

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements
Au 30 juin 2018

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 30 juin 2018

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
Obligations (49,8 %)				
Obligations fédérales et garanties (21,4 %)				
Fiducie du Canada pour l'habitation	2025-12-15, 1,95 %	5 625	5 588	5 413
	2025-12-15, 2,25 %	10 000	10 212	9 826
	2026-09-15, 1,90 %	12 000	11 801	11 446
	2027-06-15, 2,35 %	10 735	10 567	10 564
	2028-03-15, 2,35 %	1 700	1 647	1 669
Gouvernement du Canada	2022-06-01, 2,75 %	1 100	1 127	1 129
	2022-09-01, 1,00 %	735	706	704
	2023-03-01, 1,75 %	3 000	2 953	2 958
	2023-06-01, 1,50 %	8 400	8 183	8 173
	2025-06-01, 2,25 %	6 400	6 390	6 447
	2026-06-01, 1,50 %	7 400	7 267	7 054
	2027-06-01, 1,00 %	20 785	18 581	18 842
	2028-06-01, 2,00 %	6 500	5 693	6 403
LNH Financière First National ¹	2023-05-01, 2,39 %	11 460	11 357	11 417
LNH Merrill Lynch Canada ¹	2021-03-01, 1,25 %	55 178	55 043	54 006
	2022-09-01, 1,89 %	14 427	14 158	14 177
Total obligations fédérales et garanties		175 445	171 273	170 228
Obligations provinciales, municipales ou garanties (12,9 %)				
Hydro-Québec	2024-08-15, 2,02 %	14 040	12 412	11 872
Municipal Finance Authority of British Columbia	2025-10-02, 2,65 %	3 000	3 006	2 971
	2026-04-19, 2,50 %	900	867	879
OPB Finance Trust	2026-10-25, 2,98 %	2 330	2 329	2 325
Province de la Colombie-Britannique	2026-06-18, 2,30 %	5 000	4 820	4 878
Province de la Nouvelle-Écosse	2027-06-01, 2,10 %	3 500	3 376	3 300
Province de l'Ontario	2025-06-02, 2,60 %	6 300	6 247	6 264
	2026-06-02, 2,40 %	17 325	17 076	16 887
	2027-06-02, 2,60 %	10 750	10 586	10 565
Province de Québec	2024-06-01, 2,46 %	3 000	2 596	2 553
	2025-09-01, 2,75 %	24 600	24 350	24 731
	2026-09-01, 2,50 %	10 000	9 855	9 835
Province du Manitoba	2027-06-02, 2,60 %	5 000	4 850	4 898
	2028-06-02, 3,00 %	900	891	907
Total obligations provinciales, municipales ou garanties		106 645	103 261	102 865
Obligations d'institutions financières (10,5 %)				
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2021-04-26, 1,90 %	1 600	1 568	1 566
Banque de Montréal	2021-10-28, 1,61 %	5 000	4 982	4 818
	2022-06-01, 2,57 %	900	881	875
	2024-09-11, 2,70 %	900	900	884
	2028-03-01, 3,19 %	1 500	1 499	1 506
Banque Nationale du Canada	2022-03-18, 2,11 %	1 300	1 276	1 268
	2023-02-01, 3,18 %	800	800	783
Banque Royale du Canada	2019-06-19, 1,76 %	3 500	3 500	3 500
	2023-05-01, 2,95 %	9 700	9 683	9 712
	2023-12-05, 2,33 %	3 700	3 678	3 583

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 2018

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
Obligations d'institutions financières (suite)				
Banque Scotia	2020-06-15, 2,13 %	2 000	1 979	1 983
	2021-12-02, 1,90 %	4 400	4 333	4 271
	2023-04-17, 2,98 %	900	900	901
	2028-02-02, 3,10 %	2 000	1 999	1 988
Banque Toronto-Dominion	2023-07-18, 1,91 %	11 300	11 197	10 777
	2024-07-25, 3,22 %	2 550	2 536	2 491
bcIMC Realty	2026-12-31, 3,00 %	600	600	591
Chartwell Résidences pour Retraités	2023-10-11, 3,79 %	200	200	200
	2025-02-28, 4,21 %	200	200	203
CI Financial	2021-10-25, 2,78 %	1 700	1 700	1 689
Fairfax Financial Holdings	2027-09-06, 4,25 %	900	900	888
Fédération des caisses Desjardins du Québec	2022-08-25, 2,39 %	5 400	5 347	5 294
Fiducie d'actifs BNC	2020-06-30, 7,45 %	250	264	269
Fiducie de placement immobilier Canadian Tire	2026-03-01, 3,29 %	1 750	1 726	1 693
	2027-09-07, 3,87 %	750	750	744
Fiducie de placement immobilier Granite	2023-09-30, 3,87 %	450	450	451
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix	2022-06-20, 3,60 %	1 175	1 194	1 191
	2027-12-08, 4,18 %	2 000	2 002	2 019
Financière Sun Life	2021-08-23, 4,57 %	1 400	1 454	1 475
	2022-11-23, 2,75 %	750	750	739
First Capital Realty	2023-10-30, 3,90 %	1 700	1 723	1 731
	2027-04-12, 3,75 %	800	800	783
Fonds de placement immobilier RioCan	2022-05-30, 3,75 %	775	775	791
Fonds de placement immobilier SmartCentres	2027-09-21, 3,83 %	1 500	1 462	1 462
Groupe TMX	2024-10-11, 3,00 %	250	250	248
Honda Canada Finance	2022-07-15, 2,27 %	525	527	513
	2022-12-19, 2,49 %	180	180	177
Industrielle Alliance, Assurance et services financiers	2022-02-23, 2,64 %	300	300	295
Intact Corporation financière	2027-03-07, 2,85 %	1 600	1 600	1 525
John Deere Canada Funding	2020-07-13, 1,60 %	2 250	2 249	2 206
	2020-09-17, 2,05 %	750	754	741
Société Financière Daimler Canada	2021-07-08, 1,91 %	500	498	485
Toyota Credit Canada	2022-10-11, 2,62 %	3 100	3 096	3 065
Wells Fargo Canada	2023-01-24, 3,46 %	1 200	1 263	1 224
Total obligations d'institutions financières		85 005	84 725	83 598
Obligations de sociétés (5,0 %)				
AltaGas	2024-10-15, 3,84 %	1 000	1 036	1 011
Altalink	2023-11-06, 3,67 %	1 000	1 019	1 044
	2026-02-28, 2,75 %	650	653	639
Bell Canada	2022-09-03, 3,00 %	1 000	1 005	998
	2026-05-12, 2,90 %	300	293	287
BMW Canada	2021-06-15, 1,83 %	1 400	1 396	1 363
Brookfield Asset Management	2023-03-31, 4,54 %	1 053	1 067	1 109
	2023-12-08, 5,04 %	1 700	1 699	1 827
Brookfield Renewable Energy Partners	2025-03-02, 3,75 %	750	750	757
Bruce Power	2021-06-23, 2,84 %	300	300	299
Canadian Tire	2023-06-06, 3,17 %	180	180	181
Canadian Utilities	2022-11-09, 3,12 %	775	759	787

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 30 juin 2018

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
Obligations de sociétés (suite)				
Enbridge	2019-09-02, 4,77 %	60	62	62
	2022-12-05, 3,19 %	400	391	400
	2027-03-08, 3,20 %	1 000	964	952
	2027-09-27, 5,38 %	1 700	1 700	1 611
	2028-04-12, 6,63 %	750	750	771
EnerCare Solutions	2020-02-03, 4,60 %	400	410	411
	2023-12-21, 3,99 %	600	600	609
Fortis	2023-10-12, 2,85 %	1 030	1 030	1 013
FortisAlberta	2024-06-30, 3,30 %	250	250	255
FortisBC Energy	2026-01-08, 2,58 %	975	948	949
Hydro One	2021-02-24, 1,84 %	1 100	1 093	1 079
	2021-06-25, 2,57 %	3 500	3 500	3 492
	2025-11-26, 2,77 %	600	582	588
Inter Pipeline	2023-07-13, 2,61 %	125	125	121
	2024-02-18, 2,73 %	1 000	1 000	963
	2024-12-24, 3,17 %	1 000	1 000	976
Liberty Power	2022-02-15, 4,65 %	750	769	786
Lower Mattagami Energy	2021-05-18, 4,33 %	300	311	314
Metro	2027-09-06, 3,39 %	470	470	460
North West Redwater Partnership	2022-01-23, 2,10 %	800	792	779
Pembina Pipeline	2026-05-11, 3,71 %	1 150	1 174	1 152
	2027-03-15, 4,24 %	2 600	2 651	2 688
Reliance	2025-01-15, 3,84 %	1 110	1 100	1 100
Rogers Communications	2023-12-13, 4,00 %	800	798	834
Saputo	2022-05-13, 1,94 %	1 000	1 000	962
	2023-09-21, 2,83 %	1 500	1 500	1 476
Superior Plus	2020-02-27, 5,25 %	1 300	1 320	1 259
TELUS	2022-02-28, 2,35 %	550	548	538
	2024-01-02, 3,35 %	300	304	301
Toromont Industries	2027-07-27, 3,84 %	800	800	809
Toronto Hydro	2023-01-10, 2,91 %	1 000	1 017	1 008
TransAlta	2020-11-25, 5,00 %	500	516	518
Westcoast Energy	2025-09-08, 3,77 %	560	560	576
Total obligations de sociétés		40 088	40 192	40 114
Total obligations		407 183	399 451	396 805
Instruments de marché monétaire (6,9 %)				
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto	2018-07-16, 1,58 %	3 500	3 498	3 498
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2018-07-09, 1,55 %	500	500	500
	2018-07-31, 1,73 %	1 500	1 498	1 498
	2018-07-13, 1,51 %	1 550	1 549	1 549
Banque Nationale du Canada	2018-09-06, 1,74 %	1 500	1 495	1 495
Banque Scotia	2018-08-28, 1,77 %	509	507	507
	2018-12-06, 1,85 %	2 400	2 380	2 380
Banque Toronto-Dominion	2018-11-21, 1,86 %	3 500	3 475	3 475
Honda Canada Finance	2018-10-26, 1,85 %	3 500	3 479	3 479
Inter Pipeline	2018-08-07, 1,74 %	500	499	499
	2018-08-29, 1,75 %	3 000	2 991	2 991

Capital régional et coopératif Desjardins

Relevé des autres investissements (non audité)

Au 30 juin 2018

(en milliers de dollars)

Description		Valeur nominale \$	Coût \$	Juste Valeur \$
Instruments de marché monétaire (suite)				
Province de l'Ontario	2018-09-26, 1,49 %	7 000	6 975	6 975
	2019-01-16, 1,70 %	700	694	694
	2019-02-06, 1,78 %	1 300	1 286	1 286
Province de Québec	2018-09-28, 1,50 %	10 000	9 963	9 963
	2019-04-05, 1,82 %	8 680	8 561	8 561
Société de Transport de Montréal	2018-07-05, 1,63 %	2 000	2 000	2 000
Toyota Credit Canada	2018-09-17, 1,70 %	1 500	1 494	1 494
	2018-10-02, 1,85 %	2 000	1 991	1 991
Total instruments de marché monétaire		55 139	54 835	54 835
Contrats de change (0,2 %)				
Fédération des caisses Desjardins du Québec	2018-09-28, 1.3286 \$ CA/\$ US	108 600 \$US	0	1 723
Total contrats de change		108 600 \$US	0	1 723
Nombre de parts				
Fonds d'actions canadiennes (11,8 %)				
Fiducie institutionnelle Fidelity Actions canadiennes à faible volatilité		3 582	44 471	46 384
FNB BMO d'actions canadiennes à faible volatilité		2 102	44 823	47 555
Total fonds d'actions canadiennes			89 294	93 939
Fonds d'actions mondiales (19,7 %)				
Fonds Desjardins IBrix Actions mondiales à faible volatilité		6 220	72 221	80 735
Fonds Desjardins Mondial de dividendes		3 687	72 212	75 941
Total fonds d'actions mondiales			144 433	156 676
Fonds immobilier (11,6 %)				
Fonds CORE Fiera Immobilier		40	44 134	46 009
Fonds immobilier canadien de prestige de Bentall Kennedy		5 896	43 896	46 505
Total fonds immobilier			88 030	92 514
Total autres investissements (100,0 %)			776 043	796 492