

## **Capital régional et coopératif Desjardins**

Relevé des autres investissements  
**Au 31 décembre 2016**

# Capital régional et coopératif Desjardins

## Relevé des autres investissements (non audité)

Au 31 décembre 2016

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
<b>Obligations (69,8 %)</b>				
<b>Obligations fédérales et garanties (30,1 %)</b>				
Fiducie du Canada pour l'habitation	2025-12-15, 1,95 %	625	610	615
	2025-12-15, 2,25 %	35 000	35 878	35 295
	2026-09-15, 1,90 %	32 985	32 359	32 072
Gouvernement du Canada	2022-03-01, 0,50 %	26 000	25 602	25 095
	2026-06-01, 1,50 %	18 125	17 777	17 782
	2027-06-01, 1,00 %	22 900	21 193	21 094
LNH Banque Laurentienne du Canada <sup>1</sup>	2021-10-01, 1,30 %	11 898	11 786	11 689
LNH Merrill Lynch Canada inc. <sup>1</sup>	2019-09-01, 1,85 %	959	967	969
	2020-05-01, 1,35 %	20 980	20 907	20 902
	2020-12-01, 1,25 %	24 717	24 658	24 473
	2021-03-01, 1,25 %	39 176	39 000	38 707
	2021-08-01, 1,30 %	8 851	8 794	8 727
	2021-11-01, 1,37 %	9 468	9 362	9 343
PSP Capital	2024-04-04, 3,29 %	3 150	3 235	3 358
<b>Total obligations fédérales et garanties</b>		<b>254 834</b>	<b>252 128</b>	<b>250 121</b>
<b>Obligations provinciales, municipales ou garanties (19,1 %)</b>				
Hydro-Québec	2023-02-15, 2,21 %	20 000	17 488	17 424
	2023-08-15, 2,28 %	10 000	8 604	8 547
	2024-02-15, 2,28 %	48 800	41 525	40 886
	2024-08-15, 2,02 %	14 040	12 046	11 541
Municipal Finance Authority of British Columbia	2021-06-01, 4,15 %	2 000	2 106	2 198
	2024-10-14, 2,95 %	2 000	2 114	2 063
	2025-10-02, 2,65 %	3 000	3 007	3 002
Municipalité régionale de York	2021-06-30, 4,00 %	1 500	1 537	1 637
OPB Finance	2022-02-24, 1,88 %	3 650	3 600	3 621
	2026-02-02, 2,95 %	2 000	1 999	2 023
Province de la Nouvelle-Écosse	2025-06-01, 2,15 %	2 500	2 426	2 431
Province de l'Alberta	2026-06-01, 2,20 %	26 700	26 477	25 917
Province de l'Ontario	2018-12-03, 1,05 %	845	845	848
	2022-12-02, 1,98 %	21 800	19 400	19 181
	2025-06-02, 2,53 %	6 000	4 853	4 806
Province de Québec	2024-06-01, 2,46 %	3 000	2 503	2 488
	2026-09-01, 2,50 %	4 000	3 977	3 994
Province du Nouveau-Brunswick	2023-06-02, 2,85 %	600	590	625
Ville de Montréal	2025-09-01, 3,00 %	2 500	2 511	2 544
Ville de Toronto	2018-06-27, 4,95 %	3 000	3 085	3 167
<b>Total obligations provinciales, municipales ou garanties</b>		<b>177 935</b>	<b>160 693</b>	<b>158 943</b>
<b>Obligations d'institutions financières (13,2 %)</b>				
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2018-06-06, 6,00 %	2 000	2 062	2 121
	2020-07-14, 1,85 %	2 155	2 152	2 160
Banque de Montréal	2021-10-28, 1,61 %	5 000	4 974	4 901
	2022-03-16, 2,12 %	5 300	5 278	5 294

<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 31 décembre 2016

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
<b>Obligations d'institutions financières (suite)</b>				
Banque Nationale du Canada	2020-03-03, 1,74 %	1 300	1 300	1 300
Banque Royale du Canada	2018-12-11, 2,77 %	2 800	2 859	2 871
	2019-04-26, 1,40 %	8 500	8 509	8 496
	2020-07-17, 1,92 %	3 350	3 349	3 363
	2022-03-02, 1,97 %	1 900	1 900	1 880
	2023-12-05, 2,33 %	2 500	2 500	2 480
Banque Scotia	2018-03-22, 2,24 %	75	75	76
	2018-05-01, 1,33 %	9 179	9 178	9 188
	2021-12-02, 1,90 %	1 700	1 700	1 686
	2026-12-02, 2,62 %	1 400	1 400	1 384
Banque Toronto-Dominion	2018-07-09, 5,83 %	4 000	4 138	4 247
	2021-06-08, 1,68 %	3 600	3 604	3 572
	2021-12-22, 2,62 %	6 000	6 101	6 159
	2023-07-18, 1,91 %	1 800	1 801	1 750
Caisse centrale Desjardins	2020-03-02, 1,75 %	5 400	5 376	5 401
CI Financial	2021-10-25, 2,78 %	1 700	1 700	1 698
Compagnie d'Assurance-Vie Manufacturers	2018-11-29, 2,93 %	400	400	406
	2019-02-21, 2,81 %	2 500	2 539	2 539
Crédit Ford du Canada	2020-05-07, 2,45 %	2 950	2 946	2 944
Crombie Real Estate Investment Trust	2021-06-01, 3,96 %	160	161	162
Fiducie d'actifs BNC	2020-06-30, 7,45 %	250	273	287
Fiducie de placement immobilier Canadian Tire	2025-03-09, 3,53 %	900	900	902
	2026-03-01, 3,29 %	1 000	1 000	968
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix	2021-02-08, 3,50 %	2 000	2 071	2 084
	2022-06-20, 3,60 %	1 175	1 201	1 222
Financière Manuvie	2019-04-08, 7,77 %	2 200	2 357	2 480
Financière Sun Life	2019-07-02, 5,70 %	1 000	1 027	1 098
	2021-08-23, 4,57 %	400	400	442
First Capital Realty	2023-10-30, 3,90 %	1 700	1 728	1 773
Fonds de placement immobilier Cominar	2019-06-21, 3,62 %	1 725	1 739	1 755
Fonds de placement immobilier Riocan	2022-05-30, 3,75 %	775	775	808
Granite Real Estate Investment Trust	2023-09-30, 3,87 %	1 000	1 000	1 001
Great-West Lifeco	2018-03-21, 6,14 %	1 500	1 508	1 584
Industrielle Alliance, Assurance et services financiers	2022-02-23, 2,64 %	300	300	297
Intact Financial Corporation	2021-08-18, 4,70 %	1 000	1 082	1 111
John Deere Canada Funding	2020-07-13, 1,60 %	2 250	2 247	2 230
	2020-09-17, 2,05 %	750	757	754
RBC Trust Capital Securities	2018-06-30, 6,82 %	1 000	1 041	1 072
Société Financière Daimler Canada	2018-03-26, 2,27 %	385	385	389
	2018-10-02, 1,42 %	4 600	4 590	4 590
Société Financière IGM	2019-04-08, 7,35 %	1 850	1 966	2 070
Toyota Credit Canada	2020-02-19, 1,80 %	2 450	2 450	2 452
	2020-05-20, 2,05 %	1 400	1 400	1 410
	2021-07-21, 1,75 %	700	699	690
<b>Total obligations d'institutions financières</b>		<b>107 979</b>	<b>108 898</b>	<b>109 547</b>
<b>Obligations de sociétés (7,4 %)</b>				
Algonquin Power & Utilities Corp.	2022-02-15, 4,65 %	750	776	796
Alimentation Couche-Tard	2025-03-02, 3,60 %	1 625	1 625	1 662
Alliance Pipeline	2019-12-16, 4,93 %	1 000	1 044	1 050

# Capital régional et coopératif Desjardins

## Relevé des autres investissements (non audité)

Au 31 décembre 2016

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
<b>Obligations de sociétés (suite)</b>				
AltaGas	2024-10-15, 3,84 %	1 000	1 043	1 036
	2026-01-07, 4,12 %	300	300	313
AltaLink	2023-11-06, 3,67 %	1 000	1 024	1 086
	2026-02-28, 2,75 %	1 625	1 634	1 618
Bell Canada	2022-09-03, 3,00 %	3 200	3 192	3 282
	2022-12-22, 3,35 %	2 700	2 855	2 807
	2026-05-12, 2,90 %	3 000	2 960	2 895
BMW Canada	2018-11-26, 2,27 %	2 000	2 016	2 028
	2021-06-15, 1,83 %	400	400	396
Brookfield Asset Management	2023-03-31, 4,54 %	1 053	1 071	1 132
	2023-12-08, 5,04 %	1 700	1 699	1 869
Brookfield Renewable Energy	2025-03-02, 3,75 %	750	750	757
BRP Finance	2018-11-05, 5,25 %	2 425	2 545	2 570
Bruce Power LP	2021-06-23, 2,84 %	300	300	304
Canadian Natural Resources	2020-08-14, 2,89 %	2 000	2 027	2 024
Canadian Utilities	2022-11-09, 3,12 %	775	754	817
Compagnies Loblaw	2023-06-12, 4,86 %	2 200	2 384	2 462
Dollorama	2018-11-05, 3,10 %	220	222	225
Enbridge	2019-02-22, 4,10 %	1 000	1 022	1 046
	2019-09-02, 4,77 %	60	63	64
	2022-12-05, 3,19 %	400	389	410
Enbridge Gas Distribution	2026-05-05, 2,50 %	1 250	1 259	1 212
Enbridge Pipelines	2026-05-10, 3,00 %	1 500	1 487	1 481
Energcare Solutions	2020-02-03, 4,60 %	400	419	419
Fortis	2023-10-12, 2,85 %	1 030	1 030	1 029
FortisAlberta	2024-06-30, 3,30 %	250	250	261
Hydro One	2019-11-18, 1,48 %	500	500	499
	2020-04-30, 1,62 %	2 000	1 992	1 998
	2021-02-24, 1,84 %	600	600	601
Inter Pipeline	2023-07-13, 2,61 %	125	125	123
	2024-12-24, 3,17 %	1 000	1 000	1 005
Lower Mattagami Energy	2021-05-18, 4,33 %	300	316	330
Magna International Inc.	2022-11-15, 3,10 %	1 000	1 000	1 023
North West Redwater Partnership	2022-01-23, 2,10 %	1 000	985	997
Pembina Pipeline Corporation	2022-10-24, 3,77 %	900	915	942
	2026-05-11, 3,71 %	250	250	251
Reliance	2019-03-15, 5,19 %	1 600	1 661	1 666
	2020-09-15, 3,81 %	700	702	702
Rogers Communications	2023-12-13, 4,00 %	800	797	860
Saputo	2023-09-21, 2,83 %	1 500	1 500	1 498
Sobeys	2018-08-08, 3,52 %	400	402	404
Superior Plus	2017-12-09, 6,50 %	1 000	1 049	1 045
TELUS Corporation	2022-02-28, 2,35 %	4 750	4 725	4 715
	2024-01-02, 3,35 %	1 000	1 016	1 024
Teranet Income Fund	2020-12-16, 4,81 %	550	587	594
Toronto Hydro Corporation	2023-01-10, 2,91 %	1 000	1 022	1 036
TransAlta	2019-11-18, 6,40 %	250	250	266
	2020-11-25, 5,00 %	500	504	513
Videotron	2025-03-15, 5,63 %	1 950	1 934	2 004

# Capital régional et coopératif Desjardins

## Relevé des autres investissements (non audité)

Au 31 décembre 2016

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
<b>Obligations de sociétés (suite)</b>				
West Coast Energy Inc.	2025-09-08, 3,77 %	559	560	578
<b>Total obligations de sociétés</b>		<b>60 147</b>	<b>60 932</b>	<b>61 725</b>
<b>Total obligations</b>		<b>600 895</b>	<b>582 651</b>	<b>580 336</b>
<b>Instruments de marché monétaire (2,7 %)</b>				
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2017-07-06, 1,05 %	900	896	896
	2017-11-17, 1,02 %	1 000	991	991
Banque de Montréal	2017-05-15, 0,93 %	900	898	898
	2017-05-31, 0,88 %	1 000	996	996
Banque Nationale du Canada	2017-01-27, 0,76 %	1 000	999	999
	2017-03-30, 0,81 %	900	898	898
Banque Royale du Canada	2017-05-01, 0,89 %	552	550	550
	2017-09-08, 0,95 %	1 200	1 192	1 192
Banque Scotia	2017-06-07, 0,95 %	800	797	797
	2017-08-14, 0,97 %	1 100	1 093	1 093
Banque Toronto-Dominion	2017-11-06, 1,03 %	1 900	1 883	1 883
Gaz Métro	2017-03-14, 0,84 %	1 900	1 897	1 897
Gouvernement du Canada	2017-01-04, 0,50 %	3 200	3 200	3 200
Honda Canada Finance	2017-05-03, 0,87 %	1 500	1 495	1 495
Province de l'Ontario	2017-12-06, 0,74 %	600	596	596
Société de transport de Montréal	2017-04-17, 0,90 %	1 900	1 895	1 895
Toyota Credit Canada	2017-05-16, 1,03 %	1 900	1 893	1 893
<b>Total instruments de marché monétaire</b>		<b>22 252</b>	<b>22 169</b>	<b>22 169</b>
<b>Contrats de change (0,0 %)</b>				
Caisse centrale Desjardins	2017-03-31, 1,3360 \$ CA/\$ US	82 300	0	- 433
<b>Total contrats de change</b>		<b>82 300</b>	<b>0</b>	<b>- 433</b>
<b>Nombre de parts</b>				
<b>Fonds d'actions mondiales (12,6 %)</b>				
Fonds Desjardins IBrix Actions mondiales à faible volatilité cat. I		4 641	51 797	53 100
Fonds Desjardins Mondial de dividendes cat. I		2 692	50 743	51 986
<b>Total fonds d'actions mondiales</b>			<b>102 540</b>	<b>105 086</b>
<b>Nombre de parts</b>				
<b>Fonds immobilier (7,7 %)</b>				
Fonds CORE Fiera Immobilier		21	22 427	23 145
Fonds immobilier canadien de prestige Bentall Kennedy		5 402	40 125	40 973
<b>Total fonds immobilier</b>			<b>62 552</b>	<b>64 118</b>

# Capital régional et coopératif Desjardins

## Relevé des autres investissements (non audité)

Au 31 décembre 2016

(en milliers de dollars)

Description		Nombre d'actions	Coût \$	Juste Valeur \$
<b>Actions privilégiées (7,2 %)</b>				
Banque de Montréal	Perpétuelle, 3,39 %	173 400	4 439	4 295
Banque Nationale du Canada	Perpétuelle, 3,80 %	25 000	606	616
Banque Royale du Canada	Perpétuelle, 3,52 %	131 100	3 352	3 251
	Perpétuelle, 4,45 %	61 000	1 562	1 534
	Perpétuelle, 4,50 %	118 600	2 965	2 980
	Perpétuelle, 4,60 %	92 100	2 346	2 317
	Perpétuelle, 4,70 %	15 700	394	396
	Perpétuelle, 5,50 %	30 000	750	808
Banque Scotia	Perpétuelle, 2,06 %	130 000	3 267	2 724
	Perpétuelle, 3,61 %	50 000	1 270	1 227
	Perpétuelle, 5,25 %	16 000	412	400
	Perpétuelle, 5,60 %	170 000	4 458	4 296
Banque Toronto-Dominion	Perpétuelle, 3,60 %	40 000	963	892
	Perpétuelle, 3,70 %	2 100	41	48
	Perpétuelle, 3,75 %	93 600	2 200	1 814
	Perpétuelle, 4,90 %	50 000	1 123	1 240
Brookfield Asset Management	Perpétuelle, 4,40 %	30 000	480	619
	Perpétuelle, 4,50 %	112 860	2 890	2 457
	Perpétuelle, 4,75 %	23 800	466	507
	Perpétuelle, 4,80 %	20 000	519	413
Canadian Utilities	Perpétuelle, 4,50 %	50 000	1 245	1 356
	Perpétuelle, 4,90 %	40 000	1 018	934
Corporation Financière Power	Perpétuelle, 2,70 %	77 800	1 970	949
	Perpétuelle, 4,20 %	29 700	757	621
	Perpétuelle, 6,00 %	95 000	2 528	2 447
Financière Manuvie	Perpétuelle, 2,18 %	107 500	2 746	1 537
	Perpétuelle, 3,90 %	56 300	1 274	1 126
	Perpétuelle, 4,00 %	9 100	225	196
	Perpétuelle, 4,40 %	13 300	354	299
	Perpétuelle, 4,50 %	35 900	867	777
	Perpétuelle, 4,60 %	36 300	761	864
	Perpétuelle, 5,60 %	15 000	375	404
Financière Sun Life	Perpétuelle, 4,45 %	10 000	223	214
	Perpétuelle, 4,50 %	25 000	565	535
	Perpétuelle, 4,75 %	137 500	3 050	3 128
	Perpétuelle, 4,80 %	60 300	1 482	1 380
Fortis	Perpétuelle, 3,88 %	6 300	138	118
	Perpétuelle, 4,75 %	52 300	1 132	1 183
Great-West Lifeco	Perpétuelle, 2,18 %	40 000	629	572
	Perpétuelle, 4,50 %	45 000	1 084	969
	Perpétuelle, 4,85 %	50 000	1 185	1 134
Husky Energy	Perpétuelle, 4,60 %	100 000	2 471	2 295
Industrielle Alliance, Assurance et services financiers	Perpétuelle, 4,60 %	15 000	243	330
Intact Financial Corporation	Perpétuelle, 3,33 %	45 600	1 119	962
TransCanada	Perpétuelle, 3,80 %	47 200	862	1 038
	Perpétuelle, 4,25 %	83 600	1 607	1 652
<b>Total actions privilégiées</b>			<b>64 413</b>	<b>59 854</b>
<b>Total autres investissements (100,0 %)</b>			<b>834 325</b>	<b>831 130</b>