

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements
Au 30 juin 2012

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 30 juin 2012

(en milliers de dollars)

		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste valeur \$
Obligations (84,9 %)				
Obligations fédérales ou garanties (28,1 %)				
Fiducie du Canada pour l'habitation	2018-12-15, 4,10 %	25 100	26 454	28 509
	2020-12-15, 3,35 %	40 419	40 776	44 247
	2021-06-15, 3,80 %	30 635	32 524	34 685
	2022-03-15, 2,65 %	30 950	31 830	32 000
LNH Banque de Nouvelle-Écosse ¹	2016-04-01, 4,05 %	13 642	14 530	14 662
LNH Banque Toronto Dominion ¹	2014-04-01, 2,15 %	5 268	5 302	5 329
	2014-09-01, 2,60 %	17 448	17 713	17 759
	2015-09-01, 1,95 %	16 767	16 857	16 861
PSP Capital Inc.	2017-02-16, 2,26 %	1 950	1 940	1 964
Société canadienne d'hypothèques et de logement	2017-02-01, 4,35 %	10 500	10 938	11 753
		<u>192 679</u>	<u>198 864</u>	<u>207 769</u>
Total obligations fédérales ou garanties				
Obligations provinciales ou garanties (31,7 %)				
Cadillac Fairview Finance Trust	2016-01-25, 3,24 %	5 500	5 529	5 721
	2018-05-09, 3,64 %	3 000	3 131	3 189
Financement-Québec	2016-12-01, 3,50 %	6 920	7 032	7 400
	2017-12-01, 3,50 %	24 800	25 599	26 593
	2018-12-01, 2,40 %	15 000	14 920	15 090
Financière CDP	2015-07-15, 1,73 %, taux variable	37 926	37 901	37 958
	2020-07-15, 4,60 %	3 000	3 322	3 400
Municipal Finance Authority of British Columbia	2016-04-19, 4,65 %	2 000	2 068	2 205
	2019-06-03, 4,88 %	4 000	4 262	4 597
Municipalité régionale de York	2021-06-30, 4,00 %	1 500	1 570	1 617
Office Ontarien de Financement de l'Infrastructure Stratégique	2015-06-01, 4,60 %	3 000	3 027	3 238
Province de l'Ontario	2021-06-02, 4,00 %	9 975	10 312	11 048
	2022-06-02, 3,15 %	8 000	8 243	8 262
Province de Québec	2018-12-01, 4,50 %	5 000	5 672	5 669
	2019-12-01, 4,50 %	30 344	32 019	34 524
	2020-12-01, 4,50 %	29 670	32 488	33 825
	2021-12-01, 4,25 %	20 300	22 318	22 749
Ville de Laval	2015-03-12, 4,30 %	1 156	1 150	1 231
Ville de Montréal	2017-12-01, 5,00 %	2 500	2 552	2 817
Ville de Toronto	2018-06-27, 4,95 %	3 000	3 321	3 424
		<u>216 591</u>	<u>226 436</u>	<u>234 557</u>
Total obligations provinciales ou garanties				
Obligations d'institutions financières (20,2 %)				
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2015-04-30, 4,11 %	6 400	6 597	6 698
	2016-11-08, 2,65 %	3 500	3 494	3 535
	2017-07-14, 3,95 %	4 800	4 908	5 130
	2018-06-06, 6,00 %	2 000	2 237	2 329

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 30 juin 2012

(en milliers de dollars)

		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste valeur \$
Obligations d'institutions financières (suite)				
Banque de Montréal	2016-04-21, 5,10 %	17 050	18 070	18 604
	2016-07-08, 3,98 %	1 000	1 017	1 043
	2018-03-28, 6,17 %	6 150	7 098	7 203
Banque de Nouvelle-Écosse	2014-04-15, 4,94 %	11 000	11 482	11 550
	2017-06-08, 4,10 %	2 000	2 059	2 150
Banque Nationale du Canada	2014-12-22, 4,93 %	4 850	5 021	5 159
	2017-04-11, 3,26 %	1 100	1 103	1 112
Banque Royale du Canada	2013-11-04, 5,45 %	4 500	4 707	4 707
	2015-06-15, 4,35 %	4 000	4 025	4 197
	2019-05-07, 2,98 %	2 000	2 000	2 018
Banque Toronto Dominion	2016-12-14, 4,78 %	7 134	7 545	7 689
	2018-07-09, 5,83 %	10 400	11 454	12 056
Caisse centrale Desjardins	2014-02-11, 1,85 %, taux variable	6 500	6 476	6 508
	2017-10-05, 3,50 %	4 200	4 143	4 380
Capital Desjardins inc.	2014-04-01, 5,76 %	1 500	1 539	1 585
	2020-05-05, 5,19 %	8 750	9 246	9 798
Financière Manuvie	2019-04-08, 7,77 %	2 200	2 626	2 694
Financière Sun Life	2019-07-02, 5,70 %	2 000	2 137	2 268
	2021-08-23, 4,57 %	400	400	423
General Electric Capital Corporation	2015-01-26, 2,62 %, taux variable	2 000	2 000	2 018
Great-West Lifeco inc.	2018-03-21, 6,14 %	1 500	1 535	1 744
Placements CI inc.	2015-12-14, 3,94 %	597	612	617
RBC Trust Capital Securities	2018-06-30, 6,82 %	3 350	3 824	3 999
Société de Financement GE Capital Canada	2014-02-10, 2,14 %, taux variable	5 000	4 998	5 010
	2014-06-11, 2,20 %, taux variable	1 500	1 500	1 502
	2017-08-17, 5,53 %	5 500	5 975	6 168
Société Financière IGM Inc.	2019-04-08, 7,35 %	1 850	2 166	2 290
TD Capital Trust	2018-12-31, 7,24 %	2 000	2 337	2 455
VW Credit Canada inc.	2016-02-01, 3,60 %	390	390	406
Total obligations d'institutions financières		137 121	144 721	149 045
Obligations de sociétés (4,9 %)				
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto	2017-06-01, 4,85 %	3 255	3 412	3 638
Bell Canada	2017-02-15, 5,00 %	1 500	1 569	1 642
	2019-06-18, 3,35 %	1 000	998	1 003
	2021-05-19, 4,95 %	5 000	5 116	5 492
Fiducie d'actifs BNC	2020-06-30, 7,45 %	1 000	1 194	1 227
First Capital Realty	2015-06-01, 5,95 %	1 000	1 029	1 082
	2019-07-30, 5,48 %	1 400	1 466	1 540
Loblaw	2020-06-18, 5,22 %	3 500	3 607	3 968
Rogers Communications	2019-11-04, 5,38 %	4 600	4 887	5 166
	2021-03-22, 5,34 %	2 700	2 732	2 997
Shaw Communications	2019-10-01, 5,65 %	675	693	748
TELUS	2019-12-04, 5,05 %	6 750	7 031	7 551
Total obligations de sociétés		32 380	33 734	36 054
Total obligations		578 771	603 755	627 425

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 30 juin 2012

(en milliers de dollars)

		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste valeur \$
Instruments de marché monétaire (8,4 %)				
Province de la Colombie-Britannique	2012-08-08, sans coupon	425	425	425
Province de l'Ontario	2012-07-04, 1,09 %	4 991	4 991	4 991
	2012-08-08, sans coupon	600	599	599
	2012-09-12, sans coupon	11 005	10 983	10 983
	2013-01-16, 1,28 %	9 912	9 912	9 912
	2013-04-26, 1,12 %	15 256	15 256	15 256
Province de Québec	2013-05-24, 1,09 %	19 793	19 793	19 793
		61 982	61 959	61 959
Total instruments de marché monétaire				
Contrats de change (0,1 %)				
Caisse centrale Desjardins	2012-09-28, 1,0250 \$ CA/\$ AU ²	1 100	-	(11)
	2012-09-28, 1,0283 \$ CA/\$ US	105 200	-	849
Total contrats de change				
			-	838
			Nombre d'actions	
Actions privilégiées (6,6 %)				
Banque Canadienne Impériale de Commerce	Perpétuelle, 5,50 %	15 000	401	379
	Perpétuelle, 5,60 %	15 000	400	389
	Perpétuelle, 5,75 %	17 000	454	441
Banque de Nouvelle-Écosse	Perpétuelle, 3,72 %	30 000	754	750
	Perpétuelle, 4,50 %	12 400	309	321
	Perpétuelle, 5,25 %	16 000	412	423
	Perpétuelle, 5,60 %	170 000	4 458	4 530
	Perpétuelle, 5,85 %	6 200	165	158
Banque Nationale du Canada	Perpétuelle, 6,00 %	125 000	3 350	3 341
	Perpétuelle, 4,50 %	70 000	1 772	1 790
Banque Royale du Canada	Perpétuelle, 4,50 %	48 600	1 193	1 249
	Perpétuelle, 4,60 %	50 000	1 266	1 284
	Perpétuelle, 4,70 %	15 700	394	404
	Perpétuelle, 5,00 %	131 100	3 352	3 360
	Perpétuelle, 6,25 %	20 000	500	528
	Perpétuelle, 4,85 %	87 000	1 934	2 245
	Perpétuelle, 5,60 %	73 100	1 887	1 974
Banque Toronto Dominion	Perpétuelle, 6,25 %	40 000	1 067	1 073
	Perpétuelle, 6,25 %	30 000	801	804
	Perpétuelle, 1,63 %, taux variable	77 800	1 970	1 697
	Perpétuelle, 4,95 %	25 000	658	624
Corporation Financière Power	Perpétuelle, 5,10 %	10 000	263	251
	Perpétuelle, 5,75 %	10 000	220	254
	Perpétuelle, 6,00 %	95 000	2 528	2 422

² \$ AU : Dollar Australien

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 30 juin 2012

(en milliers de dollars)

		<u>Nombre d'actions</u>	<u>Coût \$</u>	<u>Juste valeur \$</u>
Actions privilégiées (suite)				
Corporation Power du Canada	Perpétuelle, 5,00 %	55 400	1 212	1 386
Financière Sun Life	Perpétuelle, 4,75 %	82 000	1 755	1 912
	Perpétuelle, 4,80 %	60 300	1 482	1 411
Great-West Lifeco inc.	Perpétuelle, 4,50 %	45 000	1 084	1 040
	Perpétuelle, 5,20 %	145 000	3 816	3 628
	Perpétuelle, 6,00 %	30 000	737	783
Industrielle Alliance	Perpétuelle, 4,60 %	15 000	243	345
	Perpétuelle, 5,90 %	155 000	3 981	3 984
	Perpétuelle, 6,00 %	135 300	3 347	3 481
	Perpétuelle, 6,20 %	16 700	415	430
Total actions privilégiées			<u>48 581</u>	<u>49 092</u>
Total autres investissements (100,0 %)			<u>714 295</u>	<u>739 314</u>