

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements
Au 31 décembre 2018

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 31 décembre 2018

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
Obligations (62,4 %)				
Obligations fédérales et garanties (28,0 %)				
Fiducie du Canada pour l'habitation	2025-12-15, 1,95 %	22 387	21 704	21 725
	2025-12-15, 2,25 %	10 000	10 198	9 895
	2026-09-15, 1,90 %	30 400	29 300	29 234
	2027-06-15, 2,35 %	27 535	27 008	27 281
	2028-03-15, 2,35 %	10 450	10 131	10 315
Gouvernement du Canada	2024-03-01, 2,25 %	16 040	16 149	16 314
	2024-06-01, 2,50 %	75 986	77 832	78 303
	2025-06-01, 2,25 %	1 600	1 625	1 632
	2027-06-01, 1,00 %	59 134	54 325	54 807
	2028-06-01, 2,00 %	24 711	24 289	24 784
LNH Merrill Lynch Canada ¹	2022-09-01, 1,89 %	13 899	13 695	13 699
Total obligations fédérales et garanties		292 142	286 256	287 989
Obligations provinciales, municipales ou garanties (21,5 %)				
Municipal Finance Authority of British Columbia	2025-10-02, 2,65 %	3 000	3 006	2 986
OPB Finance Trust	2026-10-25, 2,98 %	4 330	4 333	4 335
Province de la Colombie-Britannique	2027-06-18, 2,55 %	1 500	1 486	1 484
	2028-12-18, 2,95 %	3 300	3 310	3 362
Province de la Nouvelle-Écosse	2027-06-01, 2,10 %	3 500	3 382	3 319
Province de la Saskatchewan	2024-06-03, 3,20 %	6 500	6 684	6 708
	2026-06-02, 2,55 %	2 985	2 899	2 946
	2028-12-02, 3,05 %	4 000	3 967	4 057
Province de l'Alberta	2024-06-01, 3,10 %	4 100	4 191	4 203
	2025-06-01, 2,35 %	8 100	7 912	7 939
	2027-06-01, 2,55 %	2 500	2 449	2 444
	2028-12-01, 2,90 %	1 000	1 000	998
Province de l'Ontario	2025-06-02, 2,60 %	22 900	22 537	22 850
	2026-06-02, 2,40 %	30 315	29 632	29 675
	2027-06-02, 2,60 %	9 750	9 622	9 613
	2028-06-02, 2,90 %	5 000	4 958	5 031
Province de Québec	2025-09-01, 2,75 %	44 520	44 270	44 900
	2026-09-01, 2,50 %	16 900	16 619	16 689
	2027-09-01, 2,75 %	12 700	12 600	12 713
	2028-09-01, 2,75 %	1 000	995	998
Province de Terre-Neuve-et-Labrador	2025-06-02, 2,30 %	4 500	4 357	4 380
Province du Manitoba	2024-06-02, 3,30 %	3 100	3 200	3 212
	2025-06-02, 2,45 %	6 000	5 864	5 920
	2027-06-02, 2,60 %	8 000	7 751	7 849
	2028-06-02, 3,00 %	10 400	10 244	10 478
Province du Nouveau-Brunswick	2027-08-14, 2,35 %	2 500	2 401	2 394
Total obligations provinciales, municipales ou garanties		222 400	219 669	221 483
Obligations d'institutions financières (8,0 %)				
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2025-05-26, 3,30 %	6 530	6 595	6 615
Banque de Montréal	2024-09-11, 2,70 %	900	900	886
	2026-12-09, 2,70 %	7 300	7 062	7 090
	2028-03-01, 3,19 %	4 900	4 873	4 901

¹ Ce titre est garanti par la Société canadienne d'hypothèques et de logement.

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 31 décembre 2018

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
Obligations d'institutions financières (suite)				
Banque Royale du Canada	2019-06-19, 2,37 %	3 500	3 500	3 501
	2023-05-01, 2,95 %	9 700	9 685	9 715
	2023-12-05, 2,33 %	3 700	3 680	3 597
	2025-07-16, 4,93 %	1 500	1 654	1 668
Banque Scotia	2024-06-28, 2,29 %	4 800	4 566	4 628
	2026-12-02, 2,62 %	900	865	868
	2028-02-02, 3,10 %	6 000	5 967	5 956
Banque Toronto-Dominion	2024-07-24, 3,23 %	9 100	9 102	9 223
	2024-07-25, 3,22 %	3 150	3 119	3 064
bclMC Realty	2026-12-31, 3,00 %	600	600	592
Chartwell Résidences pour Retraités	2025-02-28, 4,21 %	200	200	202
CI Financial	2021-10-25, 2,78 %	700	700	691
	2027-06-27, 3,90 %	350	339	343
Fairfax Financial Holdings	2027-09-06, 4,25 %	1 900	1 870	1 857
Fiducie de placement immobilier Canadian Tire	2026-03-01, 3,29 %	1 750	1 727	1 664
	2027-09-07, 3,87 %	750	750	726
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix	2027-12-08, 4,18 %	2 600	2 589	2 570
Financière Manuvie	2024-08-20, 3,05 %	750	723	731
First Capital Realty	2027-04-12, 3,75 %	800	800	770
Fonds de placement immobilier RioCan	2024-02-12, 3,29 %	551	535	540
Fonds de placement immobilier SmartCentres	2027-09-21, 3,83 %	1 500	1 463	1 440
Great-West Lifeco	2027-11-28, 3,34 %	500	495	502
Groupe TMX	2024-10-11, 3,00 %	250	250	246
Honda Canada Finance	2025-05-23, 3,44 %	845	842	852
Industrielle Alliance, Assurance et services financiers	2022-02-23, 2,64 %	300	300	295
Intact Corporation financière	2027-03-07, 2,85 %	1 600	1 600	1 522
OMERS Realty	2024-01-23, 2,86 %	1 000	986	996
	2027-07-04, 3,24 %	2 500	2 486	2 507
Société financière IGM	2026-10-26, 3,44 %	600	590	593
VW Credit Canada	2022-11-14, 3,70 %	900	899	906
Total obligations d'institutions financières		82 926	82 312	82 257
Obligations de sociétés (4,9 %)				
407 International	2027-02-04, 2,43 %	1 650	1 550	1 572
Alectra	2027-02-17, 2,49 %	1 000	947	957
Algonquin Power & Utilities	2026-11-17, 4,09 %	400	392	398
Alimentation Couche-Tard	2024-05-26, 3,06 %	1 675	1 610	1 618
AltaGas	2024-10-15, 3,84 %	1 000	1 033	984
AltaLink	2026-02-28, 2,75 %	1 360	1 340	1 337
Bell Canada	2026-05-12, 2,90 %	3 931	3 700	3 713
	2027-06-29, 3,60 %	2 000	1 943	1 963
Brookfield Asset Management	2026-12-16, 3,80 %	2 950	2 811	2 839
Brookfield Infrastructure Partners	2023-12-22, 3,32 %	800	779	780
	2028-06-11, 4,19 %	750	731	740
Brookfield Renewable Energy Partners	2025-03-02, 3,75 %	750	750	741
Bruce Power	2024-04-21, 3,00 %	500	481	489
Compagnies Loblaw	2024-05-10, 3,92 %	180	181	183
	2028-09-11, 4,49 %	1 100	1 122	1 131

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 31 décembre 2018

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
Obligations de sociétés (suite)				
Enbridge	2019-09-02, 4,77 %	60	61	61
	2024-08-19, 3,95 %	750	759	764
	2025-06-29, 3,45 %	250	248	250
	2026-05-10, 3,00 %	1 000	965	964
	2027-03-08, 3,20 %	1 000	966	950
	2027-09-27, 5,38 %	1 700	1 700	1 567
	2028-04-12, 6,63 %	750	750	752
Enbridge Gas Distribution	2025-06-11, 3,31 %	2 000	2 005	2 017
EnerCare Solutions	2023-12-21, 3,99 %	600	600	595
FortisAlberta	2024-06-30, 3,30 %	250	250	255
FortisBC Energy	2026-01-08, 2,58 %	975	950	947
Hydro One	2025-11-26, 2,77 %	1 150	1 110	1 118
Inter Pipeline	2024-02-18, 2,73 %	1 000	1 000	952
	2024-12-24, 3,17 %	1 000	1 000	962
Lower Mattagami Energy	2026-10-21, 2,31 %	300	281	283
Metro	2027-09-06, 3,39 %	470	470	449
North West Redwater Partnership	2024-04-23, 3,20 %	1 500	1 486	1 494
	2027-03-01, 2,80 %	1 543	1 444	1 459
Pembina Pipeline	2026-05-11, 3,71 %	1 150	1 173	1 133
	2027-03-15, 4,24 %	2 600	2 649	2 640
Reliance	2025-01-15, 3,84 %	1 110	1 101	1 089
Saputo	2025-06-14, 3,60 %	550	542	547
Shaw Communications	2026-12-01, 3,80 %	500	490	489
TELUS	2024-01-02, 3,35 %	300	303	298
	2024-10-17, 3,75 %	1 500	1 500	1 514
	2025-12-10, 3,75 %	1 900	1 886	1 906
Toromont Industries	2027-07-27, 3,84 %	750	751	753
TransCanada PipeLines	2025-04-17, 3,30 %	1 500	1 487	1 491
Transcanada Trust	2027-05-18, 4,65 %	1 000	897	894
Union Gas	2025-06-17, 3,19 %	1 000	997	1 003
Westcoast Energy	2025-09-08, 3,77 %	1 160	1 162	1 185
Total obligations de sociétés		51 364	50 353	50 226
Total obligations		648 832	638 590	641 955
Instruments de marché monétaire (5,0 %)				
AltaLink	2019-01-02, 2,14 %	800	800	800
	2019-03-01, 2,28 %	3 000	2 989	2 989
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto	2019-01-10, 2,15 %	3 500	3 498	3 498
	2019-03-13, 2,20 %	300	299	299
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2019-01-08, 1,96 %	700	700	700
	2019-03-25, 2,10 %	3 000	2 985	2 985
Banque de Montréal	2019-01-10, 1,97 %	2 500	2 499	2 499
	2019-03-07, 2,15 %	500	498	498
Banque Nationale du Canada	2019-01-10, 1,97 %	1 000	999	999
	2019-01-25, 2,23 %	1 000	998	998
	2019-03-22, 2,08 %	1 600	1 593	1 593
Banque Scotia	2019-01-03, 1,96 %	287	287	287
	2019-01-21, 2,16 %	1 000	999	999
	2019-01-28, 2,23 %	2 600	2 595	2 595
Banque Toronto-Dominion	2019-01-10, 1,97 %	1 800	1 799	1 799
	2019-01-11, 2,15 %	1 750	1 749	1 749
Énergir	2019-02-20, 2,16 %	4 000	3 988	3 988
Fédération des caisses populaires du Québec	2019-01-07, 2,08 %	13 000	13 000	13 000
Groupe TMX	2019-01-28, 2,13 %	3 750	3 744	3 744

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 31 décembre 2018

(en milliers de dollars)

Description	Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$	
Instruments de marché monétaire (suite)				
Honda Canada Finance	2019-01-04, 1,96 %	1 000	1 000	1 000
Province de l'Ontario	2019-10-02, 2,28 %	1 400	1 376	1 376
Province de Québec	2019-02-15, 1,85 %	1 500	1 497	1 497
	2019-04-05, 1,82 %	1 280	1 274	1 274
Total instruments de marché monétaire		<u>51 267</u>	<u>51 166</u>	<u>51 166</u>
Contrats de change (0,0 %)				
Fédération des caisses Desjardins du Québec	2019-03-29, 1.56845 \$CA/EUR	3 649	0	-15
	2019-03-29, 1.36145 \$CA/\$US	53 100	0	-52
Total contrats de change			<u>0</u>	<u>-67</u>
Nombre de parts				
Fonds d'actions canadiennes (8,7 %)				
Fiducie institutionnelle Fidelity Actions canadiennes à faible volatilité		3 748	46 466	44 581
FNB BMO d'actions canadiennes à faible volatilité		2 102	46 722	45 615
Total fonds d'actions canadiennes			<u>93 188</u>	<u>90 196</u>
Fonds d'actions mondiales (14,5 %)				
Fonds Desjardins IBrix Actions mondiales à faible volatilité		6 539	76 228	74 621
Fonds Desjardins Mondial de dividendes		3 856	75 702	74 669
Total fonds d'actions mondiales			<u>151 930</u>	<u>149 290</u>
Fonds immobilier (9,4 %)				
Fonds CORE Fiera Immobilier		41	45 499	48 002
Fonds immobilier canadien de prestige de Bentall Kennedy		5 998	47 827	48 426
Total fonds immobilier			<u>93 326</u>	<u>96 428</u>
Total autres investissements (100,0 %)			<u>1 028 200</u>	<u>1 028 968</u>