

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements
Au 30 juin 2016

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 30 juin 2016

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
Obligations (74,6 %)				
Obligations fédérales et garanties (28,2 %)				
Fiducie du Canada pour l'habitation	2021-06-15, 1,25 %	2 820	2 816	2 851
	2022-03-15, 2,65 %	1 800	1 879	1 952
	2022-12-15, 2,40 %	14 350	14 577	15 406
	2023-09-15, 2,35 %	21 260	22 156	22 789
	2025-12-15, 2,25 %	34 000	35 077	36 024
	2026-09-15, 1,90 %	10 300	10 499	10 538
Gouvernement du Canada	2019-03-01, 1,75 %	100	103	103
LNH Banque Toronto Dominion ¹	2018-04-01, 1,65 %	10 448	10 449	10 549
LNH Merrill Lynch Canada ¹	2019-09-01, 1,85 %	60 934	61 653	61 878
	2020-05-01, 1,35 %	23 209	23 105	23 218
	2020-07-01, 1,07 %	4 753	4 698	4 703
	2021-03-01, 1,25 %	16 173	16 046	16 082
PSP Capital	2024-04-04, 3,29 %	3 150	3 240	3 495
Total obligations fédérales et garanties		203 297	206 298	209 588
Obligations provinciales, municipales ou garanties (23,7 %)				
Cadillac Fairview Finance Trust	2018-05-09, 3,64 %	7 175	7 399	7 486
Hydro-Québec	2023-02-15, 2,21 %	20 000	17 294	17 803
	2023-08-15, 2,28 %	10 000	8 506	8 748
	2024-02-15, 2,42 %	32 800	27 305	28 267
	2024-08-15, 2,02 %	17 700	15 032	15 038
Municipal Finance Authority of British Columbia	2021-06-01, 4,15 %	2 000	2 117	2 258
	2024-10-14, 2,95 %	2 000	2 120	2 147
	2025-10-02, 2,65 %	3 000	3 008	3 130
Municipalité régionale de York	2021-06-30, 4,00 %	1 500	1 541	1 681
Ontario Hydro	2017-10-17, 1,05 %	1 700	1 677	1 679
OPB Finance	2022-02-24, 1,88 %	3 650	3 596	3 679
	2023-05-24, 2,90 %	3 750	3 754	3 982
	2026-02-02, 2,95 %	2 000	1 999	2 106
Province de la Nouvelle-Écosse	2025-06-01, 2,15 %	2 500	2 423	2 535
Province de l'Alberta	2026-06-01, 2,20 %	20 200	20 198	20 394
Province de l'Ontario	2018-12-03, 1,05 %	845	845	847
	2022-12-02, 1,98 %	21 800	19 209	19 569
	2025-06-02, 2,53 %	6 000	4 792	4 992
Province de Québec	2023-06-01, 2,27 %	17 400	14 884	15 334
	2024-06-01, 2,46 %	3 000	2 472	2 564
Province du Manitoba	2025-06-02, 2,45 %	5 732	5 731	5 958
Province du Nouveau-Brunswick	2023-06-02, 2,85 %	600	589	643
Ville de Montréal	2025-09-01, 3,00 %	2 500	2 512	2 640
Ville de Toronto	2018-06-27, 4,95 %	3 000	3 113	3 227
Total obligations provinciales, municipales ou garanties		190 852	172 116	176 707

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

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 30 juin 2016

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
Obligations d'institutions financières (15,3 %)				
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2018-06-06, 6,00 %	2 000	2 083	2 157
	2020-07-14, 1,85 %	2 155	2 152	2 184
	2021-04-26, 1,90 %	650	650	659
Banque de Montréal	2020-10-06, 2,10 %	3 800	3 810	3 890
	2022-03-16, 2,12 %	5 300	5 276	5 411
Banque Nationale du Canada	2017-04-11, 3,26 %	1 100	1 101	1 111
	2020-03-03, 1,74 %	1 300	1 300	1 307
Banque Royale du Canada	2018-12-11, 2,77 %	2 300	2 357	2 376
	2019-04-26, 1,40 %	11 500	11 515	11 534
	2020-07-17, 1,92 %	4 000	3 999	4 055
	2022-03-02, 1,97 %	1 900	1 900	1 920
Banque Scotia	2018-03-22, 2,24 %	75	75	76
	2018-05-01, 1,33 %	10 359	10 358	10 358
	2020-09-09, 2,09 %	3 000	2 996	3 058
Banque Toronto-Dominion	2018-07-09, 5,83 %	4 000	4 181	4 316
	2020-06-24, 2,69 %	2 300	2 300	2 280
	2021-06-08, 1,68 %	2 500	2 499	2 518
	2021-12-22, 2,62 %	6 000	6 110	6 292
	2024-07-24, 3,23 %	2 500	2 591	2 731
Caisse centrale Desjardins	2020-03-02, 1,75 %	5 400	5 372	5 432
Compagnie d'Assurance-Vie Manufacturers	2018-11-29, 2,93 %	400	400	406
	2019-02-21, 2,81 %	2 500	2 548	2 535
Crédit Ford du Canada	2020-05-07, 2,45 %	2 950	2 945	2 959
Crombie Real Estate Investment Trust	2021-06-01, 3,96 %	160	161	167
Fiducie d'actifs BNC	2020-06-30, 7,45 %	250	276	289
Fiducie de placement immobilier Canadian Tire	2025-03-09, 3,53 %	900	900	935
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix	2021-02-08, 3,50 %	2 000	2 080	2 115
	2022-06-20, 3,60 %	1 175	1 203	1 251
Financière Manuvie	2019-04-08, 7,77 %	2 200	2 389	2 542
Financière Sun Life	2017-03-02, 4,38 %	1 000	1 015	1 016
	2019-07-02, 5,70 %	1 000	1 032	1 114
	2021-08-23, 4,57 %	400	400	449
First Capital Realty	2023-10-30, 3,90 %	1 700	1 730	1 839
Fonds de placement immobilier Cominar	2019-06-21, 3,62 %	1 725	1 742	1 751
Fonds de placement immobilier Riocan	2022-05-30, 3,75 %	775	775	827
General Motors Financial Company	2020-05-22, 3,08 %	350	350	354
Great-West Lifeco	2018-03-21, 6,14 %	1 500	1 512	1 615
Industrielle Alliance, Assurance et services financiers	2022-02-23, 2,64 %	300	300	297
Intact Financial Corporation	2021-08-18, 4,70 %	1 000	1 090	1 118
John Deere Canada Funding	2020-09-17, 2,05 %	750	758	763
RBC Trust Capital Securities	2018-06-30, 6,82 %	2 250	2 366	2 451
Société Financière Daimler Canada	2018-03-26, 2,27 %	385	385	390
	2018-10-02, 1,42 %	4 600	4 588	4 590
Société Financière IGM	2019-04-08, 7,35 %	1 850	1 990	2 115
TD Capital Trust	2018-12-31, 7,24 %	2 000	2 141	2 240
Toyota Credit Canada	2020-02-19, 1,80 %	2 450	2 449	2 468
	2020-05-20, 2,05 %	1 400	1 400	1 423
Total obligations d'institutions financières		110 109	111 550	113 684

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 30 juin 2016

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
Obligations de sociétés (7,4 %)				
Algonquin Power & Utilities Corp.	2022-02-15, 4,65 %	750	778	792
Alimentation Couche-Tard	2025-03-02, 3,60 %	1 625	1 625	1 716
Alliance Pipeline	2019-12-16, 4,93 %	1 000	1 051	1 046
AltaGas	2026-01-07, 4,12 %	300	300	312
AltaLink	2023-11-06, 3,67 %	1 000	1 026	1 108
	2026-02-28, 2,75 %	125	125	128
Bell Canada	2020-06-12, 3,54 %	2 300	2 353	2 439
	2022-09-03, 3,00 %	3 200	3 191	3 333
	2022-12-22, 3,35 %	2 700	2 867	2 861
BMW Canada	2018-11-26, 2,27 %	2 000	2 019	2 040
	2021-06-15, 1,83 %	400	399	400
Brookfield Asset Management	2023-03-31, 4,54 %	1 053	1 072	1 164
	2023-12-08, 5,04 %	1 700	1 699	1 920
Brookfield Renewable Energy	2025-03-02, 3,75 %	750	749	778
BRP Finance	2018-11-05, 5,25 %	2 425	2 577	2 603
Bruce Power LP	2021-06-23, 2,84 %	300	300	303
Canadian Natural Resources	2020-08-14, 2,89 %	2 000	2 031	1 990
Canadian Utilities	2022-11-09, 3,12 %	775	753	836
Compagnies Loblaw	2023-06-12, 4,86 %	2 200	2 396	2 540
Dollorama	2018-11-05, 3,10 %	220	222	226
Enbridge	2019-02-22, 4,10 %	1 000	1 027	1 046
	2019-09-02, 4,77 %	60	64	65
	2022-12-05, 3,19 %	400	388	407
Enercare Solutions	2020-02-03, 4,60 %	400	422	420
FortisAlberta	2024-06-30, 3,30 %	250	250	270
Hydro One	2020-04-30, 1,62 %	2 000	1 991	2 009
	2021-02-24, 1,84 %	600	600	607
Inter Pipeline	2024-12-24, 3,17 %	1 000	1 000	1 001
Lower Mattagami Energy	2021-05-18, 4,33 %	300	318	337
Magna International Inc.	2022-11-15, 3,10 %	1 000	1 000	1 043
North West Redwater Partnership	2022-01-23, 2,10 %	1 000	984	991
Pembina Pipeline Corporation	2022-10-24, 3,77 %	900	917	937
Reliance	2019-03-15, 5,19 %	1 600	1 674	1 680
	2020-09-15, 3,81 %	700	703	705
Rogers Communications	2023-12-13, 4,00 %	800	797	876
Sobeys	2018-08-08, 3,52 %	400	402	409
Superior Plus LP	2017-12-09, 6,50 %	1 000	1 049	1 002
TELUS Corporation	2022-02-28, 2,35 %	2 250	2 193	2 258
	2024-01-02, 3,35 %	1 000	1 017	1 047
Teranet Income Fund	2020-12-16, 4,81 %	1 050	1 130	1 160
Thomson Reuters	2020-09-30, 4,35 %	4 300	4 555	4 670
Toronto Hydro Corporation	2023-01-10, 2,91 %	1 000	1 024	1 060
TransAlta	2019-11-18, 6,40 %	250	250	251
Videotron	2025-03-15, 5,63 %	1 950	1 934	1 975
West Coast Energy Inc.	2025-09-08, 3,77 %	560	560	586
Total obligations de sociétés		52 593	53 782	55 347
Total obligations		556 851	543 746	555 326

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 30 juin 2016

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
Instruments de marché monétaire (6,6 %)				
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2016-10-18, 0,93%	400	399	399
	2016-12-07, 0,93%	500	498	498
	2016-12-15, 0,88%	1 000	996	996
	2016-12-22, 0,85%	2 000	1 991	1 991
Banque de Montréal	2016-09-29, 0,85%	1 900	1 896	1 896
	2017-05-15, 0,93%	1 100	1 091	1 091
Banque Nationale du Canada	2016-08-15, 0,77%	3 130	3 127	3 127
Banque Royale du Canada	2016-10-17, 0,90%	700	698	698
	2017-02-14, 0,92%	1 250	1 243	1 243
	2017-03-09, 0,93%	565	561	561
	2017-03-14, 0,93%	530	527	527
Banque Scotia	2016-12-19, 0,88%	1 100	1 095	1 095
	2017-04-05, 1,02%	1 900	1 885	1 885
Banque Toronto-Dominion	2016-12-19, 0,90%	1 500	1 494	1 494
	2017-02-10, 0,95%	2 000	1 988	1 988
Gaz Métro	2016-07-06, 0,83%	1 820	1 820	1 820
	2016-08-03, 0,84%	620	620	620
Honda Canada Finance	2016-11-25, 0,89%	2 175	2 167	2 167
	2016-12-06, 0,88%	1 500	1 494	1 494
Province de l'Ontario	2016-08-31, 0,62%	6 290	6 283	6 283
	2016-12-21, 0,65%	3 900	3 888	3 888
Province de Québec	2016-08-26, 0,62%	6 670	6 664	6 664
	2017-02-17, 0,73%	925	921	921
Province de Terre-Neuve-et-Labrador	2016-08-04, 0,62%	1 000	999	999
Société de transport de Montréal	2016-09-15, 0,81%	2 000	1 997	1 997
Toyota Credit Canada	2017-02-21, 0,98%	3 000	2 982	2 982
Total instruments de marché monétaire		49 475	49 324	49 324
Contrats de change (-0,1 %)				
Caisse centrale Desjardins	2016-09-30, 1,2833 \$ CA/\$ US	81 300	0	- 668
Total contrats de change			0	- 668
			Nombre de parts	
Fonds d'actions mondiales (6,9 %)				
Fonds Desjardins IBrix Actions mondiales à faible volatilité cat. I		2 296 961	25 000	25 847
Fonds Desjardins Mondial de dividendes cat. I		1 349 857	25 000	25 830
Total fonds d'actions mondiales			50 000	51 677
Fonds immobilier (2,0 %)				
Fonds CORE Fiera Immobilier		9 739	9 844	10 396
Fonds immobilier canadien de prestige Bentall Kennedy		551 642	3 931	4 172
Total fonds immobilier			13 775	14 568

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 30 juin 2016

(en milliers de dollars)

Description		Nombre d'actions	Coût \$	Juste Valeur \$
Actions privilégiées (10,0 %)				
Banque de Montréal	Perpétuelle, 5,20 %	173 400	4 439	4 019
Banque Nationale du Canada	Perpétuelle, 3,80 %	25 000	606	594
Banque Royale du Canada	Perpétuelle, 4,45 %	61 000	1 562	1 531
	Perpétuelle, 4,50 %	118 600	2965	2978
	Perpétuelle, 4,60 %	92 100	2 346	2 317
	Perpétuelle, 4,70 %	15 700	394	396
	Perpétuelle, 5,00 %	131 100	3 352	3 072
	Perpétuelle, 5,50 %	30 000	750	797
Banque Scotia	Perpétuelle, 3,70 %	130 000	3 267	2 587
	Perpétuelle, 4,50 %	50 200	1 289	1 254
	Perpétuelle, 5,00 %	50 000	1 270	1 152
	Perpétuelle, 5,25 %	16 000	412	410
	Perpétuelle, 5,60 %	170 000	4 458	4 350
Banque Toronto-Dominion	Perpétuelle, 3,60 %	40 000	963	789
	Perpétuelle, 3,70 %	20 000	391	414
	Perpétuelle, 3,75 %	118 300	2 780	2 166
	Perpétuelle, 3,80 %	54 500	1 355	1 003
	Perpétuelle, 3,90 %	4 500	106	83
	Perpétuelle, 4,90 %	50 000	1 123	1 246
Brookfield Asset Management	Perpétuelle, 4,20 %	80 000	1 752	1 393
	Perpétuelle, 4,40 %	30 000	480	549
	Perpétuelle, 4,50 %	112 860	2 891	2145
	Perpétuelle, 4,75 %	23 800	466	501
	Perpétuelle, 4,80 %	20 000	519	378
Canadian Utilities	Perpétuelle, 4,50 %	120 000	3 006	2 795
	Perpétuelle, 4,90 %	40 000	1 018	925
Corporation Financière Power	Perpétuelle, 1,63 %	77 800	1 970	879
	Perpétuelle, 4,20 %	29 700	757	607
	Perpétuelle, 4,95 %	25 000	658	584
	Perpétuelle, 5,10 %	10 000	263	240
	Perpétuelle, 5,75 %	10 000	220	257
	Perpétuelle, 6,00 %	95 000	2 528	2 478
Corporation Power du Canada	Perpétuelle, 5,00 %	55 400	1 212	1 306
Financière Manuvie	Perpétuelle, 3,90 %	75 000	1 729	1 350
	Perpétuelle, 4,20 %	132 500	3 365	1 973
	Perpétuelle, 4,40 %	25 400	675	502
	Perpétuelle, 4,50 %	35 900	867	781
	Perpétuelle, 4,60 %	36 300	761	778
	Perpétuelle, 5,60 %	15 000	375	397
Financière Sun Life	Perpétuelle, 4,45 %	10 000	223	216
	Perpétuelle, 4,50 %	25 000	565	545
	Perpétuelle, 4,75 %	137 500	3 050	3 179
	Perpétuelle, 4,80 %	60 300	1 482	1 412
Fortis	Perpétuelle, 4,00 %	9 300	203	164
	Perpétuelle, 4,10 %	111 000	2 759	2 153
	Perpétuelle, 4,75 %	52 300	1 132	1 222
	Perpétuelle, 5,25 %	40 000	877	698
Great-West Lifeco	Perpétuelle, 3,65 %	40 000	629	580
	Perpétuelle, 4,50 %	45 000	1 084	990
	Perpétuelle, 4,85 %	50 000	1 185	1 150
	Perpétuelle, 5,20 %	145 000	3 816	3 566

Capital régional et coopératif Desjardins
Relevé des autres investissements (non audité)
Au 30 juin 2016

(en milliers de dollars)

Description		Coût \$	Juste Valeur \$
Actions privilégiées (suite)			
Husky Energy	Perpétuelle, 4,45 %	4 500	73
	Perpétuelle, 4,60 %	100 000	2 471
Industrielle Alliance, Assurance et services financiers	Perpétuelle, 4,60 %	15 000	243
Intact Financial Corporation	Perpétuelle, 4,20 %	45 600	1 119
TransCanada	Perpétuelle, 3,80 %	47 200	862
	Perpétuelle, 4,00 %	50 400	1 151
	Perpétuelle, 4,25 %	83 600	1 607
		<u>83 600</u>	<u>1 471</u>
Total actions privilégiées		<u>83 871</u>	<u>74 185</u>
Total autres investissements (100,0 %)		<u>740 716</u>	<u>744 412</u>