeiya Home Collection Co Ltd | | 1 367 000 | 14,3 | | | | 14,3 |
| Suprajit Engineering Ltd | | 553 475 | 2,1 | | | | 2,1 |
| Surgutneftegas OJSC | | 16 996 124 | 11,6 | | | 11,6 | |
| | privilégiées | 16 488 434 | 11,6 | | | 11,6 | 23,2 |
| Suruga Bank Ltd | | 23 051 | 0,7 | | | | 0,7 |
| Surya Citra Media Tbk PT | | 19 222 239 | 5,4 | | | | 5,4 |
| Suzano Papel e Celulose SA | | 228 949 | 1,3 | | | | 1,3 |
| Suzuken Co Ltd | | 153 684 | 6,8 | | | | 6,8 |
| Suzuki Motor Corp | | 149 100 | 7,1 | | | | 7,1 |
| Svenska Cellulosa AB SCA | | 276 885 | 10,5 | | | | 10,5 |
| Svenska Handelsbanken AB | | 956 821 | 17,9 | | | | 17,9 |
| Swatch Group AG, The | classe B | 15 590 | 6,5 | | | 6,5 | |
| | classe R | 25 076 | 2,1 | | | 2,1 | 8,6 |
| Swedbank AB | | 246 609 | 8,0 | | | | 8,0 |
| Swedish Match AB | | 54 210 | 2,3 | | | | 2,3 |
| Swire Pacific Ltd | | 515 553 | 6,6 | | | | 6,6 |
| Swire Properties Ltd | | 1 724 200 | 6,4 | | | | 6,4 |
| Swiss Life Holding AG | | 12 680 | 4,8 | | | | 4,8 |
| Swiss Prime Site AG | | 14 129 | 1,6 | | | | 1,6 |
| Swiss Re AG | | 107 479 | 13,7 | | | | 13,7 |
| Swisscom AG | | 428 931 | 258,1 | | | | 258,1 |
| Sydney Airport | | 1 548 904 | 9,0 | | | | 9,0 |
| Symantec Corp | | 333 600 | 10,7 | | | | 10,7 |
| Symrise AG | | 92 351 | 7,6 | | | | 7,6 |
| Synchrony Financial | | 246 476 | 12,0 | | | | 12,0 |

| | | | |
|---|------------|-------|-------|
| Syngenta AG | 25 078 | 13,3 | 13,3 |
| Synnex Technology International Corp | 4 659 441 | 6,3 | 6,3 |
| Synopsys Inc | 43 500 | 3,4 | 3,4 |
| Synthos SA | 948 292 | 1,4 | 1,4 |
| Sysco Corp | 509 200 | 37,8 | 37,8 |
| Systemex Corp | 106 405 | 8,3 | 8,3 |
| T Rowe Price Group Inc | 29 084 | 2,9 | 2,9 |
| T&D Holdings Inc | 302 572 | 5,4 | 5,4 |
| Tabcorp Holdings Ltd | 429 966 | 2,0 | 2,0 |
| Taiheiyō Cement Corp | 749 000 | 3,2 | 3,2 |
| TaiMed Biologics Inc | 69 000 | 0,5 | 0,5 |
| Taisei Corp | 429 347 | 4,0 | 4,0 |
| Taishin Financial Holdings Co Ltd | 15 827 247 | 7,8 | 7,8 |
| Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd | 1 800 | 0,2 | 0,2 |
| Taiwan Business Bank | 7 503 000 | 2,5 | 2,5 |
| Taiwan Cement Corp | 6 645 237 | 9,7 | 9,7 |
| Taiwan Cooperative Financial Holding Co Ltd | 20 611 279 | 12,0 | 12,0 |
| Taiwan Fertilizer Co Ltd | 2 416 374 | 4,0 | 4,0 |
| Taiwan Mobile Co Ltd | 3 635 460 | 15,7 | 15,7 |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 88 332 693 | 682,3 | 682,3 |
| Taiyo Nippon Sanso Corp | 162 774 | 2,5 | 2,5 |
| Takashimaya Co Ltd | 301 540 | 3,3 | 3,3 |
| Takeda Pharmaceutical Co Ltd | 662 730 | 36,8 | 36,8 |
| TAL Education Group | 98 274 | 9,2 | 9,2 |
| Talaat Moustafa Group | 3 129 391 | 2,1 | 2,1 |
| Tallink Grupp AS | 1 848 700 | 2,4 | 2,4 |
| Targa Resources Corp | 165 020 | 12,4 | 12,4 |
| Target Corp | 52 500 | 5,1 | 5,1 |
| Taro Pharmaceutical Industries Ltd | 11 200 | 1,6 | 1,6 |
| Tarpon Investimentos SA | 1 | 154,7 | 154,7 |
| Tasly Pharmaceutical Group Co Ltd | 4 840 516 | 38,8 | 38,8 |
| Tata Chemicals Ltd | 1 119 516 | 11,1 | 11,1 |
| Tata Consultancy Services Ltd | 1 200 781 | 56,1 | 56,1 |
| Tata Motors Ltd | 4 474 141 | 41,7 | 41,7 |
| | classe A | | 4,4 |
| | 737 063 | 4,4 | 46,1 |
| Tata Power Co Ltd | 2 773 659 | 4,2 | 4,2 |
| Tata Steel Ltd | 1 619 896 | 12,5 | 12,5 |
| Tate & Lyle PLC | 286 576 | 3,4 | 3,4 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|---|--------------|-------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Tatneft PJSC | | 7 077 237 | 66,4 | | | 66,4 | |
| | privilégiées | 57 450 | 0,3 | | | 0,3 | 66,7 |
| Tatts Group Ltd | | 800 274 | 3,5 | | | | 3,5 |
| Tauron Polska Energia SA | | 2 905 454 | 2,7 | | | | 2,7 |
| TAV Havalimanlari Holding AS | | 1 689 679 | 9,0 | | | | 9,0 |
| Taylor Wimpey PLC | | 3 849 431 | 9,8 | | | | 9,8 |
| TCF Financial Corp | | 453 480 | 11,9 | | | | 11,9 |
| TCI Co Ltd | | 144 000 | 1,0 | | | | 1,0 |
| TD Ameritrade Holding Corp | | 3 266 000 | 191,0 | | | | 191,0 |
| TD Capital Trust IV | | | | | 19,7 | | 19,7 |
| TDC AS | | 891 021 | 6,1 | | | | 6,1 |
| TDK Corp | | 92 933 | 8,6 | | | | 8,6 |
| TE Connectivity Ltd | | 163 000 | 15,1 | | | | 15,1 |
| Tech Mahindra Ltd | | 1 279 943 | 12,4 | | | | 12,4 |
| Technip SA | | 58 326 | 5,6 | | | | 5,6 |
| Technologies D-Box inc | | 19 108 882 | 10,1 | | 5,0 | | 15,1 |
| Technologies Sensio Inc | | 18 724 393 | 0,1 | | | | 0,1 |
| Technologies Sonomax Inc | | 26 000 000 | - | | | | - |
| Technos SA | | 947 000 | 1,4 | | | | 1,4 |
| Techtronic Industries Co Ltd | | 585 981 | 2,8 | | | | 2,8 |
| Teck Resources Ltd | | 1 576 166 | 48,9 | | | | 48,9 |
| Teco Electric and Machinery Co Ltd | | 6 252 732 | 7,3 | | | | 7,3 |
| TEGNA Inc | | 101 700 | 2,9 | | | | 2,9 |
| Teijin Ltd | | 99 048 | 2,7 | | | | 2,7 |
| Tele2 AB | | 490 024 | 5,3 | | | | 5,3 |
| Telecom Italia SpA | | 20 916 927 | 23,1 | | | | 23,1 |
| Telefonaktiebolaget LM Ericsson | | 3 369 739 | 26,6 | | | | 26,6 |
| Telefonica Brasil SA | | 604 859 | 11,0 | | | | 11,0 |
| Telefonica Deutschland Holding AG | | 1 911 055 | 11,0 | | | | 11,0 |
| Telefonica SA | | 5 238 938 | 65,4 | | | | 65,4 |
| Telekom Malaysia Bhd | | 3 704 847 | 6,6 | | | | 6,6 |
| Telekomunikasi Indonesia Persero Tbk PT | | 177 740 647 | 70,4 | | | | 70,4 |
| Telenet Group Holding NV | | 20 792 | 1,6 | | | | 1,6 |
| Telenor ASA | | 827 244 | 16,6 | | | | 16,6 |

| | | | | |
|------------------------------------|------------|-------|-------|-------|
| Telia Co AB | 3 667 851 | 19,9 | | 19,9 |
| Telkom SA SOC Ltd | 876 266 | 6,4 | | 6,4 |
| Telstra Corp Ltd | 2 773 240 | 13,7 | | 13,7 |
| TELUS Corporation | 9 398 267 | 401,8 | 285,9 | 687,7 |
| Tempur Sealy International Inc | 137 748 | 12,6 | | 12,6 |
| Tenaga Nasional Bhd | 15 793 802 | 65,6 | | 65,6 |
| Tenaris SA | 401 802 | 9,6 | | 9,6 |
| Tencent Holdings Ltd | 14 104 266 | 462,8 | | 462,8 |
| Tenneco Inc | | | 99,2 | 99,2 |
| Teradata Corp | 197 487 | 7,2 | | 7,2 |
| Terna Rete Elettrica Nazionale SpA | 3 330 306 | 20,5 | | 20,5 |
| Terumo Corp | 388 450 | 19,3 | | 19,3 |
| Tesco PLC | 14 606 490 | 50,1 | | 50,1 |
| Tesla Motors Inc | 3 200 | 0,9 | | 0,9 |
| Tesoro Corp | 319 100 | 37,4 | | 37,4 |
| Teva Pharmaceutical Industries Ltd | 555 328 | 27,0 | | 27,0 |
| Texas Instruments Inc | 143 915 | 14,1 | | 14,1 |
| Thai Oil PCL | 5 679 755 | 15,4 | | 15,4 |
| Thai Union Group PCL | 6 273 176 | 4,9 | | 4,9 |
| Thales SA | 63 394 | 8,3 | | 8,3 |
| Theratechnologies Inc | 5 263 700 | 14,4 | | 14,4 |
| Thermo Fisher Scientific Inc | 863 782 | 163,4 | | 163,4 |
| Thermon Group Holdings Inc | 357 184 | 9,1 | | 9,1 |
| THK Co Ltd | 56 564 | 1,7 | | 1,7 |
| Thor Industries Inc | 92 689 | 12,4 | | 12,4 |
| ThyssenKrupp AG | 439 170 | 14,1 | | 14,1 |
| Tiffany & Co | 101 669 | 10,6 | | 10,6 |
| Tiger Brands Ltd | 483 336 | 18,9 | | 18,9 |
| Tim Participacoes SA | 1 845 095 | 6,0 | | 6,0 |
| Time Warner Inc | 972 023 | 125,8 | | 125,8 |
| Timken Co, The | 29 607 | 1,6 | | 1,6 |
| Tingyi Cayman Islands Holding Corp | 4 712 400 | 7,7 | | 7,7 |
| Titan Cement Co SA | 197 439 | 6,2 | | 6,2 |
| Titan Co Ltd | 474 729 | 3,1 | | 3,1 |
| TJX Cos Inc, The | 129 718 | 13,1 | | 13,1 |
| TMB Bank PCL | 43 204 007 | 3,4 | | 3,4 |
| T-Mobile US Inc | 5 000 | 0,4 | | 0,4 |
| Tobu Railway Co Ltd | 1 425 273 | 9,5 | | 9,5 |
| Tofas Turk Otomobil Fabrikasi AS | 335 967 | 3,2 | | 3,2 |

9 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS COTÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|--------------------------------------|-------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|---------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Toho Co Ltd | | 38 751 | 1,5 | | | | 1,5 |
| Toho Gas Co Ltd | | 612 555 | 6,7 | | | | 6,7 |
| Tohoku Electric Power Co Inc | | 466 410 | 7,9 | | | | 7,9 |
| Tokio Marine Holdings Inc | | 663 900 | 36,6 | | | | 36,6 |
| Tokyo Electric Power Co Holdings Inc | | 7 551 278 | 41,0 | | | | 41,0 |
| Tokyo Electron Ltd | | 166 827 | 21,2 | | | | 21,2 |
| Tokyo Gas Co Ltd | | 3 750 091 | 22,8 | | | | 22,8 |
| Tokyo Tatemono Co Ltd | | 48 700 | 0,9 | | | | 0,9 |
| Tokyu Corp | | 1 527 006 | 15,1 | | | | 15,1 |
| Tokyu Fudosan Holdings Corp | | 177 017 | 1,4 | | | | 1,4 |
| Toll Brothers Inc | | 64 600 | 2,7 | | | | 2,7 |
| Tomagold Corporation | | 2 948 612 | 0,2 | | | | 0,2 |
| TonenGeneral Sekiyu KK | | 3 549 | - | | | | - |
| Toppan Printing Co Ltd | | 559 733 | 7,2 | | | | 7,2 |
| Toray Industries Inc | | 526 183 | 5,7 | | | | 5,7 |
| Torchmark Corp | | 2 000 043 | 197,8 | | | | 197,8 |
| Toread Holdings Group Co Ltd | | 2 744 187 | 8,8 | | | | 8,8 |
| Toshiba Corp | | 23 019 | 0,1 | | | | 0,1 |
| Total Access Communication PCL | | 822 300 | 1,1 | | | | 1,1 |
| TOTAL SA | | 15 288 170 | 1 053,6 | | | | 1 053,6 |
| Total System Services Inc | | 179 165 | 11,8 | | | | 11,8 |
| TOTO Ltd | | 2 319 | 0,1 | | | | 0,1 |
| Tourbillon Global Equities Ltd | | 83 880 | 124,1 | | | | 124,1 |
| Tourmaline Oil Corp | | 5 910 000 | 212,2 | | | | 212,2 |
| Tower Bersama Infrastructure Tbk PT | | 5 881 552 | 2,9 | | | | 2,9 |
| Towngas China Co Ltd | | 9 516 000 | 6,7 | | | | 6,7 |
| Toyo Seikan Group Holdings Ltd | | 108 103 | 2,7 | | | | 2,7 |
| Toyo Suisan Kaisha Ltd | | 41 833 | 2,0 | | | | 2,0 |
| Toyoda Gosei Co Ltd | | 101 907 | 3,2 | | | | 3,2 |
| Toyota Boshoku Corp | | 200 000 | 6,2 | | | | 6,2 |
| Toyota Industries Corp | | 95 932 | 6,1 | | | | 6,1 |
| Toyota Motor Corp | | 1 141 435 | 90,3 | | | | 90,3 |
| Toyota Tsusho Corp | | 570 670 | 20,0 | | | | 20,0 |

| | | | |
|--|------------|-------|-------|
| TP ICAP PLC | 76 039 | 0,5 | 0,5 |
| TPG Telecom Ltd | 87 339 | 0,6 | 0,6 |
| TPG-Axon Partners (Offshore) Ltd | 2 724 | 3,5 | 3,5 |
| TPK Holding Co Ltd | 180 000 | 0,4 | 0,4 |
| Tractor Supply Co | 18 201 | 1,9 | 1,9 |
| Transaction Capital Ltd | 1 860 470 | 2,6 | 2,6 |
| Transat AT Inc | 2 200 000 | 12,1 | 12,1 |
| TransCanada Corporation | 15 122 032 | 915,5 | 915,5 |
| TransCanada PipeLines Ltd | | | 112,0 |
| Transcend Information Inc | 637 098 | 2,3 | 2,3 |
| Transcontinental Inc | | | 34,9 |
| TransDigm Group Inc | 3 200 | 1,1 | 1,1 |
| Transelectrica SA | 532 506 | 4,8 | 4,8 |
| Transneft PJSC | 4 082 | 17,8 | 17,8 |
| Transportadora de Gas del Sur SA | 182 056 | 2,2 | 2,2 |
| Transurban Group | 1 817 078 | 18,2 | 18,2 |
| Travelers Cos Inc, The | 313 476 | 51,5 | 51,5 |
| TravelSky Technology Ltd | 2 148 000 | 6,1 | 6,1 |
| Travis Perkins PLC | 128 363 | 3,1 | 3,1 |
| Treasury Wine Estates Ltd | 173 807 | 1,8 | 1,8 |
| Trend Micro Inc | 251 | - | - |
| TREVI - Finanziaria Industriale SpA | 300 000 | 0,4 | 0,4 |
| Trian Partners Co-Investment Opportunities Fund LP | 1 | 534,4 | 534,4 |
| Trian Partners Strategic Fund-C Ltd | 1 | 147,8 | 147,8 |
| Trican Well Service Ltd | 7 417 500 | 34,1 | 34,1 |
| Trimble Inc | 73 000 | 3,0 | 3,0 |
| Trinity Ltd | 11 208 000 | 1,1 | 1,1 |
| TripAdvisor Inc | 12 649 | 0,8 | 0,8 |
| True Corp PCL | 28 399 943 | 7,6 | 7,6 |
| Truworths International Ltd | 1 466 555 | 11,5 | 11,5 |
| Tryg AS | 53 901 | 1,3 | 1,3 |
| Tsingtao Brewery Co Ltd | 827 828 | 4,2 | 4,2 |
| TSO3 Inc | 8 660 000 | 24,5 | 24,5 |
| Tsogo Sun Holdings Ltd | 993 840 | 2,7 | 2,7 |
| Tsuruha Holdings Inc | 10 700 | 1,4 | 1,4 |
| Tube Investments of India Ltd | 500 195 | 5,8 | 5,8 |
| TUI AG | 291 856 | 5,6 | 5,6 |
| Tupras Turkiye Petrol Rafinerileri AS | 337 597 | 9,1 | 9,1 |
| Turk Hava Yollari AO | 1 405 925 | 2,7 | 2,7 |

au 31 décembre 2016

(juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|---------------------------------------|-------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| Turk Telekomunikasyon AS | | 1 361 022 | 2,7 | | | | 2,7 |
| Turkcell Iletisim Hizmetleri AS | | 2 307 405 | 8,6 | | | | 8,6 |
| Turkiye Garanti Bankasi AS | | 9 700 463 | 28,2 | | | | 28,2 |
| Turkiye Halk Bankasi AS | | 5 680 391 | 20,2 | | | | 20,2 |
| Turkiye Is Bankasi | | 4 009 374 | 7,9 | | | | 7,9 |
| Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS | | 1 285 827 | 1,9 | | | | 1,9 |
| Turkiye Vakiflar Bankasi TAO | | 2 076 346 | 3,4 | | | | 3,4 |
| Twenty-First Century Fox Inc | classe A | 147 775 | 5,6 | | | 5,6 | |
| | classe B | 958 249 | 35,0 | | | 35,0 | 40,6 |
| Twin Butte Energy Ltd | | | | | 6,2 | | 6,2 |
| Twitter Inc | | 116 100 | 2,5 | | | | 2,5 |
| Tyson Foods Inc | | 8 500 | 0,7 | | | | 0,7 |
| UBS Group AG | | 829 999 | 17,5 | | | | 17,5 |
| UCB SA | | 65 404 | 5,6 | | | | 5,6 |
| UDR Inc | | 168 600 | 8,2 | | | | 8,2 |
| UGI Corp | | 273 405 | 16,9 | | | | 16,9 |
| Ulker Biskuvi Sanayi AS | | 275 656 | 1,7 | | | | 1,7 |
| Ultra Salon Cosmetics & Fragrance Inc | | 4 100 | 1,4 | | | | 1,4 |
| Ultrapar Participacoes SA | | 1 474 162 | 41,6 | | | | 41,6 |
| UltraTech Cement Ltd | | 134 209 | 8,6 | | | | 8,6 |
| Umicore SA | | 44 271 | 3,4 | | | | 3,4 |
| UMW Holdings Bhd | | 1 536 348 | 2,1 | | | | 2,1 |
| Under Armour Inc | | 14 900 | 0,5 | | | 0,5 | |
| | classe A | 14 732 | 0,6 | | | 0,6 | 1,1 |
| Unibail-Rodamco SE | | 35 794 | 11,5 | | | | 11,5 |
| Unicharm Corp | | 87 400 | 2,6 | | | | 2,6 |
| UniCredit SpA | | 4 278 210 | 16,5 | | | | 16,5 |
| Unifin Financiera SAB de CV SOFOM ENR | | 1 301 160 | 4,4 | | | | 4,4 |
| Unilever Indonesia Tbk PT | | 5 015 319 | 19,4 | | | | 19,4 |
| Unilever NV | | 1 695 426 | 93,8 | | | | 93,8 |
| Unilever PLC | | 12 466 500 | 680,2 | | | | 680,2 |
| Union Andina de Cementos SAA | | 4 060 309 | 4,2 | | | | 4,2 |
| Union Pacific Corp | | 920 424 | 128,0 | | | | 128,0 |
| UnipolSai SpA | | 1 686 857 | 4,8 | | | | 4,8 |

| | | | | |
|---|------------|-----------|------|-------|
| Uni-President Enterprises Corp | 17 079 890 | 38,0 | | 38,0 |
| United Breweries Ltd | 103 766 | 1,6 | | 1,6 |
| United Continental Holdings Inc | 146 500 | 14,3 | | 14,3 |
| United Internet AG | 51 111 | 2,7 | | 2,7 |
| United Microelectronics Corp | 37 489 829 | 17,8 | | 17,8 |
| United Overseas Bank Ltd | 1 360 750 | 25,8 | | 25,8 |
| United Parcel Service Inc | 63 039 | 9,7 | | 9,7 |
| United Rentals Inc | 39 700 | 5,6 | | 5,6 |
| United Spirits Ltd | 99 929 | 3,8 | | 3,8 |
| United Technologies Corp | 1 836 711 | 270,0 | | 270,0 |
| United Therapeutics Corp | 13 525 | 2,6 | | 2,6 |
| United Tractors Tbk PT | 6 069 053 | 12,8 | | 12,8 |
| United Urban Investment Corp | 371 | 0,8 | | 0,8 |
| United Utilities Group PLC | 972 730 | 14,5 | | 14,5 |
| UnitedHealth Group Inc | 3 169 616 | 680,3 | | 680,3 |
| Universal Health Services Inc | 97 346 | 13,9 | | 13,9 |
| Universal Robina Corp | 2 595 774 | 11,4 | | 11,4 |
| Unum Group | 9 261 | 0,5 | | 0,5 |
| UOL Group Ltd | 251 711 | 1,4 | | 1,4 |
| UPL Ltd | 1 842 117 | 23,5 | | 23,5 |
| UPM-Kymmene Oyj | 243 881 | 8,1 | | 8,1 |
| Urbanimmersive Inc | 2 150 000 | 0,7 | | 0,7 |
| US Bancorp | 331 362 | 22,8 | | 22,8 |
| US Silica Holdings Inc | 148 454 | 11,3 | | 11,3 |
| USS Co Ltd | 50 470 | 1,1 | | 1,1 |
| UTour Group Co Ltd | 588 616 | 1,8 | | 1,8 |
| Vale SA | 2 229 621 | 23,6 | - | 23,6 |
| | classe A | 6 781 376 | 65,2 | 65,2 |
| Valeo SA | 81 856 | 6,3 | | 6,3 |
| Valero Energy Corp | 279 500 | 25,6 | | 25,6 |
| Valspar Corp, The | 9 800 | 1,4 | | 1,4 |
| Value Partners Group Ltd | 2 030 000 | 2,2 | | 2,2 |
| Vanguard International Semiconductor Corp | 962 692 | 2,3 | | 2,3 |
| Vanstar Mines Ressources Inc | 2 231 000 | 0,1 | | 0,1 |
| Vantiv Inc | 27 900 | 2,2 | | 2,2 |
| Varian Medical Systems Inc | 51 194 | 6,2 | | 6,2 |
| Vedanta Limited | 2 273 704 | 9,7 | | 9,7 |
| Ventas Inc | 48 414 | 4,1 | | 4,1 |
| Veolia Environnement SA | 914 343 | 20,9 | | 20,9 |

au 31 décembre 2016

(juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|------------------------------------|--------------|----------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| VEREIT Inc | | 146 500 | 1,7 | | | | 1,7 |
| Veresen Inc | | 312 066 | 4,1 | | | | 4,1 |
| VeriSign Inc | | 12 153 | 1,2 | | | | 1,2 |
| Verisk Analytics Inc | | 16 903 | 1,8 | | | | 1,8 |
| Verizon Communications Inc | | 2 580 602 | 184,7 | | | | 184,7 |
| Vertex Pharmaceuticals Inc | | 7 305 | 0,7 | | | | 0,7 |
| Vestas Wind Systems AS | | 38 239 | 3,3 | | | | 3,3 |
| Vêtements de Sport Gildan Inc, Les | | 22 900 000 | 780,7 | | | | 780,7 |
| VF Corp | | 135 674 | 9,7 | | | | 9,7 |
| Viacom Inc | | 167 800 | 7,9 | | | | 7,9 |
| Vicinity Centres | | 3 576 524 | 10,4 | | | | 10,4 |
| Vidéotron Ltée | | | | | 146,9 | | 146,9 |
| Vietnam Dairy Products JSC | | 959 012 | 7,1 | | | | 7,1 |
| Vinci SA | | 396 211 | 36,3 | | | | 36,3 |
| Vinda International Holdings Ltd | | 2 104 000 | 5,3 | | | | 5,3 |
| Vipshop Holdings Ltd | | 926 315 | 13,7 | | | | 13,7 |
| Visa Inc | | 28 692 | 3,0 | | | | 3,0 |
| Vista Outdoor Inc | | 27 483 | 1,4 | | | | 1,4 |
| Vivendi SA | | 927 542 | 23,7 | | | | 23,7 |
| VMware Inc | | 79 600 | 8,4 | | | | 8,4 |
| Vocus Communications Ltd | | 12 988 | - | | | | - |
| Vodacom Group Ltd | | 1 124 353 | 16,8 | | | | 16,8 |
| Vodafone Group PLC | | 29 859 465 | 98,9 | | | | 98,9 |
| Voestalpine AG | | 124 093 | 6,5 | | | | 6,5 |
| Volkswagen AG | | 89 957 | 17,4 | | | 17,4 | |
| | privilégiées | 514 307 | 97,0 | | | 97,0 | 114,4 |
| Volvo AB | | 1 336 655 | 21,0 | | | | 21,0 |
| Vonovia SE | | 63 835 | 2,8 | | | | 2,8 |
| Vornado Realty Trust | | 72 648 | 10,2 | | | | 10,2 |
| Voya Financial Inc | | 73 500 | 3,9 | | | | 3,9 |
| VTB Bank PJSC | | 13 389 568 341 | 21,5 | | | | 21,5 |
| Vulcan Materials Co | | 11 913 | 2,0 | | | | 2,0 |
| WABCO Holdings Inc | | 12 100 | 1,7 | | | | 1,7 |
| Wabtec Corp | | 14 000 | 1,6 | | | | 1,6 |

| | | | | |
|------------------------------------|--------------|-------|-------|-------|
| Waddell & Reed Financial Inc | 269 248 | 7,0 | | 7,0 |
| Walgreens Boots Alliance Inc | 7 374 897 | 818,5 | | 818,5 |
| Wal-Mart de Mexico SAB de CV | 16 295 755 | 39,3 | | 39,3 |
| Wal-Mart Stores Inc | 1 178 162 | 109,2 | | 109,2 |
| Walt Disney Co, The | 213 463 | 29,8 | | 29,8 |
| Wangsu Science & Technology Co Ltd | 1 744 516 | 18,0 | | 18,0 |
| Wanhua Chemical Group Co Ltd | 14 023 496 | 58,3 | | 58,3 |
| Want Want China Holdings Ltd | 16 099 036 | 13,8 | | 13,8 |
| Wartsila Oyj Abp | 68 727 | 4,1 | | 4,1 |
| Waskita Karya Persero Tbk PT | 15 615 400 | 4,0 | | 4,0 |
| Waste Connections Inc | 14 300 | 1,5 | | 1,5 |
| Waste Management Inc | 1 117 087 | 106,2 | | 106,2 |
| Waterfall Victoria Fund, Ltd | 12 | 0,1 | | 0,1 |
| Waters Corp | 15 575 | 2,8 | | 2,8 |
| Weatherford International Ltd | 581 500 | 3,9 | | 3,9 |
| Web.com Group Inc | 311 200 | 8,8 | | 8,8 |
| Webjet Ltd | 250 000 | 2,6 | | 2,6 |
| Webster Financial Corp | 139 600 | 10,2 | | 10,2 |
| WEC Energy Group Inc | 1 978 167 | 155,6 | | 155,6 |
| WEG SA | 747 967 | 4,8 | | 4,8 |
| Weibo Corp | 73 395 | 4,0 | | 4,0 |
| Weichai Power Co Ltd | 2 236 732 | 4,6 | | 4,6 |
| Weir Group Plc, The | 96 828 | 3,0 | | 3,0 |
| Wells Fargo & Company | 2 971 134 | 219,6 | 265,6 | 485,2 |
| | privilégiées | 7 | - | - |
| Welltower Inc | 276 987 | 24,9 | | 24,9 |
| Wendel SA | 17 981 | 2,9 | | 2,9 |
| Wereldhave NV | 95 400 | 5,8 | | 5,8 |
| WESCO International Inc | 87 700 | 7,8 | | 7,8 |
| Wesfarmers Ltd | 1 572 | 0,1 | | 0,1 |
| West Fraser Timber Co Ltd | 716 000 | 34,4 | | 34,4 |
| West Japan Railway Co | 153 600 | 12,7 | | 12,7 |
| Westar Energy Inc | 184 020 | 13,9 | | 13,9 |
| Western Digital Corp | 226 588 | 20,6 | | 20,6 |
| Western Union Co, The | 302 200 | 8,8 | | 8,8 |
| Westfield Corp | 6 866 383 | 62,5 | | 62,5 |
| Westpac Banking Corp | 675 186 | 21,4 | | 21,4 |
| Westports Holdings Bhd | 4 357 083 | 5,6 | | 5,6 |
| WestRock Co | 97 902 | 6,7 | | 6,7 |

au 31 décembre 2016

(juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|--|-------------|-----------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| WEX Inc | | | | | 47,5 | | 47,5 |
| Weyerhaeuser Co | | 598 943 | 24,2 | | | | 24,2 |
| WH Group Ltd | | 6 994 450 | 7,6 | | | | 7,6 |
| Wharf Holdings Ltd, The | | 1 203 373 | 10,7 | | | | 10,7 |
| Wheelock & Co Ltd | | 938 000 | 7,1 | | | | 7,1 |
| Whirlpool Corp | | 28 200 | 6,9 | | | | 6,9 |
| Whitbread PLC | | 43 882 | 2,7 | | | | 2,7 |
| WhiteWave Foods Co, The | | 28 400 | 2,1 | | | | 2,1 |
| Whole Foods Market Inc | | 15 700 | 0,6 | | | | 0,6 |
| William Demant Holding AS | | 60 141 | 1,4 | | | | 1,4 |
| William Hill PLC | | 365 537 | 1,8 | | | | 1,8 |
| Williams Cos Inc, The | | 996 896 | 41,6 | | | | 41,6 |
| Williams-Sonoma Inc | | 85 500 | 5,5 | | | | 5,5 |
| Willis Towers Watson PLC | | 101 069 | 16,6 | | | | 16,6 |
| Wilmar International Ltd | | 5 914 900 | 19,7 | | | | 19,7 |
| Winning Health Technology Group Co Ltd | | 1 228 367 | 4,6 | | | | 4,6 |
| Wipro Ltd | | 3 128 454 | 29,6 | | | | 29,6 |
| Wirtualna Polska Holding SA | | 198 459 | 3,4 | | | | 3,4 |
| Wistron Corp | | 1 230 855 | 1,3 | | | | 1,3 |
| Wm Morrison Supermarkets PLC | | 3 533 128 | 13,5 | | | | 13,5 |
| Wolong Electric Group Co Ltd | | 3 714 916 | 6,5 | | | | 6,5 |
| Wolseley PLC | | 100 487 | 8,3 | | | | 8,3 |
| Wolters Kluwer NV | | 72 747 | 3,5 | | | | 3,5 |
| Woodside Petroleum Ltd | | 133 546 | 4,0 | | | | 4,0 |
| Woolworths Holdings Ltd | | 2 900 141 | 20,2 | | | | 20,2 |
| Woolworths Ltd | | 865 | - | | | | - |
| Woori Bank | | 1 104 208 | 15,6 | | | | 15,6 |
| Workday Inc | | 6 500 | 0,6 | | | | 0,6 |
| Worldpay Group PLC | | 238 233 | 1,1 | | | | 1,1 |
| WorleyParsons Ltd | | 382 800 | 3,6 | | | | 3,6 |
| WPG Holdings Ltd | | 4 898 180 | 7,7 | | | | 7,7 |
| WPP PLC | | 523 060 | 15,7 | | | | 15,7 |
| WR Berkley Corp | | 62 100 | 5,5 | | | | 5,5 |

| | | | |
|---------------------------------------|------------|-------|-------|
| WR Grace & Co | 10 600 | 1,0 | 1,0 |
| WW Grainger Inc | 26 546 | 8,3 | 8,3 |
| Wyndham Worldwide Corp | 28 691 | 2,9 | 2,9 |
| Wynn Macau Ltd | 1 189 600 | 2,5 | 2,5 |
| Wynn Resorts Ltd | 28 200 | 3,3 | 3,3 |
| Xcel Energy Inc | 663 551 | 36,2 | 36,2 |
| Xerox Corp | 1 674 972 | 19,6 | 19,6 |
| Xilinx Inc | 142 009 | 11,5 | 11,5 |
| XL Axiata Tbk PT | 12 297 384 | 2,8 | 2,8 |
| XL Group Ltd | 61 446 | 3,1 | 3,1 |
| Xylem Inc | 335 017 | 22,2 | 22,2 |
| Yahoo Japan Corp | 854 679 | 4,4 | 4,4 |
| Yahoo! Inc | 2 770 700 | 143,7 | 143,7 |
| Yakult Honsha Co Ltd | 2 017 | 0,1 | 0,1 |
| Yamada Denki Co Ltd | 4 120 | - | - |
| Yamaguchi Financial Group Inc | 2 000 | - | - |
| Yamaha Corp | 43 847 | 1,8 | 1,8 |
| Yamaha Motor Co Ltd | 480 | - | - |
| Yamato Holdings Co Ltd | 174 509 | 4,8 | 4,8 |
| Yamazaki Baking Co Ltd | 1 950 | - | - |
| Yandex NV | 266 390 | 7,2 | 7,2 |
| Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd | 3 633 700 | 2,7 | 2,7 |
| Yanzhou Coal Mining Co Ltd | 4 282 810 | 3,9 | 3,9 |
| Yapi ve Kredi Bankasi AS | 10 889 379 | 14,2 | 14,2 |
| Yara International ASA | 319 511 | 16,9 | 16,9 |
| Yaskawa Electric Corp | 114 983 | 2,4 | 2,4 |
| Yes Bank Ltd | 476 349 | 10,9 | 10,9 |
| YIT OYJ | 201 700 | 2,2 | 2,2 |
| Yokogawa Electric Corp | 143 091 | 2,8 | 2,8 |
| Yokohama Rubber Co Limited , The | 1 100 | - | - |
| Yonghui Superstores Co Ltd | 16 979 778 | 16,1 | 16,1 |
| YTL Corp Bhd | 18 388 737 | 8,5 | 8,5 |
| YTL Power International Bhd | 8 627 403 | 3,8 | 3,8 |
| Yuanta Financial Holding Co Ltd | 34 683 039 | 17,3 | 17,3 |
| Yue Yuen Industrial Holdings Ltd | 832 500 | 4,1 | 4,1 |
| Yuhan Corp | 47 461 | 10,5 | 10,5 |
| Yulon Motor Co Ltd | 1 145 076 | 1,3 | 1,3 |
| Yum China Holdings Inc | 933 457 | 32,7 | 32,7 |
| Yum! Brands Inc | 1 859 944 | 158,0 | 158,0 |

au 31 décembre 2016

(juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Désignation | Actions | | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Somme partielle | Total |
|---------------------------------------|-------------|------------|---------|----------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|
| | | Nombre | Montant | | | | |
| YY Inc | | 41 119 | 2,2 | | | | 2,2 |
| Zalando SE | | 22 032 | 1,1 | | | | 1,1 |
| Zardoya Otis SA | | 147 825 | 1,7 | | | | 1,7 |
| Zee Entertainment Enterprises Ltd | | 880 500 | 7,9 | | | | 7,9 |
| Zhejiang Expressway Co Ltd | | 4 693 409 | 6,0 | | | | 6,0 |
| Zhejiang Huace Film & TV Co Ltd | | 2 116 126 | 4,6 | | | | 4,6 |
| Zhejiang Huahai Pharmaceutical Co Ltd | | 1 544 606 | 6,6 | | | | 6,6 |
| Zhejiang Yankon Group Co Ltd | | 17 584 531 | 24,5 | | | | 24,5 |
| Zhen Ding Technology Holding Ltd | | 632 835 | 1,7 | | | | 1,7 |
| Zhengzhou Yutong Bus Co Ltd | | 9 115 773 | 34,5 | | | | 34,5 |
| Zhongjin Gold Corp Ltd | | 3 320 122 | 7,7 | | | | 7,7 |
| Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd | | 1 284 908 | 8,7 | | | | 8,7 |
| Zijin Mining Group Co Ltd | | 13 206 732 | 5,7 | | | | 5,7 |
| Zillow Group Inc | | 32 700 | 1,6 | | | | 1,6 |
| Zimmer Biomet Holdings Inc | | 30 212 | 4,2 | | | | 4,2 |
| Zodiac Aerospace | | 97 921 | 3,0 | | | | 3,0 |
| Zoetis Inc | | 60 037 | 4,3 | | | | 4,3 |
| ZTE Corp | | 1 738 514 | 4,1 | | | | 4,1 |
| Zurich Insurance Group AG | | 83 325 | 30,8 | | | | 30,8 |

Notes importantes pour la compréhension du tableau :

Ce tableau comprend les principaux investissements en actions, en obligations et en créances d'entreprises de sociétés cotées de la Caisse ainsi que ceux des investissements sous-jacents de ses filiales non-consolidées. Le contenu de ce tableau est assujéti aux normes de déclaration applicables à la liste annuelle de tels investissements. En plus de ces placements et selon les politiques d'investissement des portefeuilles spécialisés, les gestionnaires ont recours à des instruments financiers dérivés qui procurent un rendement économique sur des titres d'actions, sans pour autant que ces titres soient la propriété de la Caisse.

La liste annuelle ne doit comporter aucune information susceptible de nuire aux opérations de la Caisse, à ses intérêts économiques ou à sa compétitivité, de révéler un projet de transaction, une transaction ou une série de transactions en cours, ou de causer un préjudice à une entreprise. En conséquence, il peut occasionnellement exister des variations entre les investissements présentés dans la liste annuelle et ceux qui sont inscrits aux registres de la Caisse au 31 décembre.

10 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS FERMÉES
au 31 décembre 2016
(juste valeur - en millions de dollars)

Valeur des investissements:
A = de 0 à 5 M\$ C = de 10 à 30 M\$ E = de 50 à 75 M\$ G = de 100 à 150 M\$ I = de 300 à 500 M\$
B = de 5 à 10 M\$ D = de 30 à 50 M\$ F = de 75 à 100 M\$ H = de 150 à 300 M\$ J = 500 M\$ et plus

Notes importantes à la compréhension du tableau :

Ce tableau comprend les principaux investissements en actions, en obligations et en créances d'entreprises de sociétés fermées de la Caisse ainsi que ceux des investissements sous-jacents de ses filiales non-consolidées. Le contenu de ce tableau est assujéti aux normes de déclaration applicables à la liste annuelle de tels investissements.

La liste annuelle ne doit comporter aucune information susceptible de nuire aux opérations de la Caisse, à ses intérêts économiques ou à sa compétitivité, de révéler un projet de transaction, une transaction ou une série de transactions en cours, ou de causer un préjudice à une entreprise. En conséquence, il peut occasionnellement exister des variations entre les investissements présentés dans la liste annuelle et ceux qui sont inscrits aux registres de la Caisse au 31 décembre.

Conformément aux ententes intervenues, n'est pas incluse dans la liste la valeur spécifique des investissements effectués dans toute société fermée (selon la définition de la Loi sur les valeurs mobilières du Québec) si elle n'a pas donné son accord à la divulgation.

| SOCIÉTÉS | Parts | Actions | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Valeur des investissements |
|--|--------------|----------------|-----------------------------|--|-----------------------------------|
| Immobilier ¹ | | | | | |
| Ancar Administradora de Shopping Centers Ltda | | X | | | F |
| Apollo U.S. Real Estate Fund II L.P. | X | | | | C |
| Au Sommet Place Ville Marie, S.E.C. | X | | | | A |
| Beacon Capital Strategic Partners VII, LP | X | | | | D |
| Blackstone Property Partners F.2 LP | X | | | | H |
| Blackstone Property Partners Kips Co-Investment L.P. | X | | | | G |
| Blackstone Property Partners LBA Co-Investment II AIV L.P. | X | | | | E |
| Blackstone Real Estate Partners Asia, L.P. | X | | | | G |
| Blackstone Real Estate Partners Europe IV L.P. | X | | | | H |
| Blackstone Real Estate Partners VI, L.P. | X | | | | H |
| Blackstone Real Estate Partners VII, L.P. | X | | | | J |
| Blackstone Real Estate Partners VIII L.P. | X | | | | H |
| Cerberus CDP IC Partners LP | X | | | | J |
| Chongbang Holdings (International) LTD | | X | | | J |
| CIM Fund III, L.P. | X | | | | H |
| CIM Fund VIII, LP | X | | | | H |
| Claridge IC Immobilier, Société en commandite | X | | | | C |
| Colyzeo Investors, L.P. | X | | | | A |
| Colyzeo Investors II, L.P. | X | | | | C |
| Greystar Equity Partners IX, L.P. | X | | | | G |
| Greystar Equity VIII | X | | | | D |

| | | | |
|--|---|---|---|
| HBC Albert JV III LLC | X | | H |
| HBS Global Properties LLC | X | | H |
| IC1-Westgate Co-Investors, LLC | X | | C |
| ICAMAP Investimento S.à.r.l. | X | | E |
| ICAMAP Investors, SLP-SIF | X | | E |
| India Property Fund L.P. | X | | D |
| Kimex Retail Land and Development Fund I, LP | X | | A |
| KingSett High Yield Fund | X | | F |
| KingSett Real Estate Growth LP No.3 | X | | B |
| KingSett Real Estate Growth LP No.4 | X | | A |
| KingSett Real Estate Growth LP No.5 | X | | F |
| KingSett Real Estate Growth LP No.6 | X | | C |
| KingSett Urban Infill Property Fund | X | | D |
| Logos China Investments Limited | | X | D |
| Logos New Holding Trust | X | | D |
| Logos New Investment Trust | X | | A |
| Logos SE Asia Venture 1 L.P. | X | | E |
| Lone Star Fund III (Bermuda) LP | X | | A |
| Lone Star Fund IV (Bermuda) LP | X | | B |
| Lone Star Fund V (Bermuda) LP | X | | H |
| Lone Star Fund VI (Bermuda) LP | X | | H |
| Lone Star Fund VIII LP | X | | H |
| Lone Star Fund IX (Bermuda) LP | X | | F |
| Lone Star Real Estate Fund LP | X | | F |
| LS Real Estate Fund III | X | | G |
| Manhattan Valley Fund LP | X | | A |
| MCAP Commercial LP | X | | I |
| Mira Group LP | X | | E |
| New York Metro Fund, LP | X | | A |
| NYC Residential Fund GP, LLC | X | | A |
| PenRetail III Limited Partnership | X | | A |
| Praedium Fund V, L.P., The | X | | A |
| Praedium Fund VI, L.P., The | X | | A |
| Praedium Fund VII, L.P., The | X | | A |
| Praedium VIII Multifamily Value Fund, L.P. | X | | C |
| Rockpoint Growth and Income Real Estate Fund I, L.P. | X | | F |
| Rockpoint Real Estate Fund IV, LP | X | | H |
| Rockpoint Real Estate Fund V, LP | X | | E |
| TPG CDP DASA (RE) Utrecht AIV I, LP | X | | E |
| TPG Real Estate Finance Trust | X | | H |
| TPG Real Estate Fund II | X | | C |

10 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS FERMÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Parts | Actions | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Valeur des investissements |
|--|-------|---------|----------------------|---------------------------------------|----------------------------|
| TPG Real Estate Partners II (E1), L.P. | X | | | | H |
| VersaCold Logistics Services LP | X | | | | E |
| VR China LP | X | | | | D |
| Warburg Pincus Real Estate I, LP | X | | | | D |
| Williams Opportunity Partner Fund, LLC | X | | | | A |
| WPRE Red Star L.P. | X | | | | F |
| Placements privés et Infrastructures ² | | | | | |
| 3AB Optique Développement SAS | | X | | | H |
| 4411871 Canada Inc | | X | | | A |
| 7761210 Canada Inc | | X | | | C |
| 7764863 Canada Inc | | X | | | C |
| 7790724 Canada Inc | | X | | | A |
| 9049-7496 Québec Inc | | X | | | D |
| 9256-9771 Québec Inc | | X | X | | B |
| 9327-2615 Québec Inc | | X | | X | D |
| 9672869 Canada Inc | | X | | | A |
| ACON Sequitur Investors Holdings LLC | X | | | X | F |
| ACON Sequitur Investors Holdings II LLC | X | | | X | D |
| Acquisition Glacier II Inc | | X | | | F |
| AddÉnergie Technologies Inc | | X | | | A |
| AES US Investments Inc | | X | | | I |
| Affinity Asia Pacific Fund IV LP | X | | | | F |
| Airbnb Inc | | X | | | H |
| Airport Holding Kft | X | | | | G |
| Airport Hungary Tanácsadó Korlátolt Felelősségű Társaság Kft | | | | X | H |
| Altas Partners Holdings (A) LP | X | | | | A |
| Anges Québec Capital SEC | X | | | | A |
| Apollo Credit Opportunity Fund (Offshore) III LP | X | | | | F |
| Apollo Hercules Partners LP | X | | | | G |
| Aquiline Financial Services Fund (Offshore) LP | X | | | | C |
| ARC Energy Venture Fund 3 Canadian LP | X | | | | A |
| ARC Energy Venture Fund 4 Canadian LP | X | | | | A |
| ArcLight Energy Partners Fund III LP | X | | | | A |
| ArcLight Energy Partners Fund IV LP | X | | | | C |

| | | | | |
|--|---|---|---|---|
| ArcLight Energy Partners Fund V LP | X | | | E |
| Ardian LBO Fund VI A | X | | | D |
| Ardian LBO Fund VI CDPQ Co-Invest | X | | | C |
| Ares Corporate Opportunities Fund II LP | X | | | C |
| Ares Corporate Opportunities Fund III LP | X | | | E |
| Ares Corporate Opportunities Fund IV LP | X | | | G |
| Ares SSF Riopelle LP | X | | | D |
| Argos Holdings LP | X | | | J |
| Armoires Fabritec Ltée | | | X | A |
| ASF Galaxy Co-Invest LP | X | | | E |
| ASF Prince Co-Invest S. LP | X | | | E |
| ASF V Messenger Acquisition LP | X | | | D |
| ASF V-B Park Co-Investment LP | X | | | G |
| ASF VI CDPQ Co-Invest LP | X | | | E |
| ASF VI LP | X | | | I |
| ASF VII B CDPQ Co-Invest LP | X | | | A |
| ASF VII B LP | X | | | D |
| Athyrium Opportunities Fund II (Non-US) LP | X | | | F |
| Auriga Ventures I | X | | | A |
| Auriga Ventures II | X | | | A |
| Australis Partners Fund LP | X | | | A |
| Avenue Asia Special Situations Fund IV LP | X | | | A |
| Avenue-CDP Global Opportunities Fund LP | X | | | D |
| Avenue Special Situations Fund V LP | X | | | A |
| Averna Technologies Inc ³ | | X | X | B |
| AWC Investments Inc | | X | | B |
| AXA Capital Asia LP | X | | | F |
| AXA Capital Asia II LP | X | | | H |
| AXA CDP Co-Investment Fund FCPR | X | | | E |
| AXA Early Secondary Fund III-I LP | X | | | C |
| AXA Expansion Fund II FCPR | X | | | B |
| AXA LBO Fund III A | X | | | A |
| AXA LBO Fund IV FCPR | X | | | D |
| AXA LBO Fund IV Supplementary FCPR | X | | | D |
| AXA LBO Fund V CORE FCPR | X | | | H |
| AXA LBO Fund V Supplementary | X | | | D |
| AXA Mezzanine 1 S.A., SICAR | X | | | A |
| AXA Primary Fund America III LP | X | | | C |
| AXA Primary Fund America IV LP | X | | | F |
| AXA Primary Fund Europe III LP | X | | | D |
| AXA Primary Fund Europe IV LP | X | | | D |

10 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS FERMÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Parts | Actions | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Valeur des investissements |
|---|-------|---------|----------------------|---------------------------------------|----------------------------|
| AXA Secondary Fund LP | X | | | | A |
| AXA Secondary Fund II LP | X | | | | A |
| AXA Secondary Fund III-1 LP | X | | | | A |
| AXA Secondary Fund IV LP | X | | | | F |
| AXA Secondary Fund V LP | X | | | | H |
| Azimuth Energy Partners II LP | X | | | | D |
| Azimuth Energy Partners III LP | X | | | | F |
| Azimuth Energy Partners IV LP | X | | | | D |
| Bariatric Nutrition Inc | | X | | | B |
| Baring Vostok Fund IV Supplemental Fund LP | X | | | | C |
| Baring Vostok Private Equity Fund III LP 1 | X | | | | D |
| Baring Vostok Private Equity Fund IV LP | X | | | | F |
| Baring Vostok Private Equity Fund V LP | X | | | | D |
| Baring Vostok Private Equity LP 1 | X | | | | A |
| BC European Capital VII | X | | | | A |
| BC European Capital VIII | X | | | | D |
| BC European Capital IX | X | | | | G |
| BCP V Co-Investors LP | X | | | | A |
| Beaudier Ciment Inc (Ciment McInnis Inc) | | X | X | | H |
| BioMarin Delivery Canada Inc | | X | | | A |
| Blackstone Capital Partners VII LP | X | | | | A |
| Blackstone Firestone Principal Transaction Partners (Cayman) LP | X | | | | A |
| Blackstone First Eagle Co-Invest LP | X | | | | H |
| Blackstone Health Commitment Partners LP | X | | | | A |
| Bombardier Transportation (Investment) UK Limited | | | X | | J |
| Brightspark Ventures II LP | X | | | | C |
| Bronco Midstream Partners LP | X | | | | D |
| Brookfield Capital Partners II LP | X | | | | E |
| Brookfield Capital Partners Fund III LP | X | | | | H |
| Brookfield Capital Partners IV (CR) LP | X | | | | G |
| CAD Industries Ferroviaires Ltée | | | | X | A |
| Caisse Quadrant Trust | X | | | | G |
| CAMSO Inc | | X | X | | H |
| Capital Croissance PME SEC | X | | | | D |
| Capital Croissance PME II SEC | X | | | | F |

| | | | | |
|--|---|---|---|---|
| Capital St-Laurent SEC | X | | | A |
| Care Capital Investments III LP | X | | | D |
| Carlyle/Riverstone Global Energy & Power Fund III LP | X | | | C |
| Catalina Holdings (Bermuda) Ltd | | X | | H |
| CD&R B&M Co-Investor, LP | X | | | E |
| CD&R EMSC Co-Investor LP | X | | | A |
| CD&R Univar Co-Investor II LP | X | | | G |
| CDP Investissements Associés SENC | X | | | C |
| CDP Investissements Associés II SENC | X | | | C |
| CDPQ Infra Inc | | X | X | G |
| CDPQ Plenary Group Holdings Trust | X | | | E |
| CDR USF Co-Investor NO 2 LP | X | | | H |
| Cequel Communications Holdings I, LLC (Suddenlink) | X | | | E |
| Cerberus CDP IC Partners LP | X | | | I |
| Cerberus Institutional Partners LP - Series Four | X | | | H |
| CG Investment Group LLC | X | | | A |
| Checkers Control Partnership LP | X | | | H |
| Citicorp Mezzanine III LP | X | | | B |
| Claridge CDPQ Gestion Inc | | X | | A |
| Claridge Israël SEC | X | | | B |
| Clarus Lifesciences I LP | X | | | C |
| Clarus Lifesciences II LP | X | | | C |
| Clayton Dubilier & Rice Fund VII (Co-Investment) LP | X | | | C |
| Clayton Dubilier & Rice Fund VII LP | X | | | C |
| Clayton Dubilier & Rice Fund VIII LP | X | | | F |
| Clayton Dubilier & Rice Fund IX LP | X | | | H |
| Clearspring Capital Partners III LP | X | | | C |
| Colonial Pipeline Company | | X | | J |
| Compagnie Financière Edmond de Rothschild Banque, La | | X | | D |
| Corex Resources Ltd | | X | | G |
| Corporation de Développement Knowlton Inc | | X | | E |
| Corporation de développement Nautilus Inc | | X | | A |
| Corsair III Financial Services Capital Partners LP | X | | | D |
| Court Square Capital Partners (Offshore) II LP | X | | | D |
| Court Square Capital Partners (Offshore) III LP | X | | | D |
| Crown Global Secondaries III PLC | X | | | E |
| CVI Global Value Fund LP | X | | | G |
| CVI Global Value Fund LP - Top Off | X | | | E |
| Cytheris SA | | X | | A |
| Dalcor Pharmaceutiques Canada Inc | | X | | C |
| Demers, Manufacturier d'ambulances Inc | | X | X | C |

10 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS FERMÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Parts | Actions | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Valeur des investissements |
|--|-------|---------|----------------------|---------------------------------------|----------------------------|
| Denver Partners LLC | X | | | | A |
| Dery Télécom Inc | | | | X | A |
| Dundee Sarea Acquisition I LP | X | | | | C |
| Dundee Sarea GP Inc | | X | | | A |
| Edelweiss Asset Reconstruction Company Limited | | | X | | E |
| Emerald Cleantech Fund II LP | X | | | | B |
| Emerald Energy Fund I LP | X | | | | A |
| EnerVest Energy Institutional Fund XIII-A LP | X | | | | A |
| EnerVest Energy Institutional Fund XIV-A LP | X | | | | G |
| Englobe Corp | | X | | X | D |
| ePak Holdings Limited | | X | X | | A |
| EQT Auris Co-Investment Limited Partnership | X | | | X | H |
| EQT Auris II | X | | | X | C |
| EQT Mid Market Fund | X | | | | G |
| EQT Mid Market US LP | X | | | | D |
| EQT VI (No.1) LP | X | | | | H |
| EQT VII (No.2) LP | X | | | | E |
| Essex Woodlands Health Ventures Fund VII LP | X | | | | C |
| Essex Woodlands Health Ventures Fund VIII LP | X | | | | C |
| Euro Wagon LP | X | | | | A |
| FGP Topco Limited (HAH) | | X | | | J |
| Finloc 2000 Inc | | | | X | A |
| Fix Auto Canada Inc | | X | | X | C |
| Fluxys SA | | X | | | J |
| Fonds AlterInvest SEC | X | | | | A |
| Fonds AlterInvest II SEC | X | | | | C |
| Fonds CDP (SEW), SEC | X | | | | I |
| Fonds CTI Sciences de la Vie SEC | X | | | | C |
| Fonds CTI Sciences de la Vie SEC II | X | | | | B |
| Fonds Cycle Capital I SEC | X | | | | A |
| Fonds d'investissement AlterInvest Inc | | X | | | A |
| Fonds d'investissement iNovia 2015 SEC | X | | | | A |
| Fonds d'investissement iNovia II SEC | X | | | | C |
| Fonds d'investissement iNovia III-Parallèle, SEC | X | | | | A |
| Fonds ID SEC | X | | | | B |

| | | | | | | | | | |
|---|---|--|--|--|---|---|---|---|---|
| Fonds InnovExport, SEC | X | | | | | | | | A |
| Fonds Manufacturier Québécois SEC | X | | | | | | | | D |
| Fonds Manufacturier Québécois II SEC | X | | | | | | | | C |
| Fonds Propulsion III SEC | X | | | | | | | | B |
| Fonds Tandem Expansion I SEC | X | | | | | | | | C |
| Fonds XPNDCroissance SEC | X | | | | | | | | B |
| Fortress Coinvestment Fund V LP | X | | | | | | | | C |
| Fortress Investment Fund V LP | X | | | | | | | | F |
| Genesis Partners II LDC | X | | | | | | | | A |
| Genesis Partners III LP | X | | | | | | | | C |
| Genstar Capital Partners V LP | X | | | | | | | | E |
| Genstar Capital Partners VI LP | X | | | | | | | | G |
| Genstar Capital Partners VII LP | X | | | | | | | | G |
| Georgian Partners Growth Fund III LP | X | | | | | | | | B |
| Gestion Anges Québec Capital Commandité Inc | | | | | X | | | | A |
| Gestion Cirque du Soleil SEC | X | | | | | | | | F |
| Gestion Grand Lys Inc | | | | | X | | | | A |
| Gestion Sijeri Inc | | | | | X | | | | A |
| Global Agriculture AIV (CN) LP | X | | | | | | | | H |
| Global Agriculture II AIV LP | X | | | | | | | | D |
| Global Timber Resources LLC | X | | | | | | | | E |
| GO Capital SEC | X | | | | | | | | A |
| Gravity Energy Corp | | | | | X | | | | A |
| Greenpac Holding LLC | X | | | | | X | | | F |
| Greenstone Ltd | | | | | X | | | X | I |
| Groupe Crevier Inc | | | | | | | | X | B |
| Groupe Graham International Inc | | | | | X | | | | A |
| Groupe Keolis SAS | | | | | X | | | | J |
| Groupe Marcelle Holdings Inc | | | | | X | | | X | C |
| Groupe Novatech Inc | | | | | X | | | X | C |
| Groupe Optimum Inc | | | | | X | | | | C |
| Groupe Stageline Inc | | | | | X | | | | C |
| Groupe Tornatech Inc | | | | | X | | | | C |
| Groupe V Média Inc | | | | | | | X | | B |
| GSO Churchill Partners AIV-1 LP | X | | | | | | | | C |
| GSO Churchill Partners LP | X | | | | | | | | I |
| GSO Churchill Partners II LP | X | | | | | | | | I |
| Harfang Exploration Inc | | | | | X | | | | A |
| HEF HoldCo II, Inc | | | | | X | | | X | H |
| HGSC 3 S.A. | | | | | | | | X | D |
| HMY International | | | | | X | X | | | A |

10 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS FERMÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Parts | Actions | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Valeur des investissements |
|--|-------|---------|----------------------|---------------------------------------|----------------------------|
| Hopper Inc | | X | | | D |
| HydroSolution Ltée | | X | | | A |
| HydroSolution SEC | X | | | | D |
| ILM Investments LP | X | | | | H |
| Image Networks Holdings Pty Ltd | | X | X | | H |
| Industries Spectra Premium Inc | | X | | | C |
| Innisfree PFI Continuation Fund | X | | | | F |
| Interconnector UK Ltd | | X | | | H |
| Intransit BC Limited Partnership | X | | | | F |
| Intransit British Columbia GP Ltd | | X | | | A |
| Invénergie Vert SEC | X | | | | F |
| Invénergie Vert II SEC | X | | | | E |
| Invenergy Canada Wind 4 Limited | | X | | | A |
| Invenergy Canada Wind Green Limited | | X | | | A |
| Invenergy Canada Wind Green II Limited | | X | | | A |
| Invenergy Des Moulins GP Limited | | X | | | A |
| Invenergy Raleigh Green Limited | | X | | | A |
| Invenergy US Wind Holdings LLC | | | | X | J |
| Invenergy Wind LLC | X | | | | J |
| Investissements Novacap Inc | | X | | | A |
| IPALCO Enterprises, Inc | | X | | | J |
| IPE Tank and Rail Investment 2 SCA | | X | | | A |
| IPL Inc | | X | | X | E |
| J L Albright III Venture Fund | X | | | | A |
| JitneyTrade Inc | | | | X | A |
| KERN Energy Partners I LP | X | | | | A |
| KKR-CDP Partners LP | X | | | | I |
| Laureate Co-Investors V Limited Partnership | X | | | | C |
| LB Firth Sidecar LLC | X | | | | B |
| Lightspeed POS Inc | | X | | | E |
| Lion Capital Fund I LP | X | | | | A |
| Lion Capital Fund II LP | X | | | | C |
| Lion Capital Fund III LP | X | | | | H |
| London Array Ltd, London Array Unincorporated JV | X | X | | | I |
| Lone Star Fund III (Bermuda) LP | X | | | | A |

| | | | | | |
|--|---|---|---|---|---|
| Lumira Capital Corp | | X | | | A |
| Macquarie European Infrastructure Fund LP | X | | | | C |
| MCC Hold Trust | X | | | | C |
| MECE Finance Hold Trust | X | | | | A |
| MECE Finance Holdings Pty Ltd | | X | | | A |
| MECE Hold Trust | X | | | | A |
| MECE Holdings Pty Ltd | | X | | | A |
| MED ParentCo LP | X | | | | I |
| Mines Coulon Inc | | X | | | B |
| MMV Financial Inc | | X | X | | A |
| Mondofix Inc | | X | | | A |
| Morgan Schaffer Inc | | X | | X | C |
| Nautilus Plus Inc | | | | X | A |
| New Asurion Corporation | | X | | | H |
| Newbridge Asia IV LP | X | | | | B |
| NewQuest Asia Fund III LP | X | | | | A |
| NewStar Credit Opportunities Fund Ltd | | X | | | B |
| Northleaf 1608 Secondary Holdings LP | X | | | | D |
| Novacap II Société en commandite | X | | | | B |
| Novacap Industries III SEC | X | | | | D |
| Novacap Industries IV SEC | X | | | | C |
| Novacap Technologies III SEC | X | | | | C |
| Novacap TMT IV SEC | X | | | | C |
| NSW Electricity Networks Assets Holdings Trust (TransGrid) | X | | | X | J |
| NSW Electricity Networks Operations Holdings Trust (TransGrid) | X | | | X | J |
| Nth Power Technologies Fund II-A LP | X | | | | A |
| OCM Asia Principal Opportunities Fund LP | X | | | | A |
| OCM Opportunities Fund VII (Cayman) Ltd | X | | | | D |
| OCM Opportunities Fund VIIb LP | X | | | | D |
| OCM Principal Opportunities Fund IV (Cayman) Ltd | X | | | | E |
| OHA - CDP ESCF, LP | X | | | | H |
| Oncap II LP | X | | | | C |
| Oncap III (Canada) LP | X | | | | D |
| Onex Partners LP | X | | | | C |
| Onex Partners II LP | X | | | | C |
| Onex Partners III LP | X | | | | G |
| Onex Partners IV LP | X | | | | H |
| Onex SIG Co-Invest LP | X | | | | G |
| Open Text Enterprise Apps Fund | X | | | | A |
| OrbiMed Private Investments III LP | X | | | | C |
| Osum Oil Sands Corp | | X | | | C |

10 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS FERMÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Parts | Actions | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Valeur des investissements |
|--|-------|---------|----------------------|---------------------------------------|----------------------------|
| OTYC Holdings Inc | | X | | | A |
| Ovivo Inc | | X | | | E |
| Palantir Technologies Inc | | | X | | H |
| Park Square Capital Partners LP | X | | | | G |
| Partenaires Médias Remstar SEC | X | | | | A |
| Partenaires Persistence Capital LP | X | | | | B |
| Partenaires Persistence Capital II, SEC | X | | | | C |
| Partners Group Client Access 16 LP Inc (Groupe Foncia) | X | | | | I |
| Patina Rail LLP (Eurostar International Limited) | X | | | | J |
| Patria - Brazilian Private Equity Fund V LP | X | | | | A |
| PCUT No 1 Pty Ltd | | | | X | D |
| Plastrec Inc | | X | | | B |
| Plenary Conventions Holdings Pty Ltd | | X | | | A |
| Plenary Health Holdings (CCC) Pty Ltd | | X | | | E |
| Plenary Health Holdings Unit Trust | X | | | | A |
| Plenary Holdings No 7 Pty Ltd | | X | | | B |
| Plenary Living (LEAP 1) Unit Trust | X | | | | A |
| Plenary Living (LEAP2) Holdings Pty Ltd | | X | | | E |
| Plenary Living (LEAP2) Pty Ltd | | | | X | E |
| Plenary Research Pty Ltd | | | | X | C |
| Plenary Research Unit Trust | X | | | | A |
| Pool Acquisition SA | | X | | | A |
| PPP Holdings No 1 Pty Ltd | | X | | X | C |
| PPP Holdings No 2 Pty Ltd | | X | | X | C |
| ProQuest Investments IV LP | X | | | | F |
| PulsePoint Inc | | X | | | A |
| QPH Hold Trust, Hold Co PTY Limited (Port de Brisbane) | X | X | | | J |
| Quantum Energy Partners IV LP | X | | | | D |
| Québecor Média Inc | | X | | | J |
| Relay Ventures Fund LP | X | | | | C |
| Relay Ventures Fund III LP | X | | | | A |
| Rho Canada Capital de Risque SEC | X | | | | B |
| Riopelle Century LLC | X | | | | A |
| Ripley Cable Holdings I LP | X | | | | C |
| Riverstone Global Energy & Power Fund V LP | X | | | | H |

| | | | | |
|--|---|---|---|---|
| Sagard FCPR | X | | | A |
| Sagard II A FCPR | X | | | D |
| Saints Capital V LP | X | | | A |
| Saints Capital VI LP | X | | | C |
| Sanderling Venture Partners IV LP | X | | | A |
| Sanderling Venture Partners V LP | X | | | B |
| Sanderling Venture Partners VI Co-Investment Fund LP | X | | | C |
| Sanderling Venture Partners VI LP | X | | | C |
| Sedgwick Inc | | X | | J |
| Sentient Global Resources Fund I LP | X | | | B |
| Sentient Global Resources Fund II LP | X | | | A |
| Sentient Global Resources Fund III LP | X | | | C |
| Sentient Global Resources Fund IV LP | X | | | C |
| Sentient Group Limited, The | | X | | A |
| SeqUr Exploration Inc | | X | | A |
| Services de santé Medisys SEC | | | X | C |
| Services Intégrés Lemay & Associés Inc | | | X | B |
| SGU Holdings GP Corporation | | X | | A |
| SGU Holdings LP | X | | | H |
| Silver Lake Partners II LP | X | | | A |
| Silver Lake Partners III LP | X | | | H |
| Silver Lake Partners IV LP | X | | | H |
| Skyfold Inc | | X | | C |
| SLP Denali Co-Invest LP | X | | | H |
| Société d'investissement ALT Canada SEC | X | | | C |
| Société en commandite Agechem | X | | | B |
| Société en Commandite Axiom Infrastructure Canada | X | | | E |
| Société en commandite Zarkiris | X | | | A |
| Somerset Group Inc | | X | | A |
| Southern Star Acquisition Corporation | | X | X | J |
| Sports Authority Holdings, Inc | | X | | A |
| Sports Authority Inc, The | | | X | A |
| SP 780 Private Equity Investments plc | X | | | B |
| SSQ, Société d'Assurance-Vie Inc | | | X | D |
| Structured Credit Holdings Public Limited Company | | X | X | A |
| Studio Félix & Paul Inc | | X | | A |
| Summertime Holding Corp | | X | | H |
| SW Energy Capital LP | X | | | D |
| SW Resources Partnership | X | | | A |
| Sweeteners Holdings Inc | | X | | A |
| TAD Canco Inc | | | X | H |

10 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS FERMÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Parts | Actions | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Valeur des investissements |
|---|-------|---------|----------------------|---------------------------------------|----------------------------|
| Télécon Inc | | X | X | | D |
| Tenaska Power Fund LP | X | | | | A |
| Teralys Capital Fonds de Fonds, SEC | X | | | | F |
| Teralys Capital Fonds d'Innovation SEC | X | | | | A |
| TeraXion Inc | | | | X | A |
| Thomas McNerney & Partners II LP | X | | | | C |
| TIAA-CREF Global Agriculture LLC | X | | | | H |
| TIAA-CREF Global Agriculture II LLC | X | | | | D |
| TMC Mezz Cap Investor LLC | X | | | | A |
| Tornatech Inc | | X | | | A |
| TPF II-A, LP | X | | | | C |
| TPG Asia V LP | X | | | | C |
| TPG Asia VI LP | X | | | | G |
| TPG LBV Co-Invest LLC | X | | | | C |
| TPG Magnate Holdings, LP | X | | | | E |
| TPG Partners V LP | X | | | | F |
| TPG Partners VI LP | X | | | | F |
| TPG Partners VII LP | X | | | | C |
| TPG VI Wolverine Co-Invest, LP | X | | | | H |
| TPG VII DE AIV II LP | X | | | | B |
| TPG VII Magni AIV LP | X | | | | C |
| Transport Social Netlift Inc | | X | | | A |
| Trencap SEC (Gaz Métro) | X | | | | J |
| Trident III LP | X | | | | A |
| Trident IV LP | X | | | | F |
| Trident V Parallel Fund LP | X | | | | G |
| Trident VI Parallel Fund LP | X | | | | H |
| Triotech Amusement inc | | X | | | D |
| Triton Electronique Inc | | X | | | A |
| Trust No. 2431 (ALTAN Redes S.A.P.I. de C.V.) | X | | | | A |
| Trust No. 2431 (ICA Operadora de Vias Terrestres, S.A.P.I. de C.V.) | X | | | | G |
| Tyrol Acquisition 1, s.à.r.l. | | X | | | A |
| Univita Health Holdings Corp. | | X | | | A |
| Univita Health Inc | | | | X | A |
| VantagePoint CDP Partners LP | X | | | | A |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| VantagePoint Communications Partners LP | X | | | A |
| VantagePoint Venture Partners 2006 (Q) LP | X | | | E |
| VantagePoint Venture Partners III (Q) LP | X | | | A |
| VantagePoint Venture Partners IV (Q) LP | X | | | A |
| Ventures West 8 LP | X | | | A |
| Viandes Seficlo Inc | | X | X | A |
| Vintage Investment Partners VI (Cayman), LP | X | | | D |
| Vintage Venture Partners III (Cayman) LP | X | | | C |
| Vista Equity Partners Fund V-A LP | X | | | G |
| Vista Equity Partners V Co-Invest 1-A LP | X | | | E |
| Warburg Pincus China LP | X | | | C |
| WCP III Québec Co-Invest, LP | X | | | B |
| Wengen Alberta Limited Partnership | X | | | D |
| Wynchurch Capital Partners II LP | X | | | C |
| Zone3 Inc | | X | X | B |

Revenu Fixe

| | | | | |
|--|--|--|---|---|
| 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc | | | X | I |
| ABW Solar General Partnership | | | X | C |
| Accruent LLC | | | X | D |
| ADG LLC | | | X | C |
| Advanced Instruments Inc | | | X | B |
| AEP Holdings Inc | | | X | C |
| Aéroport de Québec Inc | | | X | E |
| Agropur Coopérative | | | X | I |
| Alera Technologies Inc | | | X | C |
| Allied Universal Holdco LLC | | | X | G |
| Allison Transmission Inc | | | X | C |
| ALM XII Ltd | | | X | G |
| ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC | | | X | G |
| AMCP Clean Acquisition Co LLC | | | X | B |
| AM General LLC | | | X | C |
| Atrium Innovations Inc | | | X | D |
| Auris Luxembourg III Sarl | | | X | F |
| Boreas (Investment) Limited | | | X | I |
| Brookfield Finance Inc | | | X | C |
| Capital Group Emerging Markets Debt Fund | | | X | J |
| CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp | | | X | D |
| CCO Safari III LLC | | | X | F |
| CCOH Safari LLC | | | X | G |
| CDR Bounty Holdco 4 Limited | | | X | E |

10 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS FERMÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Parts | Actions | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Valeur des investissements |
|--|-------|---------|----------------------|---------------------------------------|----------------------------|
| Centric Group LLC | | | | X | C |
| Charter Communications Operating LLC | | | | X | G |
| Clearwater Analytics LLC | | | | X | C |
| Collectif Santé Montréal S.E.C. (CHUM) | | | | X | J |
| Crosslinx Transit Solutions GP | | | | X | D |
| Dery Télécom Inc. | | | | X | B |
| Dryden 41 Senior Loan Fund | | | | X | F |
| DTI Holdco Inc | | | | X | C |
| EFS Cogen Holdings I LLC | | | | X | G |
| Fairfax US Inc | | | | X | C |
| Finloc 2000 Inc | | | | X | A |
| First Eagle Investment Management LLC | | | | X | H |
| Galleria Co | | | | X | E |
| Gestion Premier Lion Inc | | | | X | A |
| Grand Bend Wind Limited Partnership | | | | X | D |
| Grand Renewable Solar LP | | | | X | E |
| Groupe de Sécurité Garda Inc, Le | | | | X | F |
| Groupe Moreau | | | | X | A |
| Groupe Optimum Inc | | | | X | B |
| HCA Inc | | | | X | I |
| Hewitt Equipment Ltée | | | | X | D |
| Hygiena Borrower LLC | | | | X | C |
| IHC Holding Corp | | | | X | C |
| Imagine Print Solutions | | | | X | A |
| Industries Sanimax Inc | | | | X | C |
| Innovative Interfaces Inc | | | | X | C |
| Island Medical Management Holdings LLC | | | | X | C |
| ISS #2 LLC | | | | X | C |
| JHT Holdings Inc | | | | X | A |
| K2 Wind Co Lp | | | | X | E |
| KFC Holding Co/Pizza Hut Holding | | | | X | G |
| Kingston Solar LP | | | | X | E |
| Kruger Wayagamack Inc | | | | X | A |
| Lackawanna Energy center LLC | | | | X | G |
| Lakeland Tours LLC | | | | X | C |

| | | |
|---|---|---|
| Level 3 Financing Inc | X | D |
| Lièvre Power Financing Corp | X | D |
| Marc Antony Cosmetics Ltd | X | B |
| MarketCast LLC | X | A |
| MB Aerospace ACP Holdings III Corp | X | C |
| Melancthon Wolfe Wind LP | X | E |
| Met Axium Solar Cluster 2 Limited Partnership | X | D |
| Ministry Brands Holding, LLC | X | G |
| Minto Developments Inc | X | C |
| Moran Foods LLC | X | H |
| National Intergovernmental Purchasing Alliance Co | X | C |
| New Enterprise Stone & Lime Co Inc | X | C |
| New Richmond Wind LP | X | E |
| Nielsen Finance LLC | X | F |
| Nielsen Finance LLC / Nielsen Finance Co | X | H |
| NSM Insurance Group | X | C |
| Oliver Street Dermatology Holdings LLC | X | C |
| Osmotica Pharmaceutical Corp | X | B |
| Otg Management Inc | X | C |
| Petco Animal Supplies Inc | X | G |
| PetSmart Inc | X | H |
| Physicians Endoscopy | X | A |
| Plenary Health Kelowna LP | X | C |
| Plenary Health North Bay Finco Inc | X | E |
| Polk Acquisition | X | C |
| Ports America Holdings Inc | X | F |
| Prime Security Services Borrower LLC | X | H |
| Prometheus Group Holdings LLC | X | A |
| QC Supply LLC | X | C |
| Quikrete Holdings Inc | X | G |
| Restaurant Technologies Inc | X | C |
| Riverview Power LLC | X | G |
| Schooltop Solar Limited Partnership | X | D |
| Shift Digital | X | C |
| Smile Brands Group Inc | X | B |
| SNC-Lavalin Innisfree McGill Financement Inc | X | G |
| Société de cogénération de St-Félicien | X | B |
| Société en Commandite H2O Énergie | X | H |
| Southern Star Central Corp | X | E |
| SouthernCarlson | X | C |
| SSL Financement Inc | X | D |

10 INVESTISSEMENTS EN ACTIONS, EN OBLIGATIONS ET EN CRÉANCES D'ENTREPRISES DE SOCIÉTÉS FERMÉES (suite)
 au 31 décembre 2016
 (juste valeur - en millions de dollars)

| SOCIÉTÉS | Parts | Actions | Valeurs convertibles | Obligations et créances d'entreprises | Valeur des investissements |
|--|-------|---------|----------------------|---------------------------------------|----------------------------|
| Steiner US Holdings Inc | | | | X | G |
| Sterling Infosystems Inc | | | | X | E |
| TAPC Holdings LP | | | | X | G |
| T-Mobile USA Inc | | | | X | E |
| Tornatech Inc | | | | X | A |
| Towne Holdings Inc | | | | X | C |
| Trojan Merger Sub Inc | | | | X | C |
| US Anesthesia Partners Inc | | | | X | B |
| Vents du Kempt Inc | | | | X | D |
| Veresen Midstream LP | | | | X | E |
| Windsor Essex Mobility Group GP | | | | X | C |
| Wrench Group/The | | | | X | C |
| Zywave Inc | | | | X | D |
| BTAA | | | | | |
| BTAA | | | | | |
| Véhicule d'actifs cadres I (VAC 1) | | | | X | J |
| Véhicule d'actifs cadres II (VAC 2) | | | | X | G |
| Véhicule d'actifs cadres III (VAC 3) | | | | X | E |
| BTAA exclus de l'entente de restructuration | | | | | |
| Superior Trust | | | | X | D |

Notes importantes à la compréhension du tableau :

Ce tableau comprend les principaux investissements en actions, en obligations et en créances d'entreprises de sociétés fermées de la Caisse ainsi que ceux des investissements sous-jacents de ses filiales non-consolidées. Le contenu de ce tableau est assujéti aux normes de déclaration applicables à la liste annuelle de tels investissements.

La liste annuelle ne doit comporter aucune information susceptible de nuire aux opérations de la Caisse, à ses intérêts économiques ou à sa compétitivité, de révéler un projet de transaction, une transaction ou une série de transactions en cours, ou de causer un préjudice à une entreprise. En conséquence, il peut occasionnellement exister des variations entre les investissements présentés dans la liste annuelle et ceux qui sont inscrits aux registres de la Caisse au 31 décembre.

Conformément aux ententes intervenues, n'est pas incluse dans la liste la valeur spécifique des investissements effectués dans toute société fermée (selon la définition de la Loi sur les valeurs mobilières du Québec) si elle n'a pas donné son accord à la divulgation.

¹ Placements sous-jacents des filiales non-consolidées du Groupe Ivanhoé Cambridge et d'Otéra Capital.

² Placement effectué ou détenu par la Caisse ou une filiale créée en vertu de l'article 37.1 de la Loi sur la Caisse.

³ Placement effectué ou détenu par la Caisse ou une filiale en vertu du dernier alinéa de l'article 37.1 de la Loi sur la Caisse.

| Lieu | Terrains et immeubles | Lieu | Terrains et immeubles | Lieu | Terrains et immeubles |
|---------------|--------------------------------------|-----------------|--|--------------------|---|
| Herndon | 508 Pride Avenue | San Francisco | 3440, 3605 20 th Street | Sunnyvale | 1180 Lochinvar Avenue |
| Kirkland | 11110 Forbes Creek Drive | San Francisco | 345, 990 Fulton Street | Sunnyvale | 255 Caspian Drive |
| Lakewood | 3505 Nelson Circle S | San Francisco | 350 Judah | Tempe | 3255 Dorsey Lane S |
| Los Angeles | 523 West 6 th Street | San Francisco | 3560 Divisadero Street | Valencia | 24640 Town Center Drive |
| Miami | 901 Miami Avenue S | San Francisco | 40 Tiffany Avenue | Washington | 5210 3 rd Street NE |
| New York | 10 Downing Street | San Francisco | 455 Hyde | Washington | 801 New Jersey Avenue SE |
| New York | 101, 108 15 th Street W | San Francisco | 520 Scott | | |
| New York | 1095, 1211 Avenue of the Americas | San Francisco | 55 Genoa | France | |
| New York | 1143 2 nd Avenue | San Francisco | 600-610, 920 Leavenworth | Toulouse | Terrain - Inter. rue Des Chênes et Route D82 |
| New York | 120 - 160 97 th Street W | San Francisco | 605, 828 Jones Street | | |
| New York | 135 96 th Street W | San Francisco | 610-660 Clipper | | |
| New York | 141 33 rd Street E | San Francisco | 634,655 Powell | Mexique | |
| New York | 1411, 1745 Broadway | San Francisco | 65 Buena Vista | Mexico | Cuajimalpa |
| New York | 167 82 nd Street E | San Francisco | 686 Post | Mexico | Terrain - Quartier de Nuevo Polanco |
| New York | 20, 41 Park Avenue | San Francisco | 721, 816, 990 Geary | | |
| New York | 210 89 th Street W | San Francisco | 726, 969, 1240 Bush | Royaume-Uni | |
| New York | 235 - 237 48 th Street W | San Francisco | 735 Taylor | Londres | 1 Stonecutter Street |
| New York | 252, 360 1 st Avenue | San Francisco | 737, 795, 825 -835 Pine Street | Londres | 3 Minster Court |
| New York | 330 Hudson Street | San Francisco | 916 Pacific | Londres | 21 Lombard Street |
| New York | 360 65 th Street E | San Francisco | 925 Pierce | Londres | 1 - 11 Pond Palace |
| New York | 364 18 th Street W | San José | 150, 160, 170, 180 Baytech Drive | Londres | 11 - 13 Young Street |
| New York | 753 Amsterdam Avenue | San José | 1500 Cottle Road | Londres | 13 Park Walk |
| New York | 8 Gramercy Park S | San José | 2585, 2595 Junction Avenue | Londres | 117 - 167 Fulham Road |
| Pasadena | El Molino et Walnut/Hudson et Walnut | San José | 2600 - 2610 N. First St. / 25 E | Londres | 143 Park Road |
| Pasadena | 25 Walnut Street W | San José | 2610, 2630, 3025 Orchard Parkway | Londres | 20 Hamlet Gardens |
| Pleasant Hill | 225 Coggins Dr. | San José | 2660, 2680, 2700, 2720, 2740 Zanker Road | Londres | 21 - 22 Prince of Wales Terrace |
| Pleasanton | 3992 Stoneridge Drive | | | Londres | 3 Abbey Orchard Street |
| Reston | 12032 Waterside View | San José | 2904 Orchard | Londres | 39 - 41 Nottingham Place |
| San Francisco | 1 San Antonio | San José | 355 Kiely boul. | Londres | 39 Hill Street |
| San Francisco | 1025 Steiner Street | San José | 5325, 5390-5400, 5500-5550, 5750, 5830-5870 Hellyer Avenue | Londres | 39 Westferry Circus |
| San Francisco | 1025,1035 Sutter | | | Londres | 4 Eccleston Street |
| San Francisco | 1030, 1424 - 1428 Polk | San José | 55 West Trimble Road | Londres | 4b Merchant Square, Paddington |
| San Francisco | 1060 Pine | San José | 5705 - 5725 Silver Creek | Londres | 57 Farrington Street |
| San Francisco | 11, 1064 Dolores | San José | 5710 Fontanoso Way | Londres | 62 Green Street, Mayfair |
| San Francisco | 1117 Ocean | San José | 5900, 5901, 5921, 5941 - 5945, 5961, 5970, 5981 Optical Court | Londres | 65 Duke Street, Mayfair |
| San Francisco | 1320 - 1380 Lombard Street | | | Londres | 79 - 81, 85 Lexham Gardens |
| San Francisco | 140 Duboce | San José | 75 East Trimble Road | Londres | 86 - 92 Kensington Gardens Square |
| San Francisco | 1405 Franklin | San José | 845 - 855, 875 Embedded | | |
| San Francisco | 1501 - 1509 Haight | San José | 881 Winchester boul. S | | |
| San Francisco | 16, 50 Laguna, Hayes Valley | San José | 935 Willowleaf Drive | | |
| San Francisco | 1750, 1760 Golden Gate | Santa Clara | 2001 Walsh | | |
| San Francisco | 1819 Golden Gate | Santa Clara | 2220, 2300, 2330 Central Expressway | | |
| San Francisco | 2023, 2385 Folsom | Santa Clara | 2251 Lawson Lane | | |
| San Francisco | 210 - 218 Church | Santa Clara | 2770 - 2800, 2880, 2890 Scott Boulevard | | |
| San Francisco | 2198 Market Street | Santa Clara | 3301 Olcott | | |
| San Francisco | 2619 Mission | Santa Clara | 4750 Patrick Henry Drive | | |
| San Francisco | 2620 Laguna | Seattle | 1 st Avenue West and Thomas | | |
| San Francisco | 2730 Sacramento | Seattle | 1100 Second Avenue | | |
| San Francisco | 295 Castro | Seattle | 1420 5 th Avenue | | |
| San Francisco | 300 Buchanan | Seattle | 301 Queen Anne Ave N. | | |
| San Francisco | 310 6 th Avenue | Seattle | 411 University Street | | |
| San Francisco | 312, 430,720, 3035 Baker | Seattle | 935 Willowleaf Drive | | |
| San Francisco | 324 Larkin | Seattle | 999, 1111 Third Avenue | | |
| San Francisco | 337 10 th Avenue | Stevenson Ranch | 25399 The Old Road | | |

Lieu**Adresse**

CanadaOakridge Centre
Skyway650 West 41st Avenue Vancouver
65 Skyway Avenue Etobicoke

Sauf indication contraire, tous les chiffres sont exprimés en dollars canadiens.
De plus, les symboles M et G désignent respectivement les millions et les milliards.

Ce document, de même que le Rapport annuel 2016, sont accessibles sur notre site : www.cdpq.com.

Renseignements : 514 842-3261
info@cdpq.com

This publication, as well as the 2016 Annual Report, are available in English on our website at www.cdpq.com.

Dépôt légal – Bibliothèque et Archives nationales du Québec, 2017

BUREAU D'AFFAIRES

1000, place Jean-Paul-Riopelle
Montréal (Québec) H2Z 2B3
Téléphone : +1 514 842-3261
Télécopieur : +1 514 842-4833

SIÈGE SOCIAL

65, rue Sainte-Anne, 14^e étage
Québec (Québec) G1R 3X5
Téléphone : +1 418 684-2334
Télécopieur : +1 418 684-2335

www.cdpq.com