

## **Capital régional et coopératif Desjardins**

Relevé des autres investissements  
**Au 30 juin 2017**

# Capital régional et coopératif Desjardins

## Relevé des autres investissements (non audité)

Au 30 juin 2017

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
<b>Obligations (58,7 %)</b>				
<b>Obligations fédérales et garanties (20,5 %)</b>				
Fiducie du Canada pour l'habitation	2025-12-15, 1,95 %	5 625	5 583	5 550
	2025-12-15, 2,25 %	10 000	10 238	10 098
	2026-09-15, 1,90 %	22 000	21 595	21 475
Gouvernement du Canada	2020-09-01, 0,75 %	6 400	6 374	6 306
	2022-03-01, 0,50 %	4 000	3 908	3 842
	2025-06-01, 2,25 %	1 500	1 613	1 569
	2026-06-01, 1,50 %	16 400	16 560	16 135
	2027-06-01, 1,00 %	30 000	28 018	27 954
LNH Merrill Lynch Canada inc. <sup>1</sup>	2019-09-01, 1,85 %	850	856	856
	2021-03-01, 1,25 %	59 091	58 916	58 296
<b>Total obligations fédérales et garanties</b>		<b>155 866</b>	<b>153 661</b>	<b>152 081</b>
<b>Obligations provinciales, municipales ou garanties (20,0 %)</b>				
Hydro-Québec	2023-02-15, 2,21 %	20 000	17 677	17 645
	2023-08-15, 2,28 %	10 000	8 700	8 681
	2024-02-15, 2,28 %	48 800	41 990	41 625
	2024-08-15, 2,02 %	14 040	12 165	11 781
Municipal Finance Authority of British Columbia	2021-06-01, 4,15 %	2 000	2 094	2 174
	2025-10-02, 2,65 %	3 000	3 007	3 046
OPB Finance	2026-10-25, 2,98 %	2 330	2 329	2 384
Province de la Nouvelle-Écosse	2025-06-01, 2,15 %	2 500	2 430	2 463
	2027-06-01, 2,10 %	1 500	1 476	1 444
Province de l'Alberta	2026-06-01, 2,20 %	10 000	9 921	9 785
Province de l'Ontario	2022-03-08, 1,35 %	1 150	1 142	1 124
	2022-12-02, 2,01 %	26 800	24 048	23 814
	2025-06-02, 2,53 %	6 000	4 915	4 899
	2026-06-02, 2,40 %	13 600	13 532	13 606
	2027-06-02, 2,60 %	750	748	759
Province de Québec	2024-06-01, 2,46 %	3 000	2 534	2 535
Ville de Toronto	2018-06-27, 4,95 %	700	713	725
<b>Total obligations provinciales, municipales ou garanties</b>		<b>166 170</b>	<b>149 421</b>	<b>148 490</b>
<b>Obligations d'institutions financières (11,4 %)</b>				
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2018-05-08, 1,02 %	2 000	2 000	2 001
	2018-06-06, 6,00 %	2 000	2 041	2 079
	2020-07-14, 1,85 %	2 155	2 153	2 158
Banque de Montréal	2021-10-28, 1,61 %	5 000	4 976	4 905
Banque Nationale du Canada	2020-03-03, 1,74 %	1 300	1 300	1 298
Banque Royale du Canada	2019-04-26, 1,40 %	8 500	8 507	8 477
	2019-07-17, 3,04 %	1 250	1 267	1 272
	2021-09-13, 1,58 %	1 675	1 670	1 641
	2022-03-02, 1,97 %	5 250	5 237	5 209
	2023-12-05, 2,33 %	2 500	2 500	2 496
Banque Scotia	2018-03-22, 2,24 %	75	75	75
	2021-12-02, 1,90 %	1 700	1 700	1 685
Banque Toronto-Dominion	2023-07-18, 1,91 %	14 300	14 145	13 990
bcIMC Realty Corp	2026-12-31, 3,00 %	600	600	610
Caisse centrale Desjardins	2020-03-02, 1,75 %	5 400	5 379	5 393

<sup>1</sup>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 30 juin 2017

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
<b>Obligations d'institutions financières (suite)</b>				
CI Financial	2021-10-25, 2,78 %	1 700	1 700	1 710
Compagnie d'Assurance-Vie Manufacturers	2018-11-29, 2,93 %	400	400	406
	2019-02-21, 2,81 %	2 500	2 530	2 538
Fiducie d'actifs BNC	2020-06-30, 7,45 %	250	270	280
Fiducie de placement immobilier Canadian Tire	2025-03-09, 3,53 %	900	900	914
	2026-03-01, 3,29 %	1 000	1 000	988
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix	2022-06-20, 3,60 %	1 175	1 199	1 220
	2023-02-07, 3,20 %	1 500	1 538	1 525
Financière Manuvie	2019-04-08, 7,77 %	2 200	2 324	2 418
Financière Sun Life	2019-07-02, 5,70 %	1 000	1 022	1 076
	2021-08-23, 4,57 %	400	400	439
First Capital Realty	2023-10-30, 3,90 %	1 700	1 726	1 777
Fonds de placement immobilier Riocan	2022-05-30, 3,75 %	775	775	809
Granite Real Estate Investment Trust	2023-09-30, 3,87 %	1 000	1 000	1 008
Honda Canada Finance	2022-07-15, 2,27 %	525	527	524
Industrielle Alliance, Assurance et services financiers	2022-02-23, 2,64 %	300	300	301
Intact Financial Corporation	2027-03-07, 3,85 %	1 600	1 600	1 564
John Deere Canada Funding	2020-07-13, 1,60 %	2 250	2 248	2 230
	2020-09-17, 2,05 %	750	756	752
Société Financière Daimler Canada	2021-07-08, 1,91 %	1 000	996	989
Société Financière IGM	2019-04-08, 7,35 %	1 850	1 942	2 016
Société financière Wells Fargo Canada	2023-01-24, 3,46 %	1 200	1 276	1 268
Toyota Credit Canada	2020-02-19, 1,80 %	2 450	2 449	2 448
	2020-05-20, 2,05 %	1 400	1 400	1 406
Ventas Canada	2023-02-15, 2,55 %	300	300	296
<b>Total obligations d'institutions financières</b>		<b>83 830</b>	<b>84 128</b>	<b>84 191</b>
<b>Obligations de sociétés (6,8 %)</b>				
Algonquin Power & Utilities Corp.	2022-02-15, 4,65 %	750	774	810
Alliance Pipeline	2019-12-16, 4,93 %	1 000	1 036	1 047
AltaGas	2024-10-15, 3,84 %	1 000	1 040	1 042
AltaLink	2023-11-06, 3,67 %	1 000	1 023	1 082
	2026-02-28, 2,75 %	1 625	1 634	1 651
Bell Canada	2022-12-22, 3,35 %	2 700	2 843	2 812
	2026-05-12, 2,90 %	3 000	2 962	2 964
BMW Canada	2021-06-15, 1,83 %	1 400	1 395	1 385
Brookfield Asset Management	2023-03-31, 4,54 %	1 053	1 070	1 143
	2023-12-08, 5,04 %	1 700	1 699	1 892
Brookfield Renewable Energy	2025-03-02, 3,75 %	750	750	775
Bruce Power LP	2021-06-23, 2,84 %	300	300	305
Canadian Natural Resources	2020-08-14, 2,89 %	2 000	2 024	2 024
Canadian Utilities	2022-11-09, 3,12 %	775	756	812
Chartwell Résidences pour Retraités	2023-10-11, 3,79 %	200	200	199
Enbridge	2019-02-22, 4,10 %	1 000	1 017	1 035
	2019-09-02, 4,77 %	60	63	63
	2022-12-05, 3,19 %	400	390	410
Energare Solutions	2020-02-03, 4,60 %	400	416	419
	2023-12-21, 3,99 %	600	600	613
Fortis	2023-10-12, 2,85 %	1 030	1 030	1 041
FortisAlberta	2024-06-30, 3,30 %	250	250	264

# Capital régional et coopératif Desjardins

## Relevé des autres investissements (non audité)

Au 30 juin 2017

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
<b>Obligations de sociétés (suite)</b>				
Hydro One	2019-11-18, 1,48 %	500	500	498
	2020-04-30, 1,62 %	2 000	1 993	1 995
	2021-02-24, 1,84 %	600	600	598
Inter Pipeline	2023-07-13, 2,61 %	125	125	124
	2024-02-18, 2,73 %	1 000	1 000	990
	2024-12-24, 3,17 %	1 000	1 000	1 007
Lower Mattagami Energy	2021-05-18, 4,33 %	300	314	326
Magna International Inc.	2022-11-15, 3,10 %	1 000	1 000	1 031
North West Redwater Partnership	2022-01-23, 2,10 %	1 000	987	991
Pembina Pipeline Corporation	2023-11-22, 2,99 %	700	700	697
	2026-05-11, 3,71 %	1 150	1 177	1 172
Reliance	2019-03-15, 5,19 %	1 600	1 647	1 664
	2020-09-15, 3,81 %	700	702	716
Rogers Communications	2023-12-13, 4,00 %	800	797	860
Saputo	2022-05-13, 1,94 %	1 000	1 000	982
	2023-09-21, 2,83 %	1 500	1 500	1 516
Sobeys	2023-05-08, 4,70 %	500	519	514
Superior Plus	2017-12-09, 6,50 %	500	524	529
	2020-02-27, 5,25 %	700	727	717
TELUS Corporation	2022-02-28, 2,35 %	4 750	4 727	4 748
	2024-01-02, 3,35 %	300	304	310
Toronto Hydro Corporation	2023-01-10, 2,91 %	1 000	1 021	1 035
TransAlta	2019-11-18, 6,40 %	250	250	265
	2020-11-25, 5,00 %	500	503	518
Videotron	2025-03-15, 5,63 %	1 950	1 935	2 104
West Coast Energy Inc.	2025-09-08, 3,77 %	560	560	588
<b>Total obligations de sociétés</b>		<b>48 978</b>	<b>49 384</b>	<b>50 283</b>
<b>Total obligations</b>		<b>454 844</b>	<b>436 594</b>	<b>435 045</b>
<b>Instruments de marché monétaire (3,6 %)</b>				
Banque de Montréal	2017-09-19, 0,86 %	2 000	1 996	1 996
Banque Nationale du Canada	2017-07-25, 0,96 %	1 600	1 599	1 599
Banque Royale du Canada	2018-02-14, 0,97 %	1 860	1 849	1 849
Banque Scotia	2018-04-05, 1,10 %	2 000	1 983	1 983
Banque Toronto-Dominion	2017-11-03, 0,93 %	2 000	1 993	1 993
Gouvernement du Canada	2017-09-07, 0,52 %	290	290	290
	2017-09-07, 0,53 %	1 150	1 149	1 149
	2017-07-27, 0,54 %	8 000	7 997	7 997
Honda Canada Finance	2017-11-01, 0,95 %	2 000	1 994	1 994
Province de l'Ontario	2017-12-27, 0,74 %	850	847	847
Province de Québec	2017-09-29, 0,85 %	3 000	2 994	2 994
Société de transport de Montréal	2017-08-02, 0,82 %	2 000	1 998	1 998
<b>Total instruments de marché monétaire</b>		<b>26 750</b>	<b>26 689</b>	<b>26 689</b>
<b>Contrats de change (0,2 %)</b>				
Fédération des caisses Desjardins du Québec	2017-09-29, 1.31351 \$ CA/\$ US	64 100 \$ US	0	1 187
<b>Total contrats de change</b>		<b>64 100 \$ US</b>	<b>0</b>	<b>1 187</b>

# Capital régional et coopératif Desjardins

## Relevé des autres investissements (non audité)

Au 30 juin 2017

(en milliers de dollars)

Description	Nombre de parts	Coût \$	Juste Valeur \$	
<b>Fonds d'actions canadiennes (8,3 %)</b>				
Fiducie Fidelity actions canadiennes à faible volatilité	2 437	30 018	30 832	
FNB BMO d'actions canadiennes à faible volatilité	1 428	30 032	31 049	
<b>Total fonds d'actions canadiennes</b>		<b>60 050</b>	<b>61 881</b>	
<b>Fonds d'actions mondiales (14,9 %)</b>				
Fonds Desjardins IBrix Actions mondiales à faible volatilité cat. I	4 641	51 975	55 485	
Fonds Desjardins Mondial de dividendes cat. I	2 714	51 315	55 434	
<b>Total fonds d'actions mondiales</b>		<b>103 290</b>	<b>110 919</b>	
<b>Fonds immobilier (11,5 %)</b>				
Fonds CORE Fiera Immobilier	38	41 454	42 660	
Fonds immobilier canadien de prestige Bentall Kennedy	5 513	40 968	42 252	
<b>Total fonds immobilier</b>		<b>82 422</b>	<b>84 912</b>	
	<b>Nombre d'actions</b>			
<b>Actions privilégiées (2,8 %)</b>				
Banque Nationale du Canada	Perpétuelle, 3,80 %	25 000	606	625
Banque Royale du Canada	Perpétuelle, 3,52 %	92 200	2 358	2 281
	Perpétuelle, 4,50 %	48 600	1 193	1 227
	Perpétuelle, 4,70 %	15 700	394	398
Banque Toronto-Dominion	Perpétuelle, 3,70 %	2 100	41	51
	Perpétuelle, 4,90 %	40 000	898	1 023
Brookfield Asset Management	Perpétuelle, 4,40 %	30 000	480	678
	Perpétuelle, 4,75 %	23 800	466	538
	Perpétuelle, 4,80 %	20 000	519	478
Canadian Utilities	Perpétuelle, 4,50 %	30 000	747	811
	Perpétuelle, 4,90 %	40 000	1 018	975
Corporation Financière Power	Perpétuelle, 0,53 %	73 200	1 853	1 098
	Perpétuelle, 4,20 %	29 700	757	686
	Perpétuelle, 6,00 %	70 000	1 863	1 809
Financière Manuvie	Perpétuelle, 3,90 %	56 300	1 274	1 228
	Perpétuelle, 4,00 %	9 100	225	213
	Perpétuelle, 4,50 %	35 900	867	809
	Perpétuelle, 5,60 %	15 000	375	405
Financière Sun Life	Perpétuelle, 4,50 %	25 000	565	559
	Perpétuelle, 4,80 %	60 300	1 482	1 434
Great-West Lifeco	Perpétuelle, 4,50 %	45 000	1 084	1 014
	Perpétuelle, 4,85 %	44 700	1 059	1 061
Industrielle Alliance, Assurance et services financiers	Perpétuelle, 4,60 %	15 000	243	347
Intact Financial Corporation	Perpétuelle, 3,33 %	45 600	1 119	1 018
<b>Total actions privilégiées</b>		<b>21 486</b>	<b>20 766</b>	
<b>Total autres investissements (100,0 %)</b>		<b>730 531</b>	<b>741 399</b>	