

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements
Au 30 juin 2014

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 30 juin 2014

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste valeur \$
Obligations (85,7%)				
Obligations fédérales et garanties (23,3%)				
Fiducie du Canada pour l'habitation	2017-12-15, 1,70 %	12 200	12 275	12 263
	2019-06-15, 1,95 %	15 264	15 265	15 333
	2021-06-15, 3,80 %	4 835	5 227	5 317
	2022-12-15, 2,40 %	8 750	8 493	8 695
	2023-09-15, 2,35 %	2 500	2 348	2 451
	2023-09-15, 3,15 %	2 750	2 760	2 878
	2024-06-15, 2,90 %	7 100	7 195	7 234
LNH Banque de Montréal ¹	2017-09-01, 2,10 %	12 904	12 893	13 061
LNH Banque de Nouvelle-Écosse ¹	2016-04-01, 4,05 %	12 295	12 481	12 824
LNH Banque Royale du Canada ¹	2017-10-01, 2,30 %	7 664	7 772	7 794
LNH Banque Toronto Dominion ¹	2016-06-01, 0,65 %	7 214	7 162	7 137
	2017-08-01, 1,70 %	26 462	26 358	26 526
	2018-04-01, 1,65 %	20 570	20 300	20 535
	2018-07-01, 1,50 %	5 487	5 438	5 440
	2018-12-01, 1,80 %	5 134	5 086	5 132
PSP Capital	2017-02-16, 2,26 %	250	251	255
	2020-10-22, 3,03 %	800	800	831
	2024-04-04, 3,29 %	650	656	664
Total obligations fédérales et garanties		152 829	152 760	154 370
Obligations provinciales, municipales ou garanties (33,7%)				
Cadillac Fairview Finance Trust	2016-01-25, 3,24 %	21 150	21 703	21 764
	2018-05-09, 3,64 %	9 600	10 084	10 237
	2021-01-25, 4,31 %	1 200	1 315	1 334
Financement-Québec	2017-12-01, 3,50 %	5 955	6 190	6 317
	2018-12-01, 2,40 %	24 300	24 273	24 782
	2019-12-01, 2,45 %	27 686	27 747	28 036
Financière CDP	2020-07-15, 4,60 %	3 000	3 249	3 367
Hydro-Québec	2018-09-03, 1,46 %	10 000	10 042	10 039
Municipal Finance Authority of British Columbia	2019-06-03, 4,88 %	2 000	2 097	2 260
	2021-06-01, 4,15 %	2 000	2 160	2 197
	2022-06-01, 3,35 %	1 100	1 099	1 144
Municipalité régionale de York	2021-06-30, 4,00 %	1 500	1 556	1 622
Office Ontarien de Financement de l'Infrastructure Stratégique	2015-06-01, 4,60 %	3 000	3 009	3 092
Ontario Hydro	2014-10-17, sans coupon	26 300	26 212	26 217
OPB Finance Trust	2023-05-24, 2,90 %	1 750	1 671	1 722
Province de l'Ontario	2018-09-08, 2,10 %	2 000	2 008	2 021
	2021-06-02, 4,00 %	1 000	1 079	1 092
	2022-06-02, 3,15 %	15 050	15 311	15 483
	2023-06-02, 2,85 %	6 929	6 739	6 889
	2024-06-02, 3,50 %	5 500	5 646	5 700
Province de Québec	2018-12-19, 1,46 %	6 000	6 022	6 017
	2020-12-01, 4,50 %	17 370	19 123	19 506
	2021-12-01, 4,25 %	12 865	14 113	14 240

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 2014

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste valeur \$
Obligations provinciales, municipales ou garanties (suite)				
Province du Manitoba	2023-06-02, 2,55 %	2 000	1 937	1 955
Province du Nouveau-Brunswick	2023-06-02, 2,85 %	600	586	595
Ville de Montréal	2017-12-01, 5,00 %	2 500	2 534	2 758
Ville de Toronto	2018-06-27, 4,95 %	3 000	3 220	3 346
Total obligations provinciales, municipales ou garanties		215 355	220 725	223 732
Obligations d'institutions financières (20,9%)				
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2016-11-08, 2,65 %	3 500	3 496	3 570
	2017-07-14, 3,95 %	4 800	4 868	5 091
	2018-06-06, 6,00 %	2 000	2 163	2 279
Banque de Montréal	2016-07-08, 3,98 %	4 200	4 322	4 372
	2017-12-11, 2,24 %	5 000	4 899	5 038
	2018-03-28, 6,17 %	4 000	4 416	4 565
Banque de Nouvelle-Écosse	2016-11-08, 2,10 %	3 500	3 500	3 526
	2017-08-03, 2,90 %	17 850	18 009	18 286
	2018-03-22, 2,24 %	75	74	75
	2019-10-18, 3,04 %	2 500	2 500	2 559
Banque Nationale du Canada	2016-12-15, 2,70 %	5 000	5 037	5 106
	2017-04-11, 3,26 %	1 100	1 102	1 136
Banque Royale du Canada	2015-11-02, 3,18 %	7 500	7 622	7 644
	2018-03-12, 2,26 %	1 750	1 751	1 762
	2018-07-12, 2,82 %	5 600	5 594	5 737
Banque Toronto Dominion	2016-12-14, 4,78 %	7 135	7 368	7 610
	2018-07-09, 5,83 %	6 000	6 511	6 817
Caisse centrale Desjardins	2017-10-05, 3,50 %	4 200	4 163	4 393
Capital Desjardins	2020-05-05, 5,19 %	4 750	4 959	5 388
Choice Properties Real Estate Investment Trust	2022-06-20, 3,60 %	175	173	174
Compagnie d'Assurance-Vie Manufacturers	2017-06-01, 4,17 %	2 000	2 101	2 119
	2018-02-26, 2,82 %	2 300	2 279	2 343
	2018-11-29, 2,93 %	400	400	408
	2019-02-21, 2,81 %	500	500	506
Crédit Ford Canada	2016-11-21, 2,63 %	300	300	304
	2017-12-19, 3,32 %	950	952	979
Crombie Real Estate Investment Trust	2021-06-01, 3,96 %	160	162	163
Fiducie d'actifs BNC	2020-06-30, 7,45 %	1 000	1 152	1 230
Financière GM	2017-05-30, 3,25 %	850	850	852
Financière Manuvie	2019-04-08, 7,77 %	2 200	2 513	2 700
Financière Sun Life	2019-07-02, 5,70 %	1 000	1 051	1 147
	2021-08-23, 4,57 %	400	400	441
First Capital Realty	2019-07-30, 5,48 %	1 400	1 450	1 568
	2023-10-30, 3,90 %	900	903	900
Great-West Lifeco	2018-03-21, 6,14 %	1 500	1 524	1 712
Honda Canada Finance	2018-06-04, 2,35 %	400	392	403
Intact Corporation Financière	2021-08-18, 4,70 %	1 000	1 122	1 104
John Deere Canadian Fund	2017-10-18, 2,25 %	750	757	756
Placements CI	2015-12-14, 3,94 %	597	604	616
RBC Trust Capital Securities	2018-06-30, 6,82 %	3 350	3 678	3 912
Riocan Real Estate Investment Trust	2022-05-30, 3,75 %	775	775	780

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 30 juin 2014

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste valeur \$
Obligations d'institutions financières (suite)				
Société de Financement GE Capital Canada	2017-08-17, 5,53 %	7 000	7 436	7 752
	2018-02-08, 4,40 %	650	701	702
Société Financière Daimler Canada	2016-04-18, 2,23 %	420	421	424
	2016-09-15, 3,28 %	3 000	3 076	3 093
	2018-03-26, 2,27 %	385	385	387
Société Financière IGM	2019-04-08, 7,35 %	1 850	2 082	2 232
TD Capital Trust	2018-12-31, 7,24 %	2 000	2 243	2 392
Toyota Credit Canada	2018-11-21, 2,80 %	1 550	1 554	1 586
Total obligations d'institutions financières		130 222	134 290	138 639
Obligations de sociétés (7,8%)				
Algonquin Power Company	2021-02-15, 4,82 %	400	405	432
	2022-02-15, 4,65 %	350	350	371
Alliance Pipeline Limited Partnership	2019-12-16, 4,93 %	1 000	1 077	1 089
Altalink	2023-11-06, 3,67 %	250	250	260
Bell Aliant Communications régionales	2016-09-26, 5,41 %	2 000	2 139	2 147
	2020-06-12, 3,54 %	1 100	1 076	1 133
Bell Canada	2018-03-16, 4,40 %	2 000	2 103	2 152
	2019-06-18, 3,35 %	1 500	1 517	1 553
	2021-05-19, 4,95 %	3 335	3 398	3 723
	2023-03-22, 3,35 %	2 505	2 413	2 483
BMW Canada	2016-05-26, 2,11 %	2 000	2 018	2 016
Brookfield Asset Management	2023-03-31, 4,54 %	1 053	1 077	1 108
	2023-12-08, 5,04 %	1 700	1 699	1 830
BRP Finance ULC	2018-11-05, 5,25 %	425	451	468
Canadian Utilities	2022-11-09, 3,12 %	775	747	780
Compagnies Loblaw	2019-03-12, 3,75 %	1 900	1 945	1 996
	2023-06-01, 4,86 %	1 200	1 281	1 304
Dollorama	2018-11-05, 3,10 %	220	224	224
Enbridge	2019-09-02, 4,77 %	2 000	2 228	2 213
	2022-12-05, 3,19 %	400	385	400
Hydro One	2017-10-18, 5,18 %	1 000	1 107	1 104
	2018-10-09, 2,78 %	2 500	2 500	2 566
	2022-01-13, 3,20 %	350	357	360
Lower Mattagami Energy	2021-05-18, 4,33 %	300	324	329
Pembina Pipeline Corporation	2022-10-24, 3,77 %	400	407	413
Precision Drilling Corporation	2015-03-15, 6,50 %	1 250	1 293	1 316
Reliance LP	2019-03-15, 5,19 %	1 200	1 292	1 292
Rogers Communications	2019-11-04, 5,38 %	2 000	2 112	2 256
	2020-09-29, 4,70 %	500	555	548
	2021-03-22, 5,34 %	1 700	1 716	1 922
	2023-12-13, 4,00 %	800	796	814
Sobeys	2018-08-08, 3,52 %	400	404	413
Telus Corporation	2019-12-04, 5,05 %	3 000	3 095	3 351
Teranet Holdings Limited Partnership	2020-12-16, 4,81 %	1 050	1 163	1 152
Thomson Reuters Corporation	2019-05-23, 3,37 %	1 650	1 665	1 699
	2020-09-30, 4,35 %	1 500	1 555	1 615
Tim Hortons	2019-04-01, 2,85 %	730	730	736
	2023-09-01, 4,52 %	1 200	1 210	1 265

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 30 juin 2014

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste valeur \$
Obligations de sociétés (suite)				
Vidéotron	2025-03-15, 5,63 %	700	678	708
Total obligations de sociétés		48 343	49 742	51 541
Total obligations		546 749	557 517	568 282
Instruments de marché monétaire (3,2%)				
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2015-05-11, sans coupon	3 000	2 966	2 966
Banque de Montréal	2014-07-31, sans coupon	3 463	3 460	3 460
Banque Toronto Dominion	2014-09-04, sans coupon	3 500	3 493	3 494
Gouvernement du Canada	2014-10-09, sans coupon	11 550	11 521	11 520
Total instruments de marché monétaire		21 513	21 440	21 440
Contrats de change (0,0%)				
Caisse centrale Desjardins	2014-09-30, 1,0694 \$ CA/\$ US	154 264	0	(4)
Total contrats de change			0	(4)
Actions privilégiées (11,1%)				
			Nombre d'actions	
Banque Canadienne Impériale de Commerce	Perpétuelle, 5,60 %	15 000	400	382
	Perpétuelle, 5,75 %	17 000	454	434
Banque de Montréal	Perpétuelle, 4,50 %	33 400	868	863
	Perpétuelle, 5,20 %	173 400	4 439	4 378
Banque de Nouvelle-Écosse	Perpétuelle, 3,70 %	130 000	3 268	3 156
	Perpétuelle, 4,50 %	50 200	1 290	1 294
	Perpétuelle, 5,00 %	50 000	1 270	1 266
	Perpétuelle, 5,25 %	16 000	412	418
	Perpétuelle, 5,60 %	170 000	4 458	4 423
Banque Nationale du Canada	Perpétuelle, 6,00 %	125 000	3 350	3 330
Banque Royale du Canada	Perpétuelle, 4,45 %	61 000	1 562	1 560
	Perpétuelle, 4,50 %	70 000	1 772	1 799
	Perpétuelle, 4,50 %	48 600	1 193	1 250
	Perpétuelle, 4,60 %	92 100	2 346	2 362
	Perpétuelle, 4,70 %	15 700	394	400
	Perpétuelle, 5,00 %	131 100	3 352	3 330
Banque Toronto Dominion	Perpétuelle, 4,85 %	87 000	1 934	2 223
	Perpétuelle, 5,60 %	73 100	1 887	1 938
Brookfield Asset Management	Perpétuelle, 4,20 %	35 000	838	873
	Perpétuelle, 4,75 %	13 800	270	294
	Perpétuelle, 4,75 %	10 000	196	214
	Perpétuelle, 5,00 %	10 260	258	267
Canadian Utilities	Perpétuelle, 4,50 %	70 000	1 761	1 567
	Perpétuelle, 4,90 %	40 000	1 018	984

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 30 juin 2014

(en milliers de dollars)

		Nombre d'actions	Coût \$	Juste valeur \$
Actions privilégiées (suite)				
Corporation Financière Power	Perpétuelle, 1,63 %	77 800	1 970	1 537
	Perpétuelle, 4,95 %	25 000	658	598
	Perpétuelle, 5,10 %	10 000	263	249
	Perpétuelle, 5,75 %	10 000	220	256
	Perpétuelle, 6,00 %	95 000	2 528	2 436
Corporation Power du Canada	Perpétuelle, 5,00 %	55 400	1 212	1 346
Enbridge	Perpétuelle, 4,00 %	180 000	4 672	4 491
	Perpétuelle, 4,00 %	100 000	2 586	2 464
	Perpétuelle, 4,40 %	50 000	1 250	1 262
Financière Manuvie	Perpétuelle, 2,52 %	25 400	675	664
	Perpétuelle, 3,90 %	35 000	852	882
	Perpétuelle, 4,20 %	107 500	2 746	2 516
Financière Sun Life	Perpétuelle, 4,75 %	82 000	1 755	1 992
	Perpétuelle, 4,80 %	60 300	1 482	1 483
Great-West Lifeco	Perpétuelle, 4,50 %	45 000	1 084	1 034
	Perpétuelle, 5,20 %	145 000	3 816	3 632
Industrielle Alliance	Perpétuelle, 4,60 %	15 000	243	354
	Perpétuelle, 5,90 %	155 000	3 981	4 027
	Perpétuelle, 6,00 %	135 300	3 347	3 539
Total actions privilégiées			74 330	73 767
Total autres investissements (100,0 %)			653 287	663 485