

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements
Au 31 décembre 2012

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 31 décembre 2012

(en milliers de dollars)

		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste valeur \$
Obligations (88,3 %)				
Obligations fédérales et garanties (27,4 %)				
Fiducie du Canada pour l'habitation	2017-06-15, 2,05 %	17 000	17 298	17 302
	2018-12-15, 4,10 %	2 710	2 958	3 055
	2020-12-15, 3,35 %	29 419	29 663	32 082
	2021-06-15, 3,80 %	30 635	32 431	34 468
	2022-03-15, 2,65 %	22 000	22 596	22 694
LNH Banque de Nouvelle-Écosse ¹	2016-04-01, 4,05 %	13 317	13 975	14 174
LNH Banque Toronto Dominion ¹	2014-04-01, 2,15 %	5 187	5 204	5 230
	2014-09-01, 2,60 %	15 957	16 103	16 184
	2015-09-01, 1,95 %	15 613	15 673	15 715
	2017-08-01, 1,70 %	10 101	9 993	9 985
PSP Capital Inc.	2017-02-16, 2,26 %	1 950	1 941	1 971
Société canadienne d'hypothèques et de logement	2017-02-01, 4,35 %	10 500	10 893	11 626
Total obligations fédérales et garanties		174 389	178 728	184 486
Obligations provinciales, municipales ou garanties (34,6 %)				
Cadillac Fairview Finance Trust	2016-01-25, 3,24 %	5 500	5 525	5 720
	2018-05-09, 3,64 %	3 000	3 121	3 204
Financement-Québec	2014-06-01, 3,25 %	17 000	17 471	17 460
	2016-06-02, 1,57 %, taux variable	6 400	6 413	6 415
	2017-04-25, 1,56 %, taux variable	10 000	9 992	9 980
	2017-12-01, 3,50 %	20 055	20 897	21 464
	2018-12-01, 2,40 %	15 600	15 643	15 758
	2019-12-01, 2,45 %	42 386	42 333	42 427
Financière CDP	2015-07-15, 1,75 %, taux variable	29 614	29 634	29 681
	2020-07-15, 4,60 %	3 000	3 304	3 400
Municipal Finance Authority of British Columbia	2016-04-19, 4,65 %	2 000	2 058	2 184
	2019-06-03, 4,88 %	4 000	4 245	4 578
	2021-06-01, 4,15 %	2 000	2 191	2 203
Municipalité régionale de York	2021-06-30, 4,00 %	1 500	1 566	1 618
Office Ontarien de Financement de l'Infrastructure Stratégique	2015-06-01, 4,60 %	3 000	3 022	3 205
Province de l'Ontario	2021-06-02, 4,00 %	3 975	4 103	4 399
	2022-06-02, 3,15 %	5 750	5 922	5 949
Province de Québec	2020-12-01, 4,50 %	19 670	21 440	22 386
	2021-12-01, 4,25 %	20 300	22 224	22 709
Ville de Laval	2015-03-12, 4,30 %	1 156	1 151	1 219
Ville de Montréal	2017-12-01, 5,00 %	2 500	2 548	2 800
Ville de Toronto	2018-06-27, 4,95 %	3 000	3 296	3 402
Total obligations provinciales, municipales ou garanties		221 406	228 099	232 161

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 2012

(en milliers de dollars)

		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste valeur \$
Obligations d'institutions financières (21,3 %)				
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2015-04-30, 4,11 %	6 400	6 564	6 710
	2016-11-08, 2,65 %	3 500	3 494	3 561
	2017-07-14, 3,95 %	4 800	4 898	5 145
	2018-06-06, 6,00 %	2 000	2 219	2 346
Banque de Montréal	2016-04-21, 5,10 %	17 050	17 943	18 596
	2016-07-08, 3,98 %	1 000	1 015	1 057
	2018-03-28, 6,17 %	6 150	7 022	7 222
Banque de Nouvelle-Écosse	2017-06-08, 4,10 %	2 000	2 054	2 153
	2017-08-03, 2,90 %	3 000	3 000	3 054
	2019-10-18, 3,04 %	2 500	2 500	2 527
Banque Nationale du Canada	2014-12-22, 4,93 %	4 850	4 987	5 130
	2017-04-11, 3,26 %	1 100	1 103	1 133
Banque Royale du Canada	2015-06-15, 4,35 %	8 500	8 733	8 967
	2016-01-11, 3,36 %	2 000	2 077	2 079
Banque Toronto Dominion	2016-12-14, 4,78 %	7 134	7 502	7 766
	2018-07-09, 5,83 %	10 400	11 375	12 160
Caisse centrale Desjardins	2017-10-05, 3,50 %	4 200	4 148	4 412
Capital Desjardins inc.	2014-04-01, 5,76 %	1 500	1 528	1 567
	2020-05-05, 5,19 %	8 750	9 219	9 976
Daimler Canada Finance	2016-09-15, 3,28 %	1 000	1 032	1 032
Fiducie d'actifs BNC	2020-06-30, 7,45 %	1 000	1 184	1 253
Financière Manuvie	2019-04-08, 7,77 %	2 200	2 598	2 753
Financière Sun Life	2019-07-02, 5,70 %	2 000	2 129	2 312
	2021-08-23, 4,57 %	400	400	434
First Capital Realty	2015-06-01, 5,95 %	1 000	1 024	1 078
	2019-07-30, 5,48 %	1 400	1 462	1 566
General Electric Capital Corporation	2015-01-26, 2,59 %, taux variable	2 000	2 000	2 026
Great-West Lifeco inc.	2018-03-21, 6,14 %	1 500	1 533	1 753
Placements CI inc.	2015-12-14, 3,94 %	597	610	620
RBC Trust Capital Securities	2018-06-30, 6,82 %	3 350	3 788	4 022
Société de Financement GE Capital Canada	2014-06-01, 4,40 %	6 500	6 742	6 745
	2017-08-17, 5,53 %	5 500	5 932	6 228
Société Financière IGM Inc.	2019-04-08, 7,35 %	1 850	2 145	2 283
TD Capital Trust	2018-12-31, 7,24 %	2 000	2 315	2 481
VW Credit Canada inc.	2016-02-01, 3,60 %	390	390	407
Total obligations d'institutions financières		129 521	136 665	142 554
Obligations de sociétés (5,0 %)				
Alliance Pipeline Limited Partnership	2019-12-16, 4,93 %	1 000	1 096	1 097
Bell Aliant Communications régionales	2019-02-26, 5,52 %	1 200	1 346	1 335
Bell Canada	2019-06-18, 3,35 %	1 500	1 522	1 544
	2021-05-19, 4,95 %	5 000	5 111	5 644
Cameco Corporation	2022-11-14, 3,75 %	1 000	1 000	994
Loblaw	2020-06-18, 5,22 %	3 500	3 601	3 984
Reliance LP	2017-03-15, 4,57 %	2 000	2 000	2 015

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 31 décembre 2012

(en milliers de dollars)

		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste valeur \$
Obligations de sociétés (suite)				
Rogers Communications	2019-11-04, 5,38 %	4 600	4 870	5 256
	2021-03-22, 5,34 %	2 700	2 730	3 091
Shaw Communications	2019-10-01, 5,65 %	675	692	759
TELUS	2019-12-04, 5,05 %	6 750	7 015	7 679
Total obligations de sociétés		29 925	30 983	33 398
Total obligations		555 241	574 475	592 599
Instruments de marché monétaire (2,0 %)				
Province de l'Ontario	2013-01-16, 1,28 %	9 912	9 912	9 912
Province de Québec	2013-02-08, sans coupon	3 600	3 596	3 596
Total instruments de marché monétaire		13 512	13 508	13 508
Contrats de change (0,0 %)				
Caisse centrale Desjardins	2013-03-28, 1,0294 \$ CA/\$ AU ²	1 400	-	-
	2012-03-28, 0,9946 \$ CA/\$ US	114 000	-	(247)
Total contrats de change			-	(247)
			Nombre d'actions	
Actions privilégiées (9,7 %)				
Banque Canadienne Impériale de Commerce	Perpétuelle, 5,60 %	15 000	400	382
	Perpétuelle, 5,75 %	17 000	454	436
Banque de Montréal	Perpétuelle, 4,50 %	33 400	868	875
	Perpétuelle, 5,20 %	235 500	6 029	5 916
Banque de Nouvelle-Écosse	Perpétuelle, 0,93 %	130 000	3 268	3 193
	Perpétuelle, 4,50 %	50 200	1 289	1 318
	Perpétuelle, 5,00 %	50 000	1 270	1 242
	Perpétuelle, 5,25 %	16 000	412	422
Banque Nationale du Canada	Perpétuelle, 5,60 %	170 000	4 458	4 464
	Perpétuelle, 5,85 %	6 200	165	156
	Perpétuelle, 6,00 %	125 000	3 350	3 334
Banque Royale du Canada	Perpétuelle, 4,45 %	61 000	1 562	1 584
	Perpétuelle, 4,50 %	70 000	1 772	1 822
	Perpétuelle, 4,50 %	48 600	1 193	1 265
	Perpétuelle, 4,60 %	92 100	2 346	2 397
	Perpétuelle, 4,70 %	15 700	394	409
	Perpétuelle, 5,00 %	131 100	3 352	3 357
	Perpétuelle, 6,25 %	20 000	500	526

²\$ AU: Dollar Australien

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 31 décembre 2012

(en milliers de dollars)

		Nombre d'actions	Coût \$	Juste valeur \$
Actions privilégiées (suite)				
Banque Toronto Dominion	Perpétuelle, 4,85 %	87 000	1 934	2 280
	Perpétuelle, 5,60 %	73 100	1 887	1 970
	Perpétuelle, 6,25 %	40 000	1 067	1 072
	Perpétuelle, 6,25 %	30 000	801	804
Canadian Utilities	Perpétuelle, 4,90 %	40 000	1 018	1 056
Corporation Financière Power	Perpétuelle, 1,63 %, taux variable	77 800	1 970	1 712
	Perpétuelle, 4,95 %	25 000	658	635
	Perpétuelle, 5,10 %	10 000	263	258
	Perpétuelle, 5,75 %	10 000	220	255
	Perpétuelle, 6,00 %	95 000	2 528	2 440
Corporation Power du Canada	Perpétuelle, 5,00 %	55 400	1 212	1 391
Financière Sun Life	Perpétuelle, 4,75 %	82 000	1 755	2 065
	Perpétuelle, 4,80 %	60 300	1 482	1 526
Great-West Lifeco inc.	Perpétuelle, 4,50 %	45 000	1 084	1 112
	Perpétuelle, 5,20 %	145 000	3 816	3 666
	Perpétuelle, 6,00 %	30 000	737	777
Industrielle Alliance	Perpétuelle, 4,60 %	15 000	243	372
	Perpétuelle, 5,90 %	155 000	3 981	4 185
	Perpétuelle, 6,00 %	135 300	3 347	3 603
	Perpétuelle, 6,20 %	16 700	415	435
Total actions privilégiées			63 500	64 712
Total autres investissements (100,0 %)			651 483	670 572