

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements
Au 30 juin 2015
(en milliers de dollars canadiens)

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 30 juin 2015

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste valeur \$
Obligations (85,0 %)				
Obligations fédérales et garanties (41,2 %)				
Fiducie du Canada pour l'habitation	2019-12-15, 2,00 %	18 600	19 250	19 276
	2020-12-15, 3,35 %	14 000	15 275	15 456
	2022-03-15, 2,65 %	9 000	9 459	9 579
	2022-12-15, 2,40 %	21 350	21 736	22 280
	2023-09-15, 2,35 %	21 260	22 271	21 945
	2024-06-15, 2,90 %	19 500	20 790	20 851
Gouvernement du Canada	2023-06-01, 1,50 %	5 000	4 975	5 008
	2025-06-01, 2,25 %	18 400	19 129	19 342
LNH Banque de Montréal ¹	2017-09-01, 2,10 %	10 857	10 853	11 075
LNH Banque Toronto Dominion ¹	2017-08-01, 1,70 %	23 573	23 529	23 852
	2018-03-01, 1,40 %	19 714	19 679	19 871
	2018-04-01, 1,65 %	78 133	78 150	79 227
LNH Merrill Lynch Canada inc. ¹	2019-09-01, 1,85 %	30 427	30 931	31 057
	2020-05-01, 1,35 %	25 414	25 235	25 383
PSP Capital	2020-10-22, 3,03 %	4 550	4 857	4 897
	2024-04-04, 3,29 %	7 150	7 378	7 681
Total obligations fédérales et garanties		326 928	333 497	336 780
Obligations provinciales, municipales ou garanties (17,3 %)				
Cadillac Fairview Finance Trust	2018-05-09, 3,64 %	7 175	7 516	7 695
	2021-01-25, 4,31 %	1 200	1 299	1 367
Financière CDP	2020-07-15, 4,60 %	3 000	3 211	3 430
Municipal Finance Authority of British Columbia	2019-06-02, 2,05 %	2 000	2 068	2 058
	2020-06-01, 4,45 %	4 000	4 402	4 549
	2021-06-01, 4,15 %	2 000	2 139	2 264
	2022-06-01, 3,35 %	1 100	1 099	1 192
	2024-10-14, 2,95 %	2 000	2 133	2 072
Municipalité régionale de York	2021-06-30, 4,00 %	1 500	1 549	1 681
OPB Finance Trust	2022-02-24, 1,88 %	650	650	645
	2023-05-24, 2,90 %	3 750	3 754	3 877
Province de l'Ontario	2022-06-02, 3,15 %	25 750	26 400	27 772
	2023-06-02, 2,85 %	18 429	18 736	19 332
Province de Québec	2021-12-01, 4,25 %	15 865	17 319	18 230
	2022-12-01, 3,50 %	33 250	36 661	36 612
Province du Manitoba	2023-06-02, 2,55 %	2 000	1 943	2 050
Province du Nouveau-Brunswick	2023-06-02, 2,85 %	600	587	625
Ville de Montréal	2017-12-01, 5,00 %	2 500	2 525	2 731
Ville de Toronto	2018-06-27, 4,95 %	3 000	3 167	3 334
Total obligations provinciales, municipales ou garanties		129 769	137 158	141 516
Obligations d'institutions financières (18,8 %)				
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2016-06-14, 1,12 %	1 000	1 000	1 001
	2018-06-06, 6,00 %	2 000	2 124	2 248
Banque de Montréal	2017-07-12, 2,39 %	6 800	6 934	6 955
	2018-03-28, 6,17 %	4 000	4 312	4 485
	2022-03-16, 2,12 %	4 300	4 269	4 251

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 2015

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste valeur \$
Obligations d'institutions financières (suite)				
Banque Nationale du Canada	2016-06-22, 1,13 %	1 000	1 000	991
	2016-12-15, 2,70 %	8 500	8 596	8 676
	2017-04-11, 3,26 %	1 100	1 101	1 133
	2020-03-03, 1,74 %	1 300	1 300	1 294
	2022-03-18, 2,11 %	1 200	1 200	1 182
Banque Royale du Canada	2015-11-02, 3,18 %	7 500	7 531	7 544
	2018-12-11, 2,77 %	11 300	11 693	11 778
	2022-03-02, 1,97 %	1 900	1 900	1 857
Banque Scotia	2017-08-03, 2,90 %	6 000	6 037	6 163
	2018-03-22, 2,24 %	75	74	77
	2018-05-01, 1,33 %	10 359	10 357	10 333
Banque Toronto Dominion	2016-12-14, 4,78 %	7 134	7 275	7 456
	2018-04-02, 2,17 %	5 000	5 063	5 110
	2018-07-09, 5,83 %	4 000	4 263	4 489
	2020-06-24, 2,69 %	2 300	2 300	2 313
	2021-12-22, 2,62 %	3 000	3 000	3 078
	2024-07-24, 3,23 %	2 500	2 600	2 603
Caisse centrale Desjardins	2017-10-05, 3,50 %	4 200	4 174	4 402
Capital Desjardins	2020-05-05, 5,19 %	4 750	4 927	5 413
Compagnie d'Assurance-Vie Manufacturers	2017-06-01, 4,17 %	2 000	2 067	2 100
	2018-11-29, 2,93 %	400	400	416
	2019-02-21, 2,81 %	2 500	2 565	2 594
Crédit Ford du Canada	2016-11-21, 2,63 %	300	300	304
	2020-05-07, 2,45 %	2 650	2 650	2 660
Crombie Real Estate Investment Trust	2021-06-01, 3,96 %	160	162	165
Fiducie d'actifs BNC	2020-06-30, 7,45 %	1 000	1 129	1 225
Fiducie de placement immobilier Canadian Tire	2025-03-09, 3,53 %	900	900	894
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix	2019-06-20, 3,00 %	1 500	1 506	1 556
	2021-02-08, 3,50 %	2 000	2 096	2 102
	2022-06-20, 3,60 %	175	173	181
Financière Manuvie	2019-04-08, 7,77 %	2 200	2 452	2 674
Financière Sun Life	2017-03-02, 4,38 %	1 000	1 038	1 046
	2019-07-02, 5,70 %	1 000	1 042	1 156
	2021-08-23, 4,57 %	400	400	453
First Capital Realty	2023-10-30, 3,90 %	1 700	1 733	1 764
Fonds de placement immobilier Cominar	2019-06-21, 3,62 %	1 725	1 748	1 775
Fonds de placement immobilier Riocan	2022-05-30, 3,75 %	775	775	806
General Motors Financial Company	2020-05-22, 3,08 %	750	750	759
Great-West Lifeco	2018-03-21, 6,14 %	1 500	1 518	1 689
Industrielle Alliance, Assurance et services financiers	2022-02-23, 2,64 %	300	300	298
Intact Financial Corporation	2021-08-18, 4,70 %	1 000	1 106	1 129
RBC Trust Capital Securities	2018-06-30, 6,82 %	2 250	2 419	2 575
Société de Financement GE Capital Canada	2018-02-08, 4,40 %	5 150	5 530	5 555
Société Financière Daimler Canada	2016-09-15, 3,28 %	3 000	3 042	3 068
	2018-03-26, 2,27 %	385	385	394
	2018-10-02, 1,42 %	1 100	1 100	1 097
Société Financière IGM	2019-04-08, 7,35 %	1 850	2 037	2 220
TD Capital Trust	2018-12-31, 7,24 %	2 000	2 193	2 357
Toyota Credit Canada	2020-02-19, 1,80 %	2 450	2 449	2 452
	2020-05-20, 2,05 %	1 400	1 400	1 413
Total obligations d'institutions financières		146 738	150 395	153 709

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 30 juin 2015

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste valeur \$
Obligations de sociétés (7,7 %)				
Algonquin Power & Utilities Corp.	2022-02-15, 4,65 %	750	783	803
Alimentation Couche-Tard	2025-03-02, 3,60 %	1 625	1 625	1 617
Alliance Pipeline	2019-12-16, 4,93 %	1 000	1 064	1 101
AltaLink	2023-11-06, 3,67 %	1 000	1 029	1 081
Bell Canada	2016-09-26, 5,41 %	2 000	2 078	2 094
	2020-06-12, 3,54 %	2 300	2 366	2 431
	2021-05-19, 4,95 %	3 335	3 390	3 778
BMW Canada	2016-08-09, 2,88 %	2 000	2 034	2 036
Brookfield Asset Management	2023-03-31, 4,54 %	1 053	1 075	1 131
	2023-12-08, 5,04 %	1 700	1 699	1 869
Brookfield Renewable Energy	2025-03-02, 3,75 %	750	750	738
BRP Finance	2018-11-05, 5,25 %	2 425	2 639	2 675
Canadian Natural Resources	2020-08-14, 2,89 %	2 000	2 038	2 045
Canadian Utilities	2022-11-09, 3,12 %	775	750	819
Compagnies Loblaw	2016-06-01, 7,10 %	1 000	1 052	1 051
	2023-06-12, 4,86 %	2 200	2 421	2 464
Dollorama	2018-11-05, 3,10 %	220	223	229
Enbridge	2019-09-02, 4,77 %	2 000	2 186	2 193
	2022-12-05, 3,19 %	400	386	400
FortisAlberta	2024-06-30, 3,30 %	250	250	262
Hydro One	2020-04-30, 1,62 %	2 000	1 988	1 998
Inter Pipeline	2024-12-24, 3,17 %	1 000	1 000	969
Lower Mattagami Energy	2021-05-18, 4,33 %	300	321	339
North West Redwater Partnership	2022-01-23, 2,10 %	1 000	981	990
Pembina Pipeline Corporation	2022-10-24, 3,77 %	900	919	937
Precision Drilling Corporation	2019-03-15, 6,50 %	1 250	1 284	1 252
Reliance	2019-03-15, 5,19 %	1 600	1 700	1 713
	2020-09-15, 3,81 %	700	703	695
Rogers Communications	2020-09-29, 4,70 %	4 200	4 633	4 672
	2023-12-13, 4,00 %	800	797	835
Shaw Communications	2020-12-07, 5,50 %	1 000	1 121	1 150
Sobeys	2018-08-08, 3,52 %	400	403	420
Superior Plus LP	2017-12-09, 6,50 %	1 000	1 049	1 042
TELUS Corporation	2016-05-25, 3,65 %	2 250	2 289	2 293
	2019-12-04, 5,05 %	3 000	3 079	3 388
	2024-01-02, 3,35 %	1 000	1 019	1 005
Teranet Income Fund	2020-12-16, 4,81 %	1 050	1 146	1 170
Thomson Reuters	2020-09-30, 4,35 %	4 300	4 611	4 715
Toronto Hydro Corporation	2023-01-10, 2,91 %	1 000	1 027	1 031
Videotron	2025-03-15, 5,63 %	1 100	1 084	1 128
Total obligations de sociétés		58 633	60 992	62 559
Total obligations		662 068	682 042	694 564
Instruments de marché monétaire (5,3 %)				
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2015-10-01, 0,84 %	400	399	399
	2015-10-13, 0,84 %	1 500	1 496	1 496
Banque de Montréal	2015-08-26, 0,85 %	1 000	999	999
	2015-09-30, 0,85 %	1 000	998	998
	2015-12-15, 0,90 %	900	897	896
Banque Nationale du Canada	2015-09-15, 0,85 %	890	888	888

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 30 juin 2015

(en milliers de dollars)

Description	Valeur nominale \$	Coût \$	Juste valeur \$	
Instruments de marché monétaire (suite)				
Banque Royale du Canada	2015-07-28, 0,84 %	1 000	999	999
	2016-03-02, 1,00 %	1 885	1 872	1 873
Banque Scotia	2015-07-24, 0,84 %	1 000	1 000	999
	2015-08-31, 0,85 %	1 908	1 906	1 905
Banque Toronto Dominion	2015-08-17, 0,85 %	900	899	899
	2015-09-28, 0,85 %	1 000	998	998
	2016-05-13, 1,00 %	1 000	991	992
Honda Canada Finance	2015-10-22, 0,88 %	1 900	1 895	1 895
	2015-11-30, 0,90 %	1 000	996	996
Inter Pipeline	2015-07-14, 0,99 %	1 900	1 899	1 899
	2015-07-28, 0,97 %	1 000	999	999
Omers Finance Trust	2015-07-09, 0,83 %	1 900	1 900	1 900
	2015-08-04, 0,85 %	1 000	999	999
Province de la Colombie-Britannique	2015-09-23, 0,78 %	1 990	1 987	1 987
	2015-11-18, 0,84 %	851	848	848
	2016-04-22, 0,79 %	3 000	2 981	2 981
Province de l'Ontario	2015-07-02, 0,73 %	3 000	3 000	3 000
	2015-09-02, 0,74 %	9 000	8 988	8 989
	2015-09-23, 0,75 %	1 000	998	998
Société de transport de Montréal	2015-07-15, 0,87 %	1 500	1 499	1 499
Toyota Credit Canada	2016-01-05, 0,92 %	374	372	372
Total instruments de marché monétaire	43 798	43 703	43 703	
Contrats de change (-0,1 %)				
Caisse centrale Desjardins	2015-09-30, 1,2348 \$ CA/\$ US	45 700	0	(717)
Total contrats de change		0	(717)	
Nombre de parts				
Fonds immobilier (0,5 %)				
Fonds CORE Fiera Immobilier	1	1	1	
Fonds immobilier canadien de prestige Bentall Kennedy	399 566	2 935	3 019	
Total fonds immobilier		2 936	3 020	
Nombre d'actions				
Actions privilégiées (9,3 %)				
Banque de Montréal	Perpétuelle, 5,20 %	173 400	4 439	4 378
Banque Nationale du Canada	Perpétuelle, 6,00 %	125 000	3 350	3 231
Banque Royale du Canada	Perpétuelle, 4,45 %	61 000	1 562	1 540
	Perpétuelle, 4,50 %	118 600	2 965	3 019
	Perpétuelle, 4,60 %	92 100	2 346	2 333
	Perpétuelle, 4,70 %	15 700	394	396
	Perpétuelle, 5,00 %	131 100	3 352	3 312

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 30 juin 2015

(en milliers de dollars)

Description		Nombre d'actions	Coût \$	Juste valeur \$
Actions privilégiées (suite)				
Banque Scotia	Perpétuelle, 3,70 %	130 000	3 267	3 086
	Perpétuelle, 4,50 %	50 200	1 289	1 285
	Perpétuelle, 5,00 %	50 000	1 270	1 275
	Perpétuelle, 5,25 %	16 000	412	414
	Perpétuelle, 5,60 %	170 000	4 458	4 386
Banque Toronto Dominion	Perpétuelle, 3,75 %	118 300	2 780	2 681
	Perpétuelle, 3,80 %	54 500	1 355	1 256
	Perpétuelle, 3,90 %	4 500	106	104
Brookfield Asset Management	Perpétuelle, 4,20 %	35 000	838	756
	Perpétuelle, 4,50 %	110 260	2 842	2 557
	Perpétuelle, 4,75 %	23 800	466	497
	Perpétuelle, 4,80 %	20 000	519	466
Canadian Utilities	Perpétuelle, 4,50 %	70 000	1 761	1 550
	Perpétuelle, 4,90 %	40 000	1 018	956
Corporation Financière Power	Perpétuelle, 1,63 %	77 800	1 970	1 393
	Perpétuelle, 4,20 %	29 700	757	744
	Perpétuelle, 4,95 %	25 000	658	608
	Perpétuelle, 5,10 %	10 000	263	250
	Perpétuelle, 5,75 %	10 000	220	254
	Perpétuelle, 6,00 %	95 000	2 528	2 416
Corporation Power du Canada	Perpétuelle, 5,00 %	55 400	1 212	1 343
Enbridge	Perpétuelle, 4,00 %	280 000	7 258	5 143
	Perpétuelle, 4,40 %	50 000	1 250	1 004
Financière Manuvie	Perpétuelle, 3,90 %	35 000	852	790
	Perpétuelle, 4,20 %	132 500	3 365	2 493
	Perpétuelle, 4,40 %	25 400	675	646
	Perpétuelle, 4,50 %	35 900	867	810
Financière Sun Life	Perpétuelle, 4,75 %	137 500	3 050	3 245
	Perpétuelle, 4,80 %	60 300	1 482	1 429
	Perpétuelle, 4,97 %	10 000	226	228
	Perpétuelle, 5,01 %	8 800	196	198
Fortis	Perpétuelle, 4,00 %	9 300	203	200
	Perpétuelle, 4,10 %	111 000	2 759	2 650
	Perpétuelle, 5,25 %	40 000	877	854
Great-West Lifeco	Perpétuelle, 4,50 %	45 000	1 084	1 021
	Perpétuelle, 4,85 %	18 950	447	447
	Perpétuelle, 5,20 %	145 000	3 816	3 516
Husky Energy	Perpétuelle, 4,45 %	4 500	73	72
	Perpétuelle, 4,60 %	100 000	2 471	2 445
Industrielle Alliance, Assurance et services financiers	Perpétuelle, 4,60 %	15 000	243	334
Intact Financial Corporation	Perpétuelle, 4,20 %	45 600	1 119	1 054
TransCanada Corporation	Perpétuelle, 4,00 %	50 400	1 152	1 119
	Perpétuelle, 4,25 %	4 600	103	104
Total actions privilégiées			81 965	76 288
Total autres investissements (100,0 %)			810 646	816 858