

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements
Au 31 décembre 2011

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 31 décembre 2011

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Valeur du marché \$
Obligations (84,2%)				
Obligations fédérales et garanties (28,2%)				
Fiducie du Canada pour l'habitation	2016-06-15, 2,75 %	7 669	7 714	8 073
	2018-12-15, 4,10 %	25 100	26 552	28 497
	2020-12-15, 3,35 %	42 419	42 701	45 849
	2021-06-15, 3,80 %	27 635	29 206	30 894
Gouvernement du Canada	2014-02-01, 6,00 %	11 700	11 739	11 711
LNH Banque Toronto Dominion ¹	2014-04-01, 2,15 %	5 348	5 405	5 428
	2014-09-01, 2,60 %	19 048	19 480	19 470
	2015-09-01, 1,95 %	17 786	17 911	17 914
PSP Capital inc.	2013-12-09, 4,57 %	3 000	3 072	3 175
Société canadienne d'hypothèques et de logement	2016-02-01, 4,25 %	4 700	4 798	5 217
	2017-02-01, 4,35 %	10 500	10 981	11 869
Total obligations fédérales et garanties		174 905	179 559	188 097
Obligations provinciales et garanties (30,5%)				
Cadillac Fairview Finance Trust	2016-01-25, 3,24 %	5 500	5 533	5 742
	2018-05-09, 3,64 %	3 000	3 141	3 166
Financement Québec	2015-12-01, 4,25 %	1 130	1 176	1 243
	2016-12-01, 3,50 %	6 920	7 044	7 452
	2017-12-01, 3,50 %	17 800	18 088	19 143
Financière CDP	2015-07-15, 1,73 %, taux variable	31 550	31 537	31 509
Hydro-Québec	2015-02-11, 1,39 %	22 000	21 915	21 930
Municipal Finance Authority of British Columbia	2016-04-19, 4,65 %	2 000	2 078	2 235
	2019-06-03, 4,88 %	4 000	4 278	4 605
Municipalité régionale de York	2021-06-30, 4,00 %	1 500	1 573	1 605
Office Ontarien de Financement de l'Infrastructure Stratégique	2015-06-01, 4,60 %	3 000	3 031	3 287
Province de l'Ontario	2017-03-08, 4,30 %	2 475	2 652	2 771
	2021-06-02, 4,00 %	7 500	7 654	8 241
Province de Québec	2018-12-01, 4,50 %	10 000	10 515	11 364
	2019-12-01, 4,50 %	28 544	30 103	32 422
	2020-12-01, 4,50 %	27 470	29 800	31 137
	2021-12-01, 4,25 %	8 500	9 167	9 451
Ville de Laval	2015-03-12, 4,30 %	1 156	1 149	1 246
Ville de Montréal	2017-12-01, 5,00 %	2 500	2 556	2 839
Ville de Toronto	2018-06-27, 4,95 %	2 000	2 191	2 296
Total obligations provinciales et garanties		188 545	195 181	203 684

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 2011

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Valeur du marché \$
Obligations d'institutions financières (20,5%)				
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2015-04-30, 4,11 %	6 400	6 630	6 701
	2016-11-08, 2,65 %	3 500	3 493	3 522
	2017-07-14, 3,95 %	4 800	4 918	5 112
	2018-06-06, 6,00 %	2 000	2 254	2 316
Banque de Montréal	2016-04-21, 5,10 %	12 050	12 693	13 161
	2016-07-08, 3,98 %	1 000	1 020	1 037
	2018-05-02, 6,02 %	6 150	6 954	7 273
Banque de Nouvelle-Écosse	2013-03-27, 4,99 %	4 480	4 588	4 640
	2014-04-15, 4,94 %	5 500	5 765	5 823
	2017-06-08, 4,10 %	2 000	2 065	2 146
Banque Nationale du Canada	2014-12-22, 4,93 %	3 100	3 170	3 317
	2016-04-26, 3,58 %	700	718	731
Banque Royale du Canada	2013-11-04, 5,45 %	7 500	7 972	7 954
	2015-06-15, 4,35 %	4 000	4 028	4 191
	2017-01-25, 3,66 %	3 400	3 447	3 575
Banque Toronto Dominion	2013-06-03, 5,69 %	2 900	3 000	3 048
	2016-12-14, 4,78 %	1 234	1 264	1 317
	2018-07-09, 5,83 %	10 400	11 530	11 982
Caisse centrale Desjardins	2014-02-11, 1,80 %	11 500	11 443	11 466
	2017-10-05, 3,50 %	4 200	4 138	4 344
Capital Desjardins inc.	2014-04-01, 5,76 %	1 500	1 550	1 602
	2020-05-05, 5,19 %	7 750	8 152	8 353
Financière Manuvie	2019-04-08, 7,77 %	2 200	2 652	2 615
Financière Sun Life	2018-01-30, 5,59 %	1 000	1 001	1 059
	2019-07-02, 5,70 %	2 000	2 146	2 173
	2021-08-23, 4,57 %	400	400	399
Great-West Lifeco inc.	2018-03-21, 6,14 %	1 500	1 538	1 714
Placements CI inc.	2015-12-14, 3,94 %	597	614	616
RBC Trust Capital Securities	2018-06-30, 6,82 %	3 350	3 858	3 916
Société de Financement GE Capital Canada	2017-08-17, 5,53 %	5 500	6 016	6 089
Société Financière IGM Inc.	2019-04-08, 7,35 %	1 850	2 185	2 240
TD Capital Trust	2018-12-31, 7,24 %	2 000	2 360	2 389
VW Credit Canada inc.	2016-02-01, 3,60 %	390	390	401
Total obligations d'institutions financières		126 851	133 952	137 222
Obligations de sociétés (5,0%)				
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto	2017-06-01, 4,85 %	3 255	3 426	3 647
Bell Canada	2017-02-15, 5,00 %	1 500	1 575	1 641
	2021-05-19, 4,95 %	5 000	5 121	5 418
British Columbia Ferry Services Inc.	2014-05-27, 5,74 %	100	103	109
Fiducie d'actifs BNC	2020-06-30, 7,45 %	1 000	1 204	1 179
First Capital Realty	2015-06-01, 5,95 %	1 000	1 034	1 077
	2019-07-30, 5,48 %	800	813	839
Hydro Ottawa	2015-02-09, 4,93 %	115	116	125
Loblaw	2020-06-18, 5,22 %	3 500	3 612	3 810

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 31 décembre 2011

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Valeur du marché \$
Obligations de sociétés (suite)				
Nova Scotia Power	2013-10-01, 5,75 %	800	812	854
Rogers Communications	2019-11-04, 5,38 %	3 000	3 094	3 309
	2021-03-22, 5,34 %	2 700	2 733	2 931
Shaw Communications	2019-10-01, 5,65 %	675	694	738
TELUS	2019-12-04, 5,05 %	5 250	5 363	5,778
Thompson Reuters Corporation	2015-07-15, 5,70 %	1 500	1 594	1 671
Total obligations de sociétés		30 195	31 294	33,126
Total obligations		520 496	539,986	562,129
Instruments de marché monétaire (9,5%)				
Caisse centrale Desjardins	2012-01-12, 1,09 %	9 973	9 973	9 973
Province de Québec	2012-01-20, sans coupon	3,200	3,198	3,198
	2012-02-16, 1,00 %	26 889	26 889	26 889
	2012-05-25, 1,23 %	8 906	8 906	8 906
Société de transport de Montréal	2012-01-16, 1,07 %	14 389	14 389	14 389
Total instruments de marché monétaire		63 357	63 355	63 355
Contrats de change (0,0%)				
Caisse centrale Desjardins	2012-03-30, 1,0251 \$ CA/\$ AU ²	1 100 \$ AU	s.o.	(10)
	2012-03-30, 1,0211 \$ CA/\$ US	153 600 \$ US	s.o.	306
Couverture d'investissements à impact économique québécois				
Total contrats de change				296
Actions privilégiées (6,3%)				
Banque Canadienne Impériale de Commerce	Perpétuelle, 4,70 %	50 700	1 282	1 315
	Perpétuelle, 5,50 %	15 000	401	384
	Perpétuelle, 5,60 %	15 000	400	381
	Perpétuelle, 5,75 %	17 000	454	434
Banque de Nouvelle-Écosse	Perpétuelle, 4,50 %	12 400	309	319
	Perpétuelle, 5,25 %	16 000	412	422
	Perpétuelle, 5,60 %	170 000	4 458	4 544
Banque Nationale du Canada	Perpétuelle, 5,85 %	6 200	165	161
	Perpétuelle, 6,00 %	125 000	3 350	3 398
Banque Royale du Canada	Perpétuelle, 4,50 %	50 000	1 260	1 293
	Perpétuelle, 4,50 %	48 600	1 193	1 248
	Perpétuelle, 4,60 %	25 000	622	646
	Perpétuelle, 4,70 %	15 700	394	408
	Perpétuelle, 6,25 %	20 000	500	543

² \$ AU: Dollar Australien

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 31 décembre 2011

(en milliers de dollars)

Description		Nombre d'actions	Coût \$	Valeur du marché \$
Actions privilégiées (suite)				
Banque Toronto Dominion	Perpétuelle, 4,85 %	87 000	1 934	2 282
	Perpétuelle, 5,60 %	73 100	1 887	1 987
Corporation Financière Power	Perpétuelle, 1,63 %, taux variable	77 800	1 970	1 509
	Perpétuelle, 4,95 %	25 000	658	610
	Perpétuelle, 5,10 %	10 000	263	252
	Perpétuelle, 5,75 %	10 000	220	254
	Perpétuelle, 6,00 %	95 000	2 528	2 460
Corporation Power du Canada	Perpétuelle, 5,00 %	55 400	1 212	1 355
Financière Sun Life	Perpétuelle, 4,75 %	82 000	1 755	1 810
	Perpétuelle, 4,80 %	60 300	1 482	1 339
Great-West Lifeco inc.	Perpétuelle, 5,20 %	145 000	3 816	3 640
	Perpétuelle, 6,00 %	30 000	737	798
Industrielle Alliance	Perpétuelle, 4,60 %	15 000	243	350
	Perpétuelle, 5,90 %	155 000	3 981	3 991
	Perpétuelle, 6,00 %	135 300	3 347	3 518
	Perpétuelle, 6,20 %	16 700	415	442
Total actions privilégiées			41 648	42 093
Total autres investissements (100,0 %)			644 989	667 873