

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements
Au 31 décembre 2013

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 31 décembre 2013

(en milliers de dollars)

		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste valeur \$
Obligations (87,9 %)				
Obligations fédérales et garanties (26,1 %)				
Fiducie du Canada pour l'habitation	2020-12-15, 3,35 %	17 169	17 816	17 911
	2021-06-15, 3,80 %	21 335	23 153	22 793
	2022-12-15, 2,40 %	7 900	7 638	7 478
	2023-09-15, 2,35 %	2 500	2 341	2 325
	2023-09-15, 3,15 %	5 950	5 899	5 930
LNH Banque de Montréal ¹	2017-09-01, 2,10 %	13 537	13 523	13 630
LNH Banque de Nouvelle-Écosse ¹	2016-04-01, 4,05 %	12 643	12 952	13 308
LNH Banque Toronto Dominion ¹	2015-09-01, 1,95 %	29 867	29 981	30 094
	2016-06-01, 0,65 %	7 969	7 878	7 843
	2017-08-01, 1,70 %	27 557	27 412	27 472
	2018-03-01, 1,40 %	3 333	3 288	3 262
	2018-04-01, 1,65 %	20 039	19 684	19 767
PSP Capital	2017-02-16, 2,26 %	250	251	253
	2020-10-22, 3,03 %	800	800	801
Société canadienne d'hypothèques et de logement	2017-02-01, 4,35 %	10 500	10 802	11 386
Total obligations fédérales et garanties		181 349	183 418	184 253
Obligations provinciales, municipales ou garanties (31,2 %)				
Cadillac Fairview Finance Trust	2016-01-25, 3,24 %	4 150	4 192	4 293
	2018-05-09, 3,64 %	5 000	5 183	5 246
Financement-Québec	2017-12-01, 3,50 %	33 955	35 478	35 772
	2018-12-01, 2,40 %	20 000	19 916	19 949
	2019-12-01, 2,45 %	21 986	21 925	21 648
Financière CDP	2015-07-15, 1,73 %	11 000	11 004	11 042
	2020-07-15, 4,60 %	3 000	3 267	3 265
Municipal Finance Authority of British Columbia	2016-04-19, 4,65 %	2 000	2 037	2 144
	2019-06-03, 4,88 %	4 000	4 211	4 445
	2021-06-01, 4,15 %	2 000	2 170	2 124
	2022-06-01, 3,35 %	1 100	1 099	1 089
Municipalité régionale de York	2021-06-30, 4,00 %	1 500	1 559	1 566
Office Ontarien de Financement de l'Infrastructure Stratégique	2015-06-01, 4,60 %	3 000	3 013	3 132
Province de l'Ontario	2018-05-30, 1,40 %	24 450	24 455	24 450
	2022-06-02, 3,15 %	16 050	16 344	15 792
	2023-06-02, 2,85 %	8 450	8 138	7 985
Province de Québec	2020-12-01, 4,50 %	10 170	10 982	11 143
	2021-12-01, 4,25 %	13 025	14 365	13 916
	2022-12-01, 3,50 %	13 025	13 126	13 023
	2023-09-01, 3,00 %	10 300	9 782	9 764
Province du Manitoba	2023-06-02, 2,55 %	2 000	1 934	1 853
Ville de Laval	2015-03-12, 4,30 %	1 156	1 153	1 190
Ville de Montréal	2017-12-01, 5,00 %	2 500	2 539	2 742

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 2013

(en milliers de dollars)

		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste valeur \$
Obligations provinciales, municipales ou garanties (suite)				
Ville de Toronto	2018-06-27, 4,95 %	3 000	3 246	3 315
Total obligations provinciales, municipales ou garanties				
		216 817	221 118	220 888
Obligations d'institutions financières (23,1 %)				
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2016-11-08, 2,65 %	3 500	3 496	3 562
	2017-07-14, 3,95 %	4 800	4 877	5 072
	2018-03-07, 2,22 %	1 750	1 732	1 723
	2018-06-06, 6,00 %	2 000	2 182	2 256
Banque de Montréal	2016-07-08, 3,98 %	6 200	6 423	6 469
	2017-12-11, 2,24 %	7 000	6 848	6 926
	2018-03-28, 6,17 %	5 450	6 087	6 161
Banque de Nouvelle-Écosse	2016-11-08, 2,10 %	3 500	3 499	3 509
	2017-08-03, 2,90 %	18 850	19 044	19 064
	2018-03-22, 2,24 %	75	74	74
	2019-10-18, 3,04 %	2 500	2 500	2 469
Banque Nationale du Canada	2016-01-11, 2,05 %	250	250	251
	2016-12-15, 2,70 %	5 000	5 044	5 091
	2017-04-11, 3,26 %	1 100	1 102	1 127
Banque Royale du Canada	2015-11-02, 3,18 %	7 500	7 666	7 660
	2018-07-12, 2,82 %	7 600	7 592	7 643
	2019-12-06, 2,99 %	2 000	2 041	1 968
Banque Toronto Dominion	2016-12-14, 4,78 %	7 134	7 413	7 629
	2018-07-09, 5,83 %	9 400	10 292	10 570
BMO Capital Trust	2015-12-31, 4,63 %	2 000	2 106	2 100
Caisse centrale Desjardins	2017-10-05, 3,50 %	4 200	4 158	4 350
Capital Desjardins	2020-05-05, 5,19 %	8 750	9 164	9 623
Compagnie d'Assurance-Vie Manufacturers	2017-06-01, 4,17 %	2 000	2 117	2 106
	2018-02-26, 2,82 %	2 300	2 277	2 294
	2018-11-29, 2,93 %	400	400	396
Crédit Ford Canada	2016-11-21, 2,63 %	300	300	302
	2017-12-19, 3,32 %	950	953	964
Fiducie d'actifs BNC	2020-06-30, 7,45 %	1 000	1 163	1 203
Financière Manuvie	2019-04-08, 7,77 %	2 200	2 542	2 668
Financière Sun Life	2019-07-02, 5,70 %	2 000	2 111	2 255
	2021-08-23, 4,57 %	400	400	425
First Capital Realty	2015-06-01, 5,95 %	1 000	1 015	1 053
	2019-07-30, 5,48 %	1 400	1 454	1 520
	2023-10-30, 3,90 %	900	903	835
Great-West Lifeco	2018-03-21, 6,14 %	1 500	1 527	1 702
Honda Canada Finance	2018-06-04, 2,35 %	400	391	394
Intact Corporation Financière	2021-08-18, 4,70 %	1 000	1 129	1 060
John Deere Canadian Fund	2017-10-18, 2,25 %	750	758	745
Placements CI	2015-12-14, 3,94 %	597	606	619
RBC Trust Capital Securities	2018-06-30, 6,82 %	3 350	3 716	3 882
Société de Financement GE Capital Canada	2015-02-11, 4,65 %	4 050	4 184	4 188
	2017-08-17, 5,53 %	7 000	7 501	7 754
	2018-02-08, 4,40 %	650	707	694
Société Financière Daimler Canada	2016-04-18, 2,23 %	420	422	422
	2016-09-15, 3,28 %	3 000	3 092	3 093

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 31 décembre 2013

(en milliers de dollars)

		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste valeur \$
Obligations d'institutions financières (suite)				
Société Financière IGM	2019-04-08, 7,35 %	1 850	2 103	2 210
TD Capital Trust	2018-12-31, 7,24 %	2 000	2 268	2 375
Toyota Credit Canada	2018-11-21, 2,80 %	1 550	1 555	1 547
VW Credit Canada	2016-02-01, 3,60 %	1 600	1 645	1 657
Total obligations d'institutions financières		155 126	160 829	163 660
Obligations de sociétés (7,5 %)				
Algonquin Power Company	2021-02-15, 4,82 %	400	405	405
Alliance Pipeline Limited Partnership	2019-12-16, 4,93 %	1 000	1 084	1 062
Altalink	2023-11-06, 3,67 %	250	250	244
Bell Aliant Communications régionales	2016-09-26, 5,41 %	2 000	2 169	2 158
	2019-02-26, 5,52 %	1 200	1 324	1 312
	2020-06-12, 3,54 %	1 100	1 075	1 082
Bell Canada	2018-03-16, 4,40 %	2 000	2 116	2 111
	2019-06-18, 3,35 %	1 500	1 519	1 499
	2021-05-19, 4,95 %	3 335	3 401	3 557
	2023-03-22, 3,35 %	2 505	2 409	2 315
Brookfield Asset Management	2023-03-31, 4,54 %	53	53	52
	2023-12-08, 5,04 %	1 700	1 699	1 709
BRP Finance ULC	2018-11-05, 5,25 %	425	454	460
Cameco Corporation	2022-11-14, 3,75 %	1 000	1 000	937
Canadian Utilities	2022-11-09, 3,12 %	775	745	734
Compagnies Loblaw	2019-03-12, 3,75 %	3 900	4 000	3 978
Enbridge	2019-09-02, 4,77 %	2 000	2 248	2 165
	2022-12-05, 3,19 %	400	384	377
Hydro One	2018-10-09, 2,78 %	2 500	2 500	2 510
Lower Mattagami Energy	2021-05-18, 4,33 %	300	326	317
Pembina Pipeline Corporation	2022-10-24, 3,77 %	400	407	389
Precision Drilling Corporation	2015-03-15, 6,50 %	750	783	779
Reliance LP	2017-03-15, 4,57 %	2 000	2 000	2 087
Rogers Communications	2019-11-04, 5,38 %	5 275	5 594	5 801
	2020-09-29, 4,70 %	500	559	529
	2021-03-22, 5,34 %	2 700	2 727	2 937
Telus Corporation	2019-12-04, 5,05 %	6 750	6 981	7 343
Teranet Holdings Limited Partnership	2020-12-16, 4,81 %	1 050	1 170	1 114
Thomson Reuters Corporation	2020-09-30, 4,35 %	1 500	1 559	1 552
Tim Hortons	2023-09-01, 4,52 %	700	700	691
Videotron	2025-03-15, 5,63 %	700	677	672
Total obligations de sociétés		50 668	52 318	52 878
Total obligations		603 960	617 683	621 679
Instruments de marché monétaire (1,8 %)				
Gouvernement du Canada	2014-05-22, sans coupon	1 000	997	997
Province de l'Ontario	2014-04-09, sans coupon	700	698	698
Société de transport de Montréal	2014-01-15, 1,14 %	10 583	10 583	10 583
Total instruments de marché monétaire		12 283	12 278	12 278

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 31 décembre 2013

(en milliers de dollars)

	Valeur nominale \$	Coût \$	Juste valeur \$
Contrats de change (-0,1 %)			
Caisse centrale Desjardins	2014-03-31, 0,9441 \$ CA/\$ AU ²	140	-
	2014-03-31, 1,0623 \$ CA/\$ US	133 000	(484)

Total contrats de change

- (484)

		Nombre d'actions		
Actions privilégiées (10,4 %)				
Banque Canadienne Impériale de Commerce	Perpétuelle, 5,60 %	15 000	400	376
	Perpétuelle, 5,75 %	17 000	454	428
Banque de Montréal	Perpétuelle, 4,50 %	33 400	868	850
	Perpétuelle, 5,20 %	235 500	6 030	5 880
Banque de Nouvelle-Écosse	Perpétuelle, 3,70 %	130 000	3 268	3 107
	Perpétuelle, 4,50 %	50 200	1 289	1 281
	Perpétuelle, 5,00 %	50 000	1 270	1 264
	Perpétuelle, 5,25 %	16 000	412	416
	Perpétuelle, 5,60 %	170 000	4 458	4 493
Banque Nationale du Canada	Perpétuelle, 6,00 %	125 000	3 350	3 281
Banque Royale du Canada	Perpétuelle, 4,45 %	61 000	1 562	1 543
	Perpétuelle, 4,50 %	118 600	2 965	3 009
	Perpétuelle, 4,60 %	92 100	2 346	2 341
	Perpétuelle, 4,70 %	15 700	394	401
	Perpétuelle, 5,00 %	131 100	3 352	3 314
	Perpétuelle, 6,25 %	20 000	500	506
Banque Toronto Dominion	Perpétuelle, 4,85 %	87 000	1 934	2 214
	Perpétuelle, 5,60 %	73 100	1 887	1 919
	Perpétuelle, 6,25 %	70 000	1 868	1 792
Brookfield Asset Management	Perpétuelle, 4,20 %	35 000	838	852
	Perpétuelle, 4,75 %	23 800	466	452
	Perpétuelle, 5,00 %	10 260	258	259
Canadian Utilities	Perpétuelle, 4,50 %	70 000	1 761	1 472
	Perpétuelle, 4,90 %	40 000	1 018	918
Corporation Financière Power	Perpétuelle, 1,63 %	77 800	1 970	1 685
	Perpétuelle, 4,95 %	25 000	658	564
	Perpétuelle, 5,10 %	10 000	263	233
	Perpétuelle, 5,75 %	10 000	220	250
	Perpétuelle, 6,00 %	95 000	2 528	2 416
Corporation Power du Canada	Perpétuelle, 5,00 %	55 400	1 212	1 237
Enbridge	Perpétuelle, 4,00 %	280 000	7 258	6 623
Financière Manuvie	Perpétuelle, 2,52 %	25 400	675	656
	Perpétuelle, 4,20 %	107 500	2 746	2 345

² \$ AU: Dollar Australien

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 31 décembre 2013

(en milliers de dollars)

		<u>Nombre d'actions</u>	<u>Coût \$</u>	<u>Juste valeur \$</u>
Actions privilégiées (suite)				
Financière Sun Life	Perpétuelle, 4,75 %	82 000	1 755	1 792
	Perpétuelle, 4,80 %	60 300	1 482	1 325
Great-West Lifeco	Perpétuelle, 4,50 %	45 000	1 084	955
	Perpétuelle, 5,20 %	145 000	3 816	3 342
Industrielle Alliance	Perpétuelle, 4,60 %	15 000	243	326
	Perpétuelle, 5,90 %	155 000	3 981	3 925
	Perpétuelle, 6,00 %	135 300	3 347	3 481
Total actions privilégiées			<u>76 186</u>	<u>73 523</u>
Total autres investissements (100,0 %)			<u>706 147</u>	<u>706 996</u>