

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements
Au 31 décembre 2017

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 31 décembre 2017

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
Obligations (57,6 %)				
Obligations fédérales et garanties (24,4 %)				
Fiducie du Canada pour l'habitation	2021-12-15, 1,15 %	2 700	2 622	2 608
	2025-12-15, 1,95 %	5 625	5 585	5 462
	2025-12-15, 2,25 %	10 000	10 225	9 927
	2026-09-15, 1,90 %	12 000	11 790	11 548
	2027-06-15, 2,35 %	10 000	9 819	9 960
Gouvernement du Canada	2023-06-01, 1,50 %	42 000	41 547	41 144
	2025-06-01, 2,25 %	1 500	1 606	1 526
	2026-06-01, 1,50 %	33 700	33 123	32 334
	2027-06-01, 1,00 %	27 900	25 574	25 420
LNH Merrill Lynch Canada ¹	2019-09-01, 1,85 %	774	777	773
	2021-03-01, 1,25 %	58 422	58 224	57 213
	2021-08-01, 1,30 %	7 964	7 789	7 780
	2022-09-01, 1,89 %	8 890	8 779	8 778
Total obligations fédérales et garanties		221 475	217 460	214 473
Obligations provinciales, municipales ou garanties (17,9 %)				
Hydro-Québec	2023-02-15, 2,21 %	20 000	17 875	17 666
	2023-08-15, 2,28 %	10 000	8 801	8 698
	2024-02-15, 2,28 %	48 800	42 476	41 751
	2024-08-15, 2,02 %	14 040	12 290	11 818
Municipal Finance Authority of British Columbia	2021-06-01, 4,15 %	2 000	2 083	2 133
	2025-10-02, 2,65 %	3 000	3 007	3 007
OPB Finance Trust	2026-10-25, 2,98 %	2 330	2 329	2 352
Province de la Nouvelle-Écosse	2027-06-01, 2,10 %	3 500	3 370	3 339
Province de l'Ontario	2022-12-02, 2,01 %	26 800	24 291	23 834
	2025-06-02, 2,53 %	6 000	4 977	4 913
	2026-06-02, 2,40 %	14 725	14 641	14 537
	2027-06-02, 2,60 %	750	748	749
Province de Québec	2024-06-01, 2,46 %	3 000	2 565	2 541
	2026-09-01, 2,50 %	19 700	19 425	19 611
Total obligations provinciales, municipales ou garanties		174 645	158 878	156 949
Obligations d'institutions financières (9,4 %)				
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2018-05-08, 1,51 %	2 000	2 000	2 001
	2020-07-14, 1,85 %	2 155	2 153	2 133
Banque de Montréal	2021-10-28, 1,61 %	5 000	4 979	4 849
	2024-09-11, 2,70 %	900	900	899
Banque Nationale du Canada	2020-03-03, 1,74 %	1 300	1 300	1 286
Banque Royale du Canada	2018-08-01, 1,47 %	3 500	3 500	3 502
	2019-04-26, 1,40 %	5 000	5 003	4 968
	2019-07-17, 3,04 %	1 250	1 263	1 261
	2022-03-02, 1,97 %	5 250	5 239	5 141
	2023-12-05, 2,33 %	3 700	3 676	3 635
Banque Scotia	2018-03-22, 2,24 %	75	75	75
	2021-12-02, 1,90 %	1 700	1 700	1 664

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 31 décembre 2017

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
Obligations d'institutions financières (suite)				
Banque Toronto-Dominion	2023-07-18, 1,91 %	14 300	14 157	13 784
	2024-07-25, 3,22 %	650	650	649
bclMC Realty	2026-12-31, 3,00 %	600	600	600
CI Financial	2021-10-25, 2,78 %	1 700	1 700	1 699
Fairfax Financial Holdings	2027-09-06, 4,25 %	900	900	890
Fédération des caisses Desjardins du Québec	2020-03-02, 1,75 %	5 400	5 383	5 345
Fiducie d'actifs BNC	2020-06-30, 7,45 %	250	267	274
Fiducie de placement immobilier Canadian Tire	2026-03-01, 3,29 %	1 750	1 724	1 709
Fiducie de placement immobilier Granite	2023-09-30, 3,87 %	1 000	1 000	1 001
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix	2022-06-20, 3,60 %	1 175	1 197	1 206
	2023-02-07, 3,20 %	1 500	1 535	1 507
Financière Sun Life	2019-07-02, 5,70 %	1 000	1 017	1 052
	2021-08-23, 4,57 %	400	400	428
	2022-11-23, 2,75 %	750	750	745
First Capital Realty	2023-10-30, 3,90 %	1 700	1 724	1 755
	2027-04-12, 3,75 %	800	800	791
Fonds de placement immobilier Cominar	2022-06-01, 4,16 %	1 000	992	992
Fonds de placement immobilier RioCan	2022-05-30, 3,75 %	775	775	800
Groupe TMX	2024-10-11, 3,00 %	250	250	248
Honda Canada Finance	2022-07-15, 2,27 %	525	527	518
	2022-12-19, 2,49 %	180	180	179
Industrielle Alliance, Assurance et services financiers	2022-02-23, 2,64 %	300	300	297
Intact Corporation financière	2027-03-07, 2,85 %	1 600	1 600	1 537
John Deere Canada Funding	2020-07-13, 1,60 %	2 250	2 248	2 211
	2020-09-17, 2,05 %	750	755	744
Société Financière Daimler Canada	2021-07-08, 1,91 %	1 000	996	980
Société financière IGM	2019-04-08, 7,35 %	1 850	1 916	1 959
Toyota Credit Canada	2020-02-19, 1,80 %	2 450	2 449	2 429
	2020-05-20, 2,05 %	1 400	1 400	1 393
	2022-10-11, 2,62 %	1 700	1 700	1 703
Ventas Canada Finance	2023-02-15, 2,55 %	300	300	293
Wells Fargo Canada	2023-01-24, 3,46 %	1 200	1 270	1 245
Total obligations d'institutions financières		83 235	83 250	82 377
Obligations de sociétés (5,9 %)				
Algonquin Power & Utilities	2022-02-15, 4,65 %	750	771	797
Alliance Pipeline Limited Partnership	2019-12-16, 4,93 %	1 000	1 029	1 032
AltaGas	2024-10-15, 3,84 %	1 000	1 038	1 025
Altalink	2023-11-06, 3,67 %	1 000	1 021	1 060
	2026-02-28, 2,75 %	1 625	1 633	1 622
Bell Canada	2026-05-12, 2,90 %	4 800	4 692	4 631
BMW Canada	2021-06-15, 1,83 %	1 400	1 395	1 371
Brookfield Asset Management	2023-03-31, 4,54 %	1 053	1 069	1 124
	2023-12-08, 5,04 %	1 700	1 699	1 861
Brookfield Renewable Energy Partners	2025-03-02, 3,75 %	750	750	765
Bruce Power	2021-06-23, 2,84 %	300	300	302
Canadian Natural Resources	2020-08-14, 2,89 %	2 000	2 020	2 016
Canadian Utilities	2022-11-09, 3,12 %	775	757	796
Chartwell Résidences pour Retraités	2023-10-11, 3,79 %	200	200	199

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 31 décembre 2017

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
Obligations de sociétés (suite)				
Enbridge	2019-02-22, 4,10 %	1 000	1 012	1 020
	2019-09-02, 4,77 %	60	62	62
	2022-12-05, 3,19 %	400	391	404
	2027-09-27, 5,38 %	1 700	1 700	1 690
EnerCare Solutions	2020-02-03, 4,60 %	400	413	415
	2023-12-21, 3,99 %	600	600	613
Fortis	2023-10-12, 2,85 %	1 030	1 030	1 026
FortisAlberta	2024-06-30, 3,30 %	250	250	259
Hydro One	2019-11-18, 1,48 %	500	500	495
	2020-04-30, 1,62 %	2 000	1 994	1 977
	2021-02-24, 1,84 %	600	600	592
Inter Pipeline	2023-07-13, 2,61 %	125	125	122
	2024-02-18, 2,73 %	1 000	1 000	973
	2024-12-24, 3,17 %	1 000	1 000	989
Lower Mattagami Energy	2021-05-18, 4,33 %	300	313	319
Magna International	2022-11-15, 3,10 %	1 000	1 000	1 013
Metro	2022-11-05, 2,68 %	700	700	694
	2027-09-06, 3,39 %	470	470	466
North West Redwater Partnership	2022-01-23, 2,10 %	1 000	988	979
Pembina Pipeline	2026-05-11, 3,71 %	1 150	1 175	1 154
	2027-03-15, 4,24 %	2 600	2 654	2 694
Reliance	2019-03-15, 5,19 %	1 600	1 634	1 646
	2020-09-15, 3,81 %	700	702	712
	2025-01-15, 3,84 %	110	110	110
Rogers Communications	2023-12-13, 4,00 %	800	798	846
Saputo	2022-05-13, 1,94 %	1 000	1 000	969
	2023-09-21, 2,83 %	1 500	1 500	1 494
Superior Plus	2018-12-09, 6,50 %	500	516	526
	2020-02-27, 5,25 %	1 300	1 337	1 324
TELUS	2022-02-28, 2,35 %	4 750	4 729	4 690
	2024-01-02, 3,35 %	300	304	305
Toromont Industries	2027-07-27, 3,84 %	800	800	817
Toronto Hydro	2023-01-10, 2,91 %	1 000	1 019	1 020
TransAlta	2019-11-18, 6,40 %	250	250	264
	2020-11-25, 5,00 %	500	503	519
Westcoast Energy	2025-09-08, 3,77 %	560	560	586
Total obligations de sociétés		51 908	52 113	52 385
Total obligations		531 263	511 701	506 184

Instruments de marché monétaire (3,9 %)

Autorité aéroportuaire du Grand Toronto	2018-01-11, 1,28 %	3 000	2 999	2 999
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2018-01-29, 1,27 %	1 080	1 079	1 079
Banque de Montréal	2018-01-10, 1,27 %	1 192	1 192	1 192
	2018-03-12, 1,55 %	2 000	1 994	1 994
Banque Nationale du Canada	2018-01-10, 1,27 %	1 400	1 399	1 399
	2018-09-06, 1,74 %	2 000	1 978	1 978
Banque Scotia	2018-02-28, 1,34 %	1 000	998	998
	2018-03-27, 1,44 %	586	584	584
	2018-04-05, 1,10 %	2 000	1 993	1 993

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 31 décembre 2017

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
Instruments de marché monétaire (suite)				
Banque Toronto-Dominion	2018-05-16, 1,52 %	3 475	3 455	3 455
Gaz Métro	2018-01-25, 1,23 %	3 300	3 297	3 297
Gouvernement du Canada	2018-01-04, 0,95 %	845	845	845
Honda Canada Finance	2018-04-03, 1,46 %	1 325	1 320	1 320
	2018-05-02, 1,54 %	2 000	1 990	1 990
Inter Pipeline	2018-01-16, 1,33 %	500	500	500
	2018-02-16, 1,40 %	2 980	2 974	2 974
Province de Terre-Neuve-et-Labrador	2018-01-04, 1,10 %	1 850	1 850	1 850
Société de Transport de Montréal	2018-03-15, 1,35 %	3 500	3 491	3 491
Total instruments de marché monétaire		34 033	33 938	33 938
Contrats de change (0,2 %)				
Fédération des caisses Desjardins du Québec	2018-03-29, 1,2747 \$ CA/\$ US	76 100	0	1 465
Total contrats de change		76 100	0	1 465
Nombre de parts				
Fonds d'actions canadiennes (10,6 %)				
Fiducie institutionnelle Fidelity Actions canadiennes à faible volatilité		3 582	44 442	46 381
FNB BMO d'actions canadiennes à faible volatilité		2 102	44 744	46 716
Total fonds d'actions canadiennes			89 186	93 097
Fonds d'actions mondiales (17,6 %)				
Fonds Desjardins IBrix Actions mondiales à faible volatilité		6 220	71 995	79 075
Fonds Desjardins Mondial de dividendes		3 687	72 000	75 878
Total fonds d'actions mondiales			143 995	154 953
Fonds immobilier (10,1 %)				
Fonds CORE Fiera Immobilier		39	42 855	44 253
Fonds immobilier canadien de prestige de Bentall Kennedy		5 775	42 952	44 592
Total fonds immobilier			85 807	88 845
Total autres investissements (100,0 %)			864 627	878 482