
 Suppression

 Modification de texte

 Ajout

 Déplacement

10.200

Rapprochement du bilan Actif

(en milliers de dollars)

| Page de référence des ÉF | Page de référence de l'ESCAP | | VIE consolidé | | Ajustements | | ESCAP | |
|--------------------------|------------------------------|--|-------------------|--|--|--|-------------------|--|
| | | | Bilan | | Déconsolidation et autres ajustements ¹ | | Bilan | |
| 20.010 | | Encaisse et quasi-espèces | 1020010010 | | 1020012010 | | | |
| | 30.500 | Espèces conservées dans les locaux | | | | | 1020013020 | |
| | 30.500 | Autre encaisse | | | | | 1020013030 | |
| 20.010 | | Actifs détenus pour la vente (ADV) | 1020010040 | | 1020012040 | | | |
| | 30.500 | ADV - option par facteur | | | | | 1020013050 | |
| | 30.500 | ADV - option de reclassement | | | | | 1020013060 | |
| 21.012 | | Placements à court terme | 1020010070 | | 1020012070 | | | |
| | 30.100 | Entités admissibles pour un facteur de 0 % | | | | | 1020013080 | |
| | 30.100 | CD/Dépôts auprès de banques et d'ID | | | | | 1020013090 | |
| | 30.100 | C1 | | | | | 1020013100 | |
| | 30.100 | C2 | | | | | 1020013110 | |
| | 30.100 | C3 | | | | | 1020013120 | |
| | 30.100 | Toutes les autres notations | | | | | 1020013130 | |
| 20.010 | | Revenu de placements couru | 1020010140 | | 1020012140 | | | |
| 20.010 | | Comptes débiteurs | 1020010190 | | 1020012190 | | | |
| | 30.500 | Primes à recevoir | | | | | 1020013200 | |
| | 30.500 | Autres comptes débiteurs | | | | | 1020013210 | |
| 20.010 | 30.500 | Avances sur polices/certificat | 1020010220 | | 1020012220 | | 1020013220 | |
| 20.010 | | Obligations et débentures | 1020010230 | | 1020012230 | | | |
| | 30.200 | Entités admissibles pour un facteur de 0 % | | | | | 1020013250 | |
| | 30.200 | AAA | | | | | 1020013260 | |
| | 30.200 | AA | | | | | 1020013270 | |
| | 30.200 | A | | | | | 1020013280 | |
| | 30.200 | BBB | | | | | 1020013290 | |
| | 30.200 | BB | | | | | 1020013300 | |
| | 30.200 | B | | | | | 1020013310 | |
| | 30.200 | Inférieure à B | | | | | 1020013320 | |
| | 30.200 | Sans notation | | | | | 1020013330 | |
| | 30.300 | Titres adossés | | | | | 1020013331 | |
| 20.010 | | Prêts hypothécaires | 1020010340 | | 1020012340 | | | |
| | 30.400 | Prêts hypothécaires garantis par la SCHL | | | | | 1020013350 | |
| | 30.400 | Autres prêts hypothécaires assurés | | | | | 1020013360 | |
| | 30.400 | Prêts hypothécaires résidentiels admissibles | | | | | 1020013370 | |
| | 30.400 | Prêts hypothécaires commerciaux | | | | | 1020013380 | |
| | 30.400 | Prêts hypothécaires résidentiels non admissibles | | | | | 1020013390 | |
| | 30.400 | Prêts hypothécaires garantis par des terrains non aménagés | | | | | 1020013400 | |
| | 30.400 | Prêts hypothécaires dépréciés et restructurés | | | | | 1020013410 | |
| | 30.400 | Entités admissibles pour un facteur de 0 % | | | | | 1020013420 | |
| | 30.400 | Notés - AAA | | | | | 1020013430 | |
| | 30.400 | Notés - AA | | | | | 1020013440 | |
| | 30.400 | Notés - A | | | | | 1020013450 | |
| | 30.400 | Notés - BBB | | | | | 1020013460 | |
| 20.010 | | Actions privilégiées | 1020010470 | | 1020012470 | | | |
| | 50.200 | P1 | | | | | 1020013480 | |
| | 50.200 | P2 | | | | | 1020013490 | |
| | 50.200 | P3 | | | | | 1020013500 | |
| | 50.200 | P4 | | | | | 1020013510 | |
| | 50.200 | Sans notation | | | | | 1020013520 | |
| 20.010 | | Actions ordinaires | 1020010530 | | 1020012530 | | | |
| | 50.200 | Actions cotées des marchés développés qui ne constituent pas une participation notable | | | | | 1020013540 | |
| | 50.200 | Actions non cotées des marchés développés ou qui constituent une participation notable | | | | | 1020013550 | |
| | 50.200 | Actions cotées des autres marchés qui ne constituent pas une participation notable | | | | | 1020013560 | |
| | 50.200 | Actions non cotées des autres marchés ou qui constituent une participation notable | | | | | 1020013570 | |
| | 50.200 | Fonds communs de placement, fonds indicatif négociable en bourse, fiducies d'investissement immobilier | | | | | 1020013703 | |
| 20.010 | | Immeubles de placement | 1020010580 | | 1020012580 | | | |
| | 50.300 | Immeubles de placement | | | | | 1020013590 | |
| | | Instruments financiers dérivés | 1020010610 | | | | 1020013610 | |
| 20.010 | | Actifs de réassurance | 1020010620 | | 1020012620 | | | |
| | 30.500 | Réassurance agréée | | | | | 1020013630 | |
| | | Réassurance non agréée | | | | | 1020013640 | |
| 20.010 | | Immobilisations corporelles | 1020010650 | | 1020012650 | | | |
| | 50.300 | Immeubles occupés par leur propriétaire | | | | | 1020013660 | |
| | 50.300 | Matériel | | | | | 1020013670 | |
| 20.010 | | Participations dans des entreprises associées et des coentreprises | 1020010680 | | 1020012680 | | 1020013680 | |
| 20.010 | | Actif net des fonds distincts | 1020010690 | | 1020012690 | | 1020013690 | |
| 20.010 | | Autres prêts et placements | 1020010700 | | 1020012700 | | | |
| | 30.600 | Autres prêts | | | | | 1020013701 | |
| | 30.600 et 50.300 | Baux | | | | | 1020013702 | |
| 20.010 | | Placements dans des filiales ² | 1020010710 | | 1020012710 | | 1020013710 | |
| 20.010 | 30.500 | Actifs d'impôt exigible | 1020010720 | | 1020012720 | | 1020013720 | |
| 20.010 | 20.500 | Actifs d'impôt différé | 1020010730 | | 1020012730 | | 1020013730 | |
| | 30.500 | Écarts d'acquisition | 1020010740 | | 1020012740 | | 1020013740 | |
| | 30.500 | Immobilisations incorporelles | 1020010750 | | 1020012750 | | 1020013750 | |
| 20.010 | | Régimes de retraite à prestations définies | 1020010760 | | 1020012760 | | | |
| | 20.300 | Actifs nets au titre des régimes à PD | | | | | 1020013770 | |
| | 30.500 | Remboursements disponibles | | | | | 1020013780 | |
| 20.010 | 30.500 | Autres éléments d'actif | 1020010790 | | 1020012790 | | 1020013790 | |
| | | Total de l'actif | 1020010800 | | 1020012800 | | 1020013800 | |

¹ Par exemple, renversement des éliminations interentreprises, revenu de placements couru, etc.

² L'assureur doit déconsolider et présenter selon la méthode de la mise en équivalence les filiales d'assurance de dommages et les filiales financières réglementées dissemblables tel que prévu à la section 1.3 de la Ligne directrice ESCAP.

10.250

Rapprochement du bilan

Placements dans des filiales d'assurance de dommages et des filiales financières réglementées dissemblables¹

(en milliers de dollars)

| | Raison sociale ¹ | | Catégorie d'activité ² | | Territoire | | Montant du placement ³ | | Filiale | | | | | | | |
|------------|-----------------------------|--|-----------------------------------|--|------------|--|-----------------------------------|--|--------------------------|--|-------------------------|--|--------------------------|--|---------------------|--|
| | | | | | | | | | Valeur totale de l'actif | | Valeur totale du passif | | Valeur totale de l'avoir | | Exigence de capital | |
| Filiale 1 | 1025010010 | | 1025011010 | | 1025012010 | | 1025013010 | | 1025014010 | | 1025015010 | | 1025016010 | | 1025017010 | |
| Filiale 2 | 1025010020 | | 1025011020 | | 1025012020 | | 1025013020 | | 1025014020 | | 1025015020 | | 1025016020 | | 1025017020 | |
| Filiale 3 | 1025010030 | | 1025011030 | | 1025012030 | | 1025013030 | | 1025014030 | | 1025015030 | | 1025016030 | | 1025017030 | |
| Filiale 4 | 1025010040 | | 1025011040 | | 1025012040 | | 1025013040 | | 1025014040 | | 1025015040 | | 1025016040 | | 1025017040 | |
| Filiale 5 | 1025010050 | | 1025011050 | | 1025012050 | | 1025013050 | | 1025014050 | | 1025015050 | | 1025016050 | | 1025017050 | |
| Filiale 6 | 1025010060 | | 1025011060 | | 1025012060 | | 1025013060 | | 1025014060 | | 1025015060 | | 1025016060 | | 1025017060 | |
| Filiale 7 | 1025010070 | | 1025011070 | | 1025012070 | | 1025013070 | | 1025014070 | | 1025015070 | | 1025016070 | | 1025017070 | |
| Filiale 8 | 1025010080 | | 1025011080 | | 1025012080 | | 1025013080 | | 1025014080 | | 1025015080 | | 1025016080 | | 1025017080 | |
| Filiale 9 | 1025010090 | | 1025011090 | | 1025012090 | | 1025013090 | | 1025014090 | | 1025015090 | | 1025016090 | | 1025017090 | |
| Filiale 10 | 1025010100 | | 1025011100 | | 1025012100 | | 1025013100 | | 1025014100 | | 1025015100 | | 1025016100 | | 1025017100 | |
| Filiale 11 | 1025010110 | | 1025011110 | | 1025012110 | | 1025013110 | | 1025014110 | | 1025015110 | | 1025016110 | | 1025017110 | |
| Filiale 12 | 1025010120 | | 1025011120 | | 1025012120 | | 1025013120 | | 1025014120 | | 1025015120 | | 1025016120 | | 1025017120 | |
| Filiale 13 | 1025010130 | | 1025011130 | | 1025012130 | | 1025013130 | | 1025014130 | | 1025015130 | | 1025016130 | | 1025017130 | |
| Filiale 14 | 1025010140 | | 1025011140 | | 1025012140 | | 1025013140 | | 1025014140 | | 1025015140 | | 1025016140 | | 1025017140 | |
| Filiale 15 | 1025010150 | | 1025011150 | | 1025012150 | | 1025013150 | | 1025014150 | | 1025015150 | | 1025016150 | | 1025017150 | |

¹ Voir la section 1.3 de la Ligne directrice ESCAP. Les filiales doivent être présentées en ordre décroissant en fonction du montant du placement.

² Les catégories d'activité peuvent être les suivantes : bancaire, fiducie et prêts, assurance de dommages, société coopérative de crédit, courtage de titres ou autre.

³ Ce montant doit être présenté selon la méthode de la mise en équivalence tel que prévu à la section 1.3 de la Ligne directrice ESCAP.

10.300

Rapprochement du bilan Passif et avoir

(en milliers de dollars)

| Page de référence des ÉF | | VIE consolidé | | Ajustements | | ESCAP | |
|--|---|---------------------------|------------|--|--|------------|------------|
| | | Bilan | | Déconsolidation et autres ajustements ¹ | | Bilan | |
| 22.020 | Passifs détenus pour la vente | 1030010010 | | 1030012010 | | 1030013010 | |
| | Provisions techniques pour contrats d'assurance | 1030010020 | | 1030012020 | | 1030013020 | |
| 22.020 | Autres passifs en vertu de contrats | 1030010030 | | 1030012030 | | 1030013030 | |
| 22.030 ou 21.155 | Dépôts bancaires et dépôts en fiducie | 1030010040 | | 1030012040 | | 1030013040 | |
| | Comptes créditeurs | 1030010050 | | 1030012050 | | 1030013050 | |
| 21.080 | Prêts hypothécaires et autres charges immobilières | 1030010060 | | 1030012060 | | 1030013060 | |
| | Instruments financiers dérivés | 1030010070 | | 1030012070 | | 1030013070 | |
| 22.030 | Régimes de retraite à prestations définies | 1030010080 | | 1030012080 | | 1030013080 | |
| | Montants courus à l'égard des régimes de pension des employés (ne comprend pas les sommes de la ligne précédente) | 1030010090 | | 1030012090 | | 1030013090 | |
| | Provisions et autres éléments de passif | 1030010100 | | 1030012100 | | 1030013100 | |
| | Passif des fonds distincts | 1030010110 | | 1030012110 | | 1030013110 | |
| | Passifs d'impôt exigible | 1030010120 | | 1030012120 | | 1030013120 | |
| | Passifs d'impôt différé | 1030010130 | | 1030012130 | | 1030013130 | |
| | Dettes subordonnées | 1030010140 | | 1030012140 | | 1030013140 | |
| | Autres dettes | 1030010150 | | 1030012150 | | 1030013150 | |
| | Total du passif | 1030010160 | | 1030012160 | | 1030013160 | |
| | 20.040 | Compte avec participation | 1030010170 | | | | 1030013170 |
| Compte avec participation - Cumul des AÉRÉ (perte) | | 1030010180 | | | | 1030013180 | |
| 20.040 | Compte sans participation (compagnies mutuelles seulement) | 1030010190 | | | | 1030013190 | |
| | Compte sans participation - Cumul des AÉRÉ (perte) | 1030010200 | | | | 1030013200 | |
| | <i>Total de l'avoir des titulaires de polices</i> | 1030010210 | | 1030012210 | | 1030013210 | |
| 20.040 | Capital-actions | 1030010220 | | | | 1030013220 | |
| | Autre capital | 1030010230 | | | | 1030013230 | |
| | Surplus d'apport | 1030010240 | | | | 1030013240 | |
| | Bénéfices non répartis | 1030010250 | | | | 1030013250 | |
| | Cumul des AÉRÉ (perte) des actionnaires | 1030010260 | | | | 1030013260 | |
| | <i>Total de l'avoir des actionnaires</i> | 1030010270 | | 1030012270 | | 1030013270 | |
| | Part des actionnaires sans contrôle | 1030010280 | | 1030012280 | | 1030013280 | |
| | Total de l'avoir | 1030010290 | | 1030012290 | | 1030013290 | |
| | Total du passif et de l'avoir | 1030010300 | | 1030012300 | | 1030013300 | |
| 20.044 | Compte du siège social | 1030010310 | | 1030012310 | | 1030013310 | |
| | Cumul des autres éléments du résultat étendu (perte) | 1030010320 | | 1030012320 | | 1030013320 | |
| | Total du passif, du compte du siège social et cumul des autres éléments du résultat étendu (perte) | 1030010330 | | 1030012330 | | 1030013330 | |

¹ Par exemple, renversement des éliminations interentreprises.

10.400

Attribution de l'avoir¹

(en milliers de dollars)

PÉD liées aux hypothèses de scénarios (après réduction pour toute forme de réassurance)

| | | Total | | CANADA | | É.-U. | | R.-U. | | EUROPE | | JAPON | | AUTRES | |
|--|-----|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|
| PÉD liées aux hypothèses de scénarios des taux d'intérêt sans risque | (A) | 1040010010 | | 1040011010 | | 1040012010 | | 1040013010 | | 1040014010 | | 1040015010 | | 1040016010 | |

PÉD liées aux hypothèses non économiques (après réduction pour la réassurance agréée uniquement)

| | | | | | | | | | | | | | | | |
|-----------|-----|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|
| Mortalité | (B) | 1040010020 | | 1040011020 | | 1040012020 | | 1040013020 | | 1040014020 | | 1040015020 | | 1040016020 | |
| Longévité | (C) | 1040010040 | | 1040011040 | | 1040012040 | | 1040013040 | | 1040014040 | | 1040015040 | | 1040016040 | |
| Morbidité | (D) | 1040010060 | | 1040011060 | | 1040012060 | | 1040013060 | | 1040014060 | | 1040015060 | | 1040016060 | |
| Déchéance | (E) | 1040010080 | | 1040011080 | | 1040012080 | | 1040013080 | | 1040014080 | | 1040015080 | | 1040016080 | |
| Dépenses | (F) | 1040010100 | | 1040011100 | | 1040012100 | | 1040013100 | | 1040014100 | | 1040015100 | | 1040016100 | |

| | | | | | | | | | | | | | | | |
|--|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|
| Montant total de l'Attribution de l'avoir (A + B + C + D + E + F) | | 1040010120 | | 1040011120 | | 1040012120 | | 1040013120 | | 1040014120 | | 1040015120 | | 1040016120 | |
|--|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|

¹ Voir la section 1.1.3 de la Ligne directrice ESCAP. Les PÉD associées aux contrats de fonds distincts sont exclues de l'Attribution de l'avoir.

Assureur

Date de fin de la période

10.500

Dépôts admissibles¹

(en milliers de dollars)

| | | | Exigences liées aux risques de crédit et de marché ² | |
|---|------------|--|---|--|
| Dépôts excédentaires faits par des réassureurs non agréés - fonds détenus et autres soldes dus aux réassureurs | 1050010010 | | | |
| Dépôts excédentaires faits par des réassureurs non agréés - lettres de crédit | 1050010020 | | 1050011020 | |
| Dépôts excédentaires faits par des réassureurs non agréés - autres véhicules de garantie | 1050010030 | | 1050011030 | |
| Provisions pour fluctuation des réclamations de réassurances et ententes similaires | 1050010040 | | | |
| Montant total des Dépôts admissibles (après la prise en compte des limites) | | | 1050010050 | |
| Coussin de solvabilité global, calculé après réduction pour toute forme de réassurance, et excluant toutes les exigences de risque de change liées à la réassurance non agréée³ | | | 1050010060 | |
| Attribution de l'avoir calculée après réduction pour toute forme de réassurance⁴ | | | 1050010070 | |

1 Voir la section 1.1.4 de la Ligne directrice ESCAP.

2 Voir la section 10.4.3 de la Ligne directrice ESCAP.

3 Voir la section 6.7.1 de la Ligne directrice ESCAP. Il s'agit de CS₂ qui est utilisé pour déterminer la limite des Dépôts excédentaires.

4 Voir la section 6.7.1 de la Ligne directrice ESCAP. Montant utilisé pour calculer la limite des Dépôts excédentaires.

Supplément annuel ESCAP (2019)

Page suivante : 20.400

20.400

Capital disponible
Ajustement de l'avoir aux fins de l'ESCAP et cumul ajusté des AÉRG
(en milliers de dollars)

| | Exercice courant | |
|--|------------------|--|
| Cumul des gains (pertes) après impôt sur les passifs évalués à la juste valeur découlant de changements au risque de crédit de l'assureur ¹ | 2040010020 | |
| Plus : Gains (pertes) de juste valeur après impôt sur les immeubles occupés par leur propriétaire découlant de la conversion aux IFRS (modèle du coût) | 2040010030 | |
| Moins : Cumul des pertes de réévaluation après impôt sur les immeubles occupés par leur propriétaire (modèle de la réévaluation) | 2040010040 | |
| Plus : Gains (pertes) jusqu'à la date de transfert sur les immeubles occupés par leur propriétaire qui étaient classés auparavant comme immeubles de placement | 2040010055 | |
| Plus : Éléments de participation discrétionnaire présentés comme une composante des capitaux propres | 2040010060 | |
| Ajustement de l'avoir aux fins de l'ESCAP | 2040010080 | |
| Cumul du redressement des conversions en devise étrangère déclaré dans les AÉRG | 2040010100 | |
| Cumul des gains (pertes) non réalisés sur des prêts disponibles à la vente/à la JVAÉRG déclarés dans les AÉRG | 2040010120 | |
| Cumul des gains (pertes) non réalisés sur des titres de créance disponibles à la vente/à la JVAÉRG déclarés dans les AÉRG | 2040010121 | |
| Cumul des gains (pertes) non réalisés sur des titres de participation disponibles à la vente déclarés dans les AÉRG | 2040010110 | |
| Cumul des gains de réévaluation sur les biens immobiliers occupés par leur propriétaire déclarés dans les AÉRG (modèle de la réévaluation) | 2040010130 | |
| Cumul des variations de passifs en vertu de la comptabilité reflet déclarées dans les AÉRG | 2040010140 | |
| Cumul des gains (pertes) de juste valeur sur la portion efficace des couvertures de flux de trésorerie déclarés dans les AÉRG | 2040010150 | |
| Cumul des réévaluations au titre des régimes de retraite à prestations définies déclarées dans les AÉRG | 2040010160 | |
| Cumul des réévaluations au titre des autres régimes à prestations définies déclarées dans les AÉRG | 2040010170 | |
| Cumul des gains (pertes) après impôt sur les passifs évalués à la juste valeur découlant de changements au risque de crédit de l'assureur ² | 2040010180 | |
| Cumul des gains (pertes) non réalisés des filiales d'assurance de dommages et des filiales financières réglementées dissemblables déduites du Capital disponible | 2040010190 | |
| Cumul d'autres éléments déclarés dans les AÉRG - 1 (précisez) | 2040010200 | |
| Cumul d'autres éléments déclarés dans les AÉRG - 2 (précisez) | 2040010210 | |
| <i>Sous-total des AÉRG (bilan aux fins de l'ESCAP)</i> | 2040010220 | |
| Moins : Cumul des gains de réévaluation sur les immeubles occupés par leur propriétaire déclarés dans les AÉRG (modèle de la réévaluation) | 2040010230 | |
| Moins : Cumul des gains (pertes) de juste valeur sur la portion efficace des couvertures de flux de trésorerie déclarés dans les AÉRG | 2040010240 | |
| Moins : Cumul des gains (pertes) après impôt sur les passifs évalués à la juste valeur découlant de changements au risque de crédit de l'assureur ² | 2040010250 | |
| Moins : Cumul des gains (pertes) non réalisés des filiales d'assurance de dommages et des filiales financières réglementées dissemblables déduites du Capital disponible | 2040010260 | |
| Cumul ajusté des AÉRG | 2040010270 | |

¹ Cet ajustement fait spécifiquement référence aux gains (pertes) constatés aux bénéfices non répartis sous IAS 39.

² Cet ajustement fait spécifiquement référence aux gains (pertes) sur les passifs évalués à la juste valeur constatés aux AÉRG lorsque l'assureur a adopté la norme IFRS 9 et constate les variations de juste valeur liées à son propre risque de crédit aux AÉRG (plutôt que dans l'état des résultats).

20.500

Capital disponible
Actifs d'impôt différé et actifs grevés
(en milliers de dollars)

| | | |
|---|------------|--|
| AID non temporaires | 2050010010 | |
| Moins : Passif d'impôt différé (PID) admissibles ¹ | 2050010020 | |
| AID non temporaires (montant de la déduction) | 2050010030 | |

| | | |
|---|------------|--|
| AID temporaires | 2050010040 | |
| Moins : PID admissibles ¹ | 2050010050 | |
| <i>AID temporaires, réduits des PID admissibles</i> | 2050010060 | |
| 10 % du Capital brut de catégorie 1, réduit des déductions des sections 2.1.2.1 à 2.1.2.5.1 et 2.1.2.6 à 2.1.2.10 | 2050010070 | |
| AID temporaires (montant de la déduction) | 2050010080 | |
| AID temporaires (montant inclus dans le Capital disponible et assujetti à une exigence de capital de 25 %) | 2050010090 | |

| | | |
|--|------------|--|
| Actifs grevés ² | 2050010100 | |
| Moins : Valeur des passifs au bilan garantis par les actifs grevés | 2050010110 | |
| Moins : Valeur de l'exigence marginale de capital à l'égard des passifs garantis par les actifs grevés | 2050010120 | |
| Moins : Valeur de l'exigence marginale de capital à l'égard des actifs grevés | 2050010130 | |
| <i>Sous-total</i> | 2050010140 | |
| Moins : 50 % du montant calculé de déduction qui est lié aux immeubles autrement grevés pour garantir des activités d'emprunt hypothécaire | 2050010150 | |
| Actifs grevés (montant de la déduction) | 2050010160 | |

¹ Les PID admissibles sont limités à ceux qui peuvent compenser des AID aux fins comptables au niveau de l'entité juridique, sauf ceux qui ont fait l'objet d'une compensation avec les déductions pour les écarts d'acquisition, les autres actifs incorporels et les actifs au titre des régimes de retraite à prestations définies. Les PID admissibles sont attribués au prorata entre les AID temporaires et les AID non temporaires.

² Les actifs relatifs aux opérations de financement de valeurs mobilières hors bilan (c.-à-d., prêts et emprunts de titres, ainsi que mises et prises en pension) qui n'ont pas pour effet de générer un passif au bilan, les actifs grevés pour garantir des passifs liés à des dérivés soumis à une compensation centrale et à des dérivés de gré à gré et les actifs grevés conformément aux règles prévues au Code civil du Québec pour garantir des activités d'emprunt hypothécaire sont exclus de la déduction.

20.600

Capital disponible Passifs négatifs

(en milliers de dollars)

Passifs négatifs pour lesquels l'ESCAP permet l'ajustement par un facteur de pourcentage :

| | | | |
|--|-----|------------|--|
| Passifs négatifs avant l'ajustement par le facteur de pourcentage ¹ | (A) | 2060010010 | |
| Moins : Ajustement par le facteur de pourcentage (A x 30 %) | (B) | 2060010020 | |
| Montant net (A - B) | (C) | 2060010030 | |
| Passifs négatifs pour lesquels l'ESCAP ne permet pas l'ajustement par un facteur de pourcentage | (D) | 2060010040 | |
| Passifs négatifs ajustés (C + D) | | 2060010050 | |
| Moins : 85 % du remboursement de la commission | | 2060010060 | |
| Moins : Coefficient x (1 + facteur de risque opérationnel) x 70 % de l'exigence marginale du risque d'assurance ¹ | | 2060010070 | |
| Moins : Ajustement pour les polices acceptées en vertu d'un traité TRA | | 2060010080 | |
| Total - réductions pour les montants récupérables au rachat | (E) | 2060010090 | |
| Limite de la réduction ¹ | (F) | 2060010100 | |
| Réduction permise (le moindre de E ou de F) | (G) | 2060010110 | |
| Passifs négatifs ajustés nets conservés² (C + D - G) | (I) | 2060010120 | |

Montant des passifs compensés cédés pour lequel l'ESCAP permet l'ajustement par un facteur de pourcentage :

| | | | |
|---|-----|------------|--|
| Montant des passifs compensés cédés avant l'ajustement par le facteur de pourcentage ³ | (J) | 2060010130 | |
| Moins : Ajustement par le facteur de pourcentage (J x 30 %) | (K) | 2060010140 | |
| Montant net (J - K) | (L) | 2060010150 | |
| Montant des passifs compensés cédés pour lequel l'ESCAP ne permet pas l'ajustement par un facteur de pourcentage | (M) | 2060010160 | |
| Information : Limite sur le crédit total pour les passifs négatifs compensés cédés ⁴ | | 2060010170 | |
| Moins : Crédit pour la réassurance non agréée appliqué au montant des passifs compensés cédés | (N) | 2060010180 | |
| Passifs négatifs cédés en réassurance non agréée - compensation des passifs police par police cédés au même réassureur⁵ (L + M - N) | (O) | 2060010190 | |

Montant total négatif de passif cédé pour lequel l'ESCAP permet l'ajustement par un facteur de pourcentage :

| | | | |
|--|-----|------------|--|
| Montant total négatif de passif cédé avant l'ajustement par un facteur de pourcentage ⁴ | (P) | 2060010200 | |
| Moins : Ajustement par le facteur de pourcentage (P x 30 %) | (Q) | 2060010210 | |
| Montant net (P - Q) | (R) | 2060010220 | |
| Montant total négatif de passif cédé pour lequel l'ESCAP ne permet pas l'ajustement par un facteur de pourcentage | (S) | 2060010230 | |
| Total - montant total négatif de passif cédé (R + S) | (T) | 2060010240 | |
| Information : Actifs provenant de l'opération avec les réassureurs (tels que présentés au formulaire annuel) | | 2060010250 | |
| Actifs non admissibles provenant de l'opération avec les réassureurs ⁶ (tels que présentés au formulaire annuel) | (U) | 2060010260 | |
| Passifs négatifs cédés en réassurance non agréée - montant total négatif de passifs cédés⁷ (le moindre de T ou de U) | (V) | 2060010270 | |

| | | | |
|---|--|------------|--|
| Total - passifs négatifs (I + O + V) | | 2060010280 | |
|---|--|------------|--|

¹ Voir la section 2.1.2.9 de la Ligne directrice ESCAP.

² Après la prise en considération des cessions en réassurance agréée et non agréée. Voir la section 2.1.2.9 de la Ligne directrice ESCAP.

³ S'applique aux passifs des assurés actifs de produits canadiens d'assurance maladie souscrits individuellement et de produits canadiens d'assurance vie souscrits individuellement.

⁴ Voir la section 10.3.2 de la Ligne directrice ESCAP.

⁵ Voir la section 10.3.2 de la Ligne directrice ESCAP.

⁶ Voir la section 10.3.3 de la Ligne directrice ESCAP. Comprend les comptes débiteurs des réassureurs et les obligations entre leurs sociétés affiliées.

⁷ Voir la section 10.3.3 de la Ligne directrice ESCAP.

30.100

Risque de crédit Titres à court terme

(en milliers de dollars)

| | TOTAL | | Produits sans participation | | | | Produits avec participation | | | | | | | | | | | |
|--|---------------------|--|-----------------------------|--|---|--|-----------------------------|------------|---------------------|------------|---------|------------|---|--------|------------|--|---------------------|--|
| | Exigence de capital | | Montant | | Redistribution de l'exposition pour une sûreté / garantie | | Facteur | | Exigence de capital | | Montant | | Redistribution de l'exposition pour une sûreté / garantie | | Facteur | | Exigence de capital | |
| Entités admissibles pour un facteur de 0 % | 3010010010 | | 3010011010 | | 3010012010 | | 0,00% | 3010013010 | | 3010014010 | | 3010015010 | | 0,00% | 3010016010 | | | |
| CD/Dépôts auprès de banques et d'ID | 3010010020 | | 3010011020 | | 3010012020 | | 0,30% | 3010013020 | | 3010014020 | | 3010015020 | | 0,30% | 3010016020 | | | |
| C1 | 3010010030 | | 3010011030 | | 3010012030 | | 0,30% | 3010013030 | | 3010014030 | | 3010015030 | | 0,30% | 3010016030 | | | |
| C2 | 3010010040 | | 3010011040 | | 3010012040 | | 0,60% | 3010013040 | | 3010014040 | | 3010015040 | | 0,60% | 3010016040 | | | |
| C3 | 3010010050 | | 3010011050 | | 3010012050 | | 2,50% | 3010013050 | | 3010014050 | | 3010015050 | | 2,50% | 3010016050 | | | |
| Toutes les autres notations | 3010010060 | | 3010011060 | | 3010012060 | | 10,00% | 3010013060 | | 3010014060 | | 3010015060 | | 10,00% | 3010016060 | | | |
| Titres à court terme | 3010010070 | | 3010011070 | | 3010012070 | | | 3010013070 | | 3010014070 | | 3010015070 | | | 3010016070 | | | |

| | TOTAL | | Produits sans participation | | | | Produits avec participation | | | | | | | |
|---|---------------------|--|-----------------------------|--|---------|------------|-----------------------------|------------|---------|--------|------------|--|---------------------|--|
| | Exigence de capital | | Montant | | Facteur | | Exigence de capital | | Montant | | Facteur | | Exigence de capital | |
| Garantis par des entités admissibles pour un facteur de 0 % | 3010010080 | | 3010011080 | | 0,00% | 3010013080 | | 3010014080 | | 0,00% | 3010016080 | | | |
| C1 | 3010010090 | | 3010011090 | | 0,30% | 3010013090 | | 3010014090 | | 0,30% | 3010016090 | | | |
| C2 | 3010010100 | | 3010011100 | | 0,60% | 3010013100 | | 3010014100 | | 0,60% | 3010016100 | | | |
| C3 | 3010010110 | | 3010011110 | | 2,50% | 3010013110 | | 3010014110 | | 2,50% | 3010016110 | | | |
| Toutes les autres notations | 3010010120 | | 3010011120 | | 60,00% | 3010013120 | | 3010014120 | | 60,00% | 3010016120 | | | |
| Titres adossés | 3010010130 | | 3010011130 | | | 3010013130 | | 3010014130 | | | 3010016130 | | | |

| | TOTAL | | Produits sans participation | | | | Produits avec participation | | | | | | | |
|---|---------------------|--|-----------------------------|--|---------|------------|-----------------------------|------------|---------|--------|------------|--|---------------------|--|
| | Exigence de capital | | Montant | | Facteur | | Exigence de capital | | Montant | | Facteur | | Exigence de capital | |
| Garantis par des entités admissibles pour un facteur de 0 % | 3010010140 | | 3010011140 | | 0,00% | 3010013140 | | 3010014140 | | 0,00% | 3010016140 | | | |
| C1 | 3010010150 | | 3010011150 | | 0,60% | 3010013150 | | 3010014150 | | 0,60% | 3010016150 | | | |
| C2 | 3010010160 | | 3010011160 | | 1,20% | 3010013160 | | 3010014160 | | 1,20% | 3010016160 | | | |
| C3 | 3010010170 | | 3010011170 | | 5,00% | 3010013170 | | 3010014170 | | 5,00% | 3010016170 | | | |
| Toutes les autres notations | 3010010180 | | 3010011180 | | 60,00% | 3010013180 | | 3010014180 | | 60,00% | 3010016180 | | | |
| Retritisations | 3010010190 | | 3010011190 | | | 3010013190 | | 3010014190 | | | 3010016190 | | | |

Risque de crédit Obligations

(en milliers de dollars)

| Total | Produits sans participation | | | | | | | | Produits avec participation | | | | | | | | | | | |
|--|-----------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|-------------|------------|-----------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|-------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| | < 1 an | 1-2 ans | 2-3 ans | 3-4 ans | 4-5 ans | 5-10 ans | 10 ans et + | Total | < 1 an | 1-2 ans | 2-3 ans | 3-4 ans | 4-5 ans | 5-10 ans | 10 ans et + | Total | | | | |
| Entités admissibles pour un facteur de | 3020011000 | 3020011100 | 3020011200 | 3020011300 | 3020011400 | 3020011500 | 3020011600 | 3020011700 | 3020011800 | 3020011900 | 3020021100 | 3020022100 | 3020023100 | 3020024100 | 3020025100 | 3020026100 | 3020027100 | 3020028100 | 3020029100 | 3020030100 |
| AAA | 3020011010 | 3020011110 | 3020011210 | 3020011310 | 3020011410 | 3020011510 | 3020011610 | 3020011710 | 3020011810 | 3020011910 | 3020021110 | 3020022110 | 3020023110 | 3020024110 | 3020025110 | 3020026110 | 3020027110 | 3020028110 | 3020029110 | 3020030110 |
| AA | 3020010120 | 3020011120 | 3020011220 | 3020011320 | 3020011420 | 3020011520 | 3020011620 | 3020011720 | 3020011820 | 3020011920 | 3020021120 | 3020022120 | 3020023120 | 3020024120 | 3020025120 | 3020026120 | 3020027120 | 3020028120 | 3020029120 | 3020030120 |
| A | 3020010130 | 3020011130 | 3020011230 | 3020011330 | 3020011430 | 3020011530 | 3020011630 | 3020011730 | 3020011830 | 3020011930 | 3020021130 | 3020022130 | 3020023130 | 3020024130 | 3020025130 | 3020026130 | 3020027130 | 3020028130 | 3020029130 | 3020030130 |
| BBB | 3020010140 | 3020011140 | 3020011240 | 3020011340 | 3020011440 | 3020011540 | 3020011640 | 3020011740 | 3020011840 | 3020011940 | 3020021140 | 3020022140 | 3020023140 | 3020024140 | 3020025140 | 3020026140 | 3020027140 | 3020028140 | 3020029140 | 3020030140 |
| BB | 3020010150 | 3020011150 | 3020011250 | 3020011350 | 3020011450 | 3020011550 | 3020011650 | 3020011750 | 3020011850 | 3020011950 | 3020021150 | 3020022150 | 3020023150 | 3020024150 | 3020025150 | 3020026150 | 3020027150 | 3020028150 | 3020029150 | 3020030150 |
| B | 3020010160 | 3020011160 | 3020011260 | 3020011360 | 3020011460 | 3020011560 | 3020011660 | 3020011760 | 3020011860 | 3020011960 | 3020021160 | 3020022160 | 3020023160 | 3020024160 | 3020025160 | 3020026160 | 3020027160 | 3020028160 | 3020029160 | 3020030160 |
| Inférieure à B | 3020010170 | 3020011170 | 3020011270 | 3020011370 | 3020011470 | 3020011570 | 3020011670 | 3020011770 | 3020011870 | 3020011970 | 3020021170 | 3020022170 | 3020023170 | 3020024170 | 3020025170 | 3020026170 | 3020027170 | 3020028170 | 3020029170 | 3020030170 |
| Obligations dépréciées et restructurées ¹ | 3020010175 | 3020011175 | 3020011275 | 3020011375 | 3020011475 | 3020011575 | 3020011675 | 3020011775 | 3020011875 | 3020011975 | 3020021175 | 3020022175 | 3020023175 | 3020024175 | 3020025175 | 3020026175 | 3020027175 | 3020028175 | 3020029175 | 3020030175 |
| Sans notation | 3020010180 | 3020011180 | 3020011280 | 3020011380 | 3020011480 | 3020011580 | 3020011680 | 3020011780 | 3020011880 | 3020011980 | 3020021180 | 3020022180 | 3020023180 | 3020024180 | 3020025180 | 3020026180 | 3020027180 | 3020028180 | 3020029180 | 3020030180 |
| Obligations (valeur aux fins de l'ESCAP) | 3020010190 | 3020011190 | 3020011290 | 3020011390 | 3020011490 | 3020011590 | 3020011690 | 3020011790 | 3020011890 | 3020011990 | 3020021190 | 3020022190 | 3020023190 | 3020024190 | 3020025190 | 3020026190 | 3020027190 | 3020028190 | 3020029190 | 3020030190 |

| | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| Entités admissibles pour un facteur de | 3020010300 | 3020011300 | 3020012300 | 3020013300 | 3020014300 | 3020015300 | 3020016300 | 3020017300 | 3020018300 | 3020019300 | 3020021300 | 3020022300 | 3020023300 | 3020024300 | 3020025300 | 3020026300 | 3020027300 | 3020028300 | 3020029300 | 3020030300 |
| AAA | 3020010310 | 3020011310 | 3020012310 | 3020013310 | 3020014310 | 3020015310 | 3020016310 | 3020017310 | 3020018310 | 3020019310 | 3020021310 | 3020022310 | 3020023310 | 3020024310 | 3020025310 | 3020026310 | 3020027310 | 3020028310 | 3020029310 | 3020030310 |
| AA | 3020010320 | 3020011320 | 3020012320 | 3020013320 | 3020014320 | 3020015320 | 3020016320 | 3020017320 | 3020018320 | 3020019320 | 3020021320 | 3020022320 | 3020023320 | 3020024320 | 3020025320 | 3020026320 | 3020027320 | 3020028320 | 3020029320 | 3020030320 |
| A | 3020010330 | 3020011330 | 3020012330 | 3020013330 | 3020014330 | 3020015330 | 3020016330 | 3020017330 | 3020018330 | 3020019330 | 3020021330 | 3020022330 | 3020023330 | 3020024330 | 3020025330 | 3020026330 | 3020027330 | 3020028330 | 3020029330 | 3020030330 |
| BBB | 3020010340 | 3020011340 | 3020012340 | 3020013340 | 3020014340 | 3020015340 | 3020016340 | 3020017340 | 3020018340 | 3020019340 | 3020021340 | 3020022340 | 3020023340 | 3020024340 | 3020025340 | 3020026340 | 3020027340 | 3020028340 | 3020029340 | 3020030340 |
| BB | 3020010350 | 3020011350 | 3020012350 | 3020013350 | 3020014350 | 3020015350 | 3020016350 | 3020017350 | 3020018350 | 3020019350 | 3020021350 | 3020022350 | 3020023350 | 3020024350 | 3020025350 | 3020026350 | 3020027350 | 3020028350 | 3020029350 | 3020030350 |
| B | 3020010360 | 3020011360 | 3020012360 | 3020013360 | 3020014360 | 3020015360 | 3020016360 | 3020017360 | 3020018360 | 3020019360 | 3020021360 | 3020022360 | 3020023360 | 3020024360 | 3020025360 | 3020026360 | 3020027360 | 3020028360 | 3020029360 | 3020030360 |
| Inférieure à B | 3020010370 | 3020011370 | 3020012370 | 3020013370 | 3020014370 | 3020015370 | 3020016370 | 3020017370 | 3020018370 | 3020019370 | 3020021370 | 3020022370 | 3020023370 | 3020024370 | 3020025370 | 3020026370 | 3020027370 | 3020028370 | 3020029370 | 3020030370 |
| Obligations dépréciées et restructurées ¹ | 3020010375 | 3020011375 | 3020012375 | 3020013375 | 3020014375 | 3020015375 | 3020016375 | 3020017375 | 3020018375 | 3020019375 | 3020021375 | 3020022375 | 3020023375 | 3020024375 | 3020025375 | 3020026375 | 3020027375 | 3020028375 | 3020029375 | 3020030375 |
| Sans notation | 3020010380 | 3020011380 | 3020012380 | 3020013380 | 3020014380 | 3020015380 | 3020016380 | 3020017380 | 3020018380 | 3020019380 | 3020021380 | 3020022380 | 3020023380 | 3020024380 | 3020025380 | 3020026380 | 3020027380 | 3020028380 | 3020029380 | 3020030380 |
| Redistribution de l'exposition pour une sûreté / garantie | 3020010390 | 3020011390 | 3020012390 | 3020013390 | 3020014390 | 3020015390 | 3020016390 | 3020017390 | 3020018390 | 3020019390 | 3020021390 | 3020022390 | 3020023390 | 3020024390 | 3020025390 | 3020026390 | 3020027390 | 3020028390 | 3020029390 | 3020030390 |

Echéance moyenne

| | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| AAA | 3020012210 | 3020013210 | 3020014210 | 3020015210 | 3020016210 | 3020017210 | 3020018210 | 3020019210 | 3020020210 | 3020021210 | 3020022210 | 3020023210 | 3020024210 | 3020025210 | 3020026210 | 3020027210 | 3020028210 | 3020029210 | 3020030210 |
| AA | 3020012220 | 3020013220 | 3020014220 | 3020015220 | 3020016220 | 3020017220 | 3020018220 | 3020019220 | 3020020220 | 3020021220 | 3020022220 | 3020023220 | 3020024220 | 3020025220 | 3020026220 | 3020027220 | 3020028220 | 3020029220 | 3020030220 |
| A | 3020012230 | 3020013230 | 3020014230 | 3020015230 | 3020016230 | 3020017230 | 3020018230 | 3020019230 | 3020020230 | 3020021230 | 3020022230 | 3020023230 | 3020024230 | 3020025230 | 3020026230 | 3020027230 | 3020028230 | 3020029230 | 3020030230 |
| BBB | 3020012240 | 3020013240 | 3020014240 | 3020015240 | 3020016240 | 3020017240 | 3020018240 | 3020019240 | 3020020240 | 3020021240 | 3020022240 | 3020023240 | 3020024240 | 3020025240 | 3020026240 | 3020027240 | 3020028240 | 3020029240 | 3020030240 |
| BB | 3020012250 | 3020013250 | 3020014250 | 3020015250 | 3020016250 | 3020017250 | 3020018250 | 3020019250 | 3020020250 | 3020021250 | 3020022250 | 3020023250 | 3020024250 | 3020025250 | 3020026250 | 3020027250 | 3020028250 | 3020029250 | 3020030250 |
| B | 3020012260 | 3020013260 | 3020014260 | 3020015260 | 3020016260 | 3020017260 | 3020018260 | 3020019260 | 3020020260 | 3020021260 | 3020022260 | 3020023260 | 3020024260 | 3020025260 | 3020026260 | 3020027260 | 3020028260 | 3020029260 | 3020030260 |
| Inférieure à B | 3020012270 | 3020013270 | 3020014270 | 3020015270 | 3020016270 | 3020017270 | 3020018270 | 3020019270 | 3020020270 | 3020021270 | 3020022270 | 3020023270 | 3020024270 | 3020025270 | 3020026270 | 3020027270 | 3020028270 | 3020029270 | 3020030270 |
| Obligations dépréciées et restructurées ¹ | 3020012275 | 3020013275 | 3020014275 | 3020015275 | 3020016275 | 3020017275 | 3020018275 | 3020019275 | 3020020275 | 3020021275 | 3020022275 | 3020023275 | 3020024275 | 3020025275 | 3020026275 | 3020027275 | 3020028275 | 3020029275 | 3020030275 |
| Sans notation | 3020012280 | 3020013280 | 3020014280 | 3020015280 | 3020016280 | 3020017280 | 3020018280 | 3020019280 | 3020020280 | 3020021280 | 3020022280 | 3020023280 | 3020024280 | 3020025280 | 3020026280 | 3020027280 | 3020028280 | 3020029280 | 3020030280 |

| | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|-----|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| AAA | 3020010010 | 3020011010 | 3020012010 | 3020013010 | 3020014010 | 3020015010 | 3020016010 | 3020017010 | 3020018010 | 3020019010 | 3020021010 | 3020022010 | 3020023010 | 3020024010 | 3020025010 | 3020026010 | 3020027010 | 3020028010 | 3020029010 | 3020030010 |
| AA | 3020010020 | 3020011020 | 3020012020 | 3020013020 | 3020014020 | 3020015020 | 3020016020 | 3020017020 | 3020018020 | 3020019020 | 3020021020 | 3020022020 | 3020023020 | 3020024020 | 3020025020 | 3020026020 | 3020027020 | 3020028020 | 3020029020 | 3020030020 |
| A | 3020010030 | 3020011030 | 3020012030 | 3020013030 | 3020014030 | 3020015030 | 3020016030 | 3020017030 | 3020018030 | 3020019030 | 3020021030 | 3020022030 | 3020023030 | 3020024030 | 3020025030 | 3020026030 | 3020027030 | 3020028030 | 3020029030 | 3020030030 |
| BBB | 3020010040 | 3020011040 | 3020012040 | 3020013040 | 3020014040 | 3020015040 | 3020016040 | 3020017040 | 3020018040 | 3020019040 | 3020021040 | 3020022040 | 3020023040 | 3020024040 | 3020025040 | 3020026040 | 3020027040 | 3020028040 | 3020029040 | 3020030040 |
| BB | 3020010050 | 3020011050 | 3020012050 | 3020013050 | 3020014050 | 3020015050 | 302001 | | | | | | | | | | | | | |

Risque de crédit
Titres adossés et retitrisations
(en milliers de dollars)

| Total | Produits sans participation | | | | | | | Produits avec participation | | | | | | | | | | | | |
|--|-----------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|-------------|-----------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|-------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| | < 1 an | 1-2 ans | 2-3 ans | 3-4 ans | 4-5 ans | 5-10 ans | 10 ans et + | Total | < 1 an | 1-2 ans | 2-3 ans | 3-4 ans | 4-5 ans | 5-10 ans | 10 ans et + | Total | | | | |
| Garantis par la SCHL ou une entité admissible pour un facteur de 0 % | 3030010110 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| AAA | 3030010120 | 3030011120 | 3030012120 | 3030013120 | 3030014120 | 3030015120 | 3030016120 | 3030017120 | 3030018120 | 3030019120 | 3030021120 | 3030022120 | 3030023120 | 3030024120 | 3030025120 | 3030026120 | 3030027120 | 3030028120 | 3030029120 | 3030030120 |
| AA | 3030010130 | 3030011130 | 3030012130 | 3030013130 | 3030014130 | 3030015130 | 3030016130 | 3030017130 | 3030018130 | 3030019130 | 3030021130 | 3030022130 | 3030023130 | 3030024130 | 3030025130 | 3030026130 | 3030027130 | 3030028130 | 3030029130 | 3030030130 |
| A | 3030010140 | 3030011140 | 3030012140 | 3030013140 | 3030014140 | 3030015140 | 3030016140 | 3030017140 | 3030018140 | 3030019140 | 3030021140 | 3030022140 | 3030023140 | 3030024140 | 3030025140 | 3030026140 | 3030027140 | 3030028140 | 3030029140 | 3030030140 |
| BBB | 3030010150 | 3030011150 | 3030012150 | 3030013150 | 3030014150 | 3030015150 | 3030016150 | 3030017150 | 3030018150 | 3030019150 | 3030021150 | 3030022150 | 3030023150 | 3030024150 | 3030025150 | 3030026150 | 3030027150 | 3030028150 | 3030029150 | 3030030150 |
| BB | 3030010160 | 3030011160 | 3030012160 | 3030013160 | 3030014160 | 3030015160 | 3030016160 | 3030017160 | 3030018160 | 3030019160 | 3030021160 | 3030022160 | 3030023160 | 3030024160 | 3030025160 | 3030026160 | 3030027160 | 3030028160 | 3030029160 | 3030030160 |
| B | 3030010170 | 3030011170 | 3030012170 | 3030013170 | 3030014170 | 3030015170 | 3030016170 | 3030017170 | 3030018170 | 3030019170 | 3030021170 | 3030022170 | 3030023170 | 3030024170 | 3030025170 | 3030026170 | 3030027170 | 3030028170 | 3030029170 | 3030030170 |
| Inférieure à B | 3030010180 | 3030011180 | 3030012180 | 3030013180 | 3030014180 | 3030015180 | 3030016180 | 3030017180 | 3030018180 | 3030019180 | 3030021180 | 3030022180 | 3030023180 | 3030024180 | 3030025180 | 3030026180 | 3030027180 | 3030028180 | 3030029180 | 3030030180 |
| Titres à détection indirecte non admissible | 3030010190 | 3030011190 | 3030012190 | 3030013190 | 3030014190 | 3030015190 | 3030016190 | 3030017190 | 3030018190 | 3030019190 | 3030021190 | 3030022190 | 3030023190 | 3030024190 | 3030025190 | 3030026190 | 3030027190 | 3030028190 | 3030029190 | 3030030190 |
| Titres dépréciés et restructurés ¹ | 3030010195 | 3030011195 | 3030012195 | 3030013195 | 3030014195 | 3030015195 | 3030016195 | 3030017195 | 3030018195 | 3030019195 | 3030021195 | 3030022195 | 3030023195 | 3030024195 | 3030025195 | 3030026195 | 3030027195 | 3030028195 | 3030029195 | 3030030195 |
| Sans notation | 3030010200 | 3030011200 | 3030012200 | 3030013200 | 3030014200 | 3030015200 | 3030016200 | 3030017200 | 3030018200 | 3030019200 | 3030021200 | 3030022200 | 3030023200 | 3030024200 | 3030025200 | 3030026200 | 3030027200 | 3030028200 | 3030029200 | 3030030200 |
| Titres adossés (valeur aux fins de l'ESCAP) | 3030010210 | 3030011210 | 3030012210 | 3030013210 | 3030014210 | 3030015210 | 3030016210 | 3030017210 | 3030018210 | 3030019210 | 3030021210 | 3030022210 | 3030023210 | 3030024210 | 3030025210 | 3030026210 | 3030027210 | 3030028210 | 3030029210 | 3030030210 |

| | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|--|
| Garantis par la SCHL ou une entité admissible pour un facteur de 0 % | 3030010220 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| AAA | 3030010230 | 3030011230 | 3030012230 | 3030013230 | 3030014230 | 3030015230 | 3030016230 | 3030017230 | 3030018230 | 3030019230 | 3030021230 | 3030022230 | 3030023230 | 3030024230 | 3030025230 | 3030026230 | 3030027230 | 3030028230 | 3030029230 | 3030030230 | |
| AA | 3030010240 | 3030011240 | 3030012240 | 3030013240 | 3030014240 | 3030015240 | 3030016240 | 3030017240 | 3030018240 | 3030019240 | 3030021240 | 3030022240 | 3030023240 | 3030024240 | 3030025240 | 3030026240 | 3030027240 | 3030028240 | 3030029240 | 3030030240 | |
| A | 3030010250 | 3030011250 | 3030012250 | 3030013250 | 3030014250 | 3030015250 | 3030016250 | 3030017250 | 3030018250 | 3030019250 | 3030021250 | 3030022250 | 3030023250 | 3030024250 | 3030025250 | 3030026250 | 3030027250 | 3030028250 | 3030029250 | 3030030250 | |
| BBB | 3030010260 | 3030011260 | 3030012260 | 3030013260 | 3030014260 | 3030015260 | 3030016260 | 3030017260 | 3030018260 | 3030019260 | 3030021260 | 3030022260 | 3030023260 | 3030024260 | 3030025260 | 3030026260 | 3030027260 | 3030028260 | 3030029260 | 3030030260 | |
| BB | 3030010270 | 3030011270 | 3030012270 | 3030013270 | 3030014270 | 3030015270 | 3030016270 | 3030017270 | 3030018270 | 3030019270 | 3030021270 | 3030022270 | 3030023270 | 3030024270 | 3030025270 | 3030026270 | 3030027270 | 3030028270 | 3030029270 | 3030030270 | |
| B | 3030010280 | 3030011280 | 3030012280 | 3030013280 | 3030014280 | 3030015280 | 3030016280 | 3030017280 | 3030018280 | 3030019280 | 3030021280 | 3030022280 | 3030023280 | 3030024280 | 3030025280 | 3030026280 | 3030027280 | 3030028280 | 3030029280 | 3030030280 | |
| Inférieure à B | 3030010290 | 3030011290 | 3030012290 | 3030013290 | 3030014290 | 3030015290 | 3030016290 | 3030017290 | 3030018290 | 3030019290 | 3030021290 | 3030022290 | 3030023290 | 3030024290 | 3030025290 | 3030026290 | 3030027290 | 3030028290 | 3030029290 | 3030030290 | |
| Titres à détection indirecte non admissible | 3030010300 | 3030011300 | 3030012300 | 3030013300 | 3030014300 | 3030015300 | 3030016300 | 3030017300 | 3030018300 | 3030019300 | 3030021300 | 3030022300 | 3030023300 | 3030024300 | 3030025300 | 3030026300 | 3030027300 | 3030028300 | 3030029300 | 3030030300 | |
| Titres dépréciés et restructurés ¹ | 3030010305 | 3030011305 | 3030012305 | 3030013305 | 3030014305 | 3030015305 | 3030016305 | 3030017305 | 3030018305 | 3030019305 | 3030021305 | 3030022305 | 3030023305 | 3030024305 | 3030025305 | 3030026305 | 3030027305 | 3030028305 | 3030029305 | 3030030305 | |
| Sans notation | 3030010310 | 3030011310 | 3030012310 | 3030013310 | 3030014310 | 3030015310 | 3030016310 | 3030017310 | 3030018310 | 3030019310 | 3030021310 | 3030022310 | 3030023310 | 3030024310 | 3030025310 | 3030026310 | 3030027310 | 3030028310 | 3030029310 | 3030030310 | |
| Retitrisations (valeur aux fins de l'ESCAP) | 3030010320 | 3030011320 | 3030012320 | 3030013320 | 3030014320 | 3030015320 | 3030016320 | 3030017320 | 3030018320 | 3030019320 | 3030021320 | 3030022320 | 3030023320 | 3030024320 | 3030025320 | 3030026320 | 3030027320 | 3030028320 | 3030029320 | 3030030320 | |

Échéance moyenne (titres adossés)

| | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|-----|--|------------|------------|------------|------------|------------|--|--|--|--|------------|------------|------------|------------|------------|--|--|--|--|--|
| AAA | | 3030012330 | 3030013330 | 3030014330 | 3030015330 | 3030016330 | | | | | 3030022330 | 3030023330 | 3030024330 | 3030025330 | 3030026330 | | | | | |
| AA | | 3030012340 | 3030013340 | 3030014340 | 3030015340 | 3030016340 | | | | | 3030022340 | 3030023340 | 3030024340 | 3030025340 | 3030026340 | | | | | |
| A | | 3030012350 | 3030013350 | 3030014350 | 3030015350 | 3030016350 | | | | | 3030022350 | 3030023350 | 3030024350 | 3030025350 | 3030026350 | | | | | |
| BBB | | 3030012360 | 3030013360 | 3030014360 | 3030015360 | 3030016360 | | | | | 3030022360 | 3030023360 | 3030024360 | 3030025360 | 3030026360 | | | | | |
| BB | | 3030012370 | 3030013370 | 3030014370 | 3030015370 | 3030016370 | | | | | 3030022370 | 3030023370 | 3030024370 | 3030025370 | 3030026370 | | | | | |

Échéance moyenne (retitrisations)

| | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|-----|--|------------|------------|------------|------------|------------|--|--|--|--|------------|------------|------------|------------|------------|--|--|--|--|--|
| AAA | | 3030012335 | 3030013335 | 3030014335 | 3030015335 | 3030016335 | | | | | 3030022335 | 3030023335 | 3030024335 | 3030025335 | 3030026335 | | | | | |
| AA | | 3030012345 | 3030013345 | 3030014345 | 3030015345 | 3030016345 | | | | | 3030022345 | 3030023345 | 3030024345 | 3030025345 | 3030026345 | | | | | |
| A | | 3030012355 | 3030013355 | 3030014355 | 3030015355 | 3030016355 | | | | | 3030022355 | 3030023355 | 3030024355 | 3030025355 | 3030026355 | | | | | |
| BBB | | 3030012365 | 3030013365 | 3030014365 | 3030015365 | 3030016365 | | | | | 3030022365 | 3030023365 | 3030024365 | 3030025365 | 3030026365 | | | | | |

| | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|-----|------------|-------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| AAA | 3030010010 | 30300101010 | 3030012010 | 3030013010 | 3030014010 | 3030015010 | 3030016010 | 3030017010 | 3030018010 | 3030019010 | 3030021010 | 3030022010 | 3030023010 | 3030024010 | 3030025010 | 3030026010 | 3030027010 | 3030028010 | 3030029010 | 3030030010 |
| AA | 3030010020 | 3030010020 | 3030012020 | 3030013020 | 3030014020 | 3030015020 | 3030016020 | 3030017020 | 3030018020 | 3030019020 | 3030021020 | 3030022020 | 3030023020 | 3030024020 | 3030025020 | 3030026020 | 3030027020 | 3030028020 | 3030029020 | 3030030020 |
| A | 3030010030 | 3030010030 | 3030012030 | 3030013030 | 3030014030 | 3030015030 | 3030016030 | 3030017030 | 3030018030 | 3030019030 | 3030021030 | 3030022030 | 3030023030 | 3030024030 | 3030025030 | 3030026030 | 3030027030 | 3030028030 | 3030029030 | 3030030030 |
| BBB | 3030010040 | 3030010040 | 3030012040 | 3030013040 | 3030014040 | 3030015040 | 3030016040 | 3030017040 | 3030018040 | 3030019040 | 3030021040 | 3030022040 | 3030023040 | 3030024040 | 3030025040 | 3030026040 | 3030027040 | 3030028040 | 3030029040 | 3030030040 |
| BB | 3030010050 | 3030010050 | 3030012050 | 3030013050 | 3030014050 | 3030015050 | 3030016050 | 3030017050 | 3030018050 | 3030019050 | 3030021050 | 3030022050 | 3030023050 | 3030024050 | 3030025050 | 3030026050 | 3030027050 | 3030028050 | 3030029050 | 3030030050 |
| B | 3030010060 | 3030010060 | 3030012060 | 3030013060 | 3030014060 | 3030015060 | 3030016060 | 3030017060 | 3030018060 | 3030019060 | 3030021060 | 3030022060 | 3030023060 | 3030024060 | 3030025060 | 3030026060 | 3030027060 | 3030028060 | 3030029060 | |

30.400
Risque de crédit
Prêts hypothécaires
 (en milliers de dollars)

| Total | Produits sans participation | | | | | | | | Total | |
|---|-----------------------------|--------|------------|------------|------------|------------|------------|-------------|------------|------------|
| | Facteur de risque | < 1 an | 1-2 ans | 2-3 ans | 3-4 ans | 4-5 ans | 5-10 ans | 10 ans et + | | |
| Prêts hypothécaires garantis par la SCHL | 3040010140 | 0,00% | 3040011140 | 3040012140 | 3040013140 | 3040014140 | 3040015140 | 3040016140 | 3040017140 | 3040019140 |
| Autres prêts hypothécaires assurés ¹ | 3040010150 | 2,00% | 3040011150 | 3040012150 | 3040013150 | 3040014150 | 3040015150 | 3040016150 | 3040017150 | 3040019150 |
| Prêts hypothécaires résidentiels admissibles ² | 3040010160 | 2,00% | 3040011160 | 3040012160 | 3040013160 | 3040014160 | 3040015160 | 3040016160 | 3040017160 | 3040019160 |
| Prêts hypothécaires commerciaux | 3040010170 | 6,00% | 3040011170 | 3040012170 | 3040013170 | 3040014170 | 3040015170 | 3040016170 | 3040017170 | 3040019170 |
| Prêts hypothécaires résidentiels non admissibles | 3040010180 | 6,00% | 3040011180 | 3040012180 | 3040013180 | 3040014180 | 3040015180 | 3040016180 | 3040017180 | 3040019180 |
| Prêts hypothécaires garantis par des terrains non aménagés | 3040010190 | 10,00% | 3040011190 | 3040012190 | 3040013190 | 3040014190 | 3040015190 | 3040016190 | 3040017190 | 3040019190 |
| Partie d'un prêt hypothécaire qui est fondée sur une augmentation de valeur due à un changement de vocation | 3040010200 | 10,00% | 3040011200 | 3040012200 | 3040013200 | 3040014200 | 3040015200 | 3040016200 | 3040017200 | 3040019200 |
| Prêts hypothécaires dépréciés et restructurés ³ | 3040010210 | 18,00% | 3040011210 | 3040012210 | 3040013210 | 3040014210 | 3040015210 | 3040016210 | 3040017210 | 3040019210 |
| Entités admissibles pour un facteur de 0 % | 3040010220 | 0,00% | 3040011220 | 3040012220 | 3040013220 | 3040014220 | 3040015220 | 3040016220 | 3040017220 | 3040019220 |
| Notés - AAA | 3040010230 | | 3040011230 | 3040012230 | 3040013230 | 3040014230 | 3040015230 | 3040016230 | 3040017230 | 3040019230 |
| Notés - AA | 3040010240 | | 3040011240 | 3040012240 | 3040013240 | 3040014240 | 3040015240 | 3040016240 | 3040017240 | 3040019240 |
| Notés - A | 3040010250 | | 3040011250 | 3040012250 | 3040013250 | 3040014250 | 3040015250 | 3040016250 | 3040017250 | 3040019250 |
| Notés - BBB | 3040010260 | | 3040011260 | 3040012260 | 3040013260 | 3040014260 | 3040015260 | 3040016260 | 3040017260 | 3040019260 |
| Prêts hypothécaires (valeur aux fins de l'ESCAP) | 3040010270 | | 3040011270 | 3040012270 | 3040013270 | 3040014270 | 3040015270 | 3040016270 | 3040017270 | 3040019270 |

| Facteur de risque | Produits avec participation | | | | | | | | Total |
|-------------------|-----------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|-------------|------------|-------|
| | < 1 an | 1-2 ans | 2-3 ans | 3-4 ans | 4-5 ans | 5-10 ans | 10 ans et + | | |
| 0,00% | 3040021140 | 3040022140 | 3040023140 | 3040024140 | 3040025140 | 3040026140 | 3040027140 | 3040029140 | |
| 2,00% | 3040021150 | 3040022150 | 3040023150 | 3040024150 | 3040025150 | 3040026150 | 3040027150 | 3040029150 | |
| 2,00% | 3040021160 | 3040022160 | 3040023160 | 3040024160 | 3040025160 | 3040026160 | 3040027160 | 3040029160 | |
| 6,00% | 3040021170 | 3040022170 | 3040023170 | 3040024170 | 3040025170 | 3040026170 | 3040027170 | 3040029170 | |
| 6,00% | 3040021180 | 3040022180 | 3040023180 | 3040024180 | 3040025180 | 3040026180 | 3040027180 | 3040029180 | |
| 10,00% | 3040021190 | 3040022190 | 3040023190 | 3040024190 | 3040025190 | 3040026190 | 3040027190 | 3040029190 | |
| 10,00% | 3040021200 | 3040022200 | 3040023200 | 3040024200 | 3040025200 | 3040026200 | 3040027200 | 3040029200 | |
| 18,00% | 3040021210 | 3040022210 | 3040023210 | 3040024210 | 3040025210 | 3040026210 | 3040027210 | 3040029210 | |
| 0,00% | 3040021220 | 3040022220 | 3040023220 | 3040024220 | 3040025220 | 3040026220 | 3040027220 | 3040029220 | |
| | 3040021230 | 3040022230 | 3040023230 | 3040024230 | 3040025230 | 3040026230 | 3040027230 | 3040029230 | |
| | 3040021240 | 3040022240 | 3040023240 | 3040024240 | 3040025240 | 3040026240 | 3040027240 | 3040029240 | |
| | 3040021250 | 3040022250 | 3040023250 | 3040024250 | 3040025250 | 3040026250 | 3040027250 | 3040029250 | |
| | 3040021260 | 3040022260 | 3040023260 | 3040024260 | 3040025260 | 3040026260 | 3040027260 | 3040029260 | |
| | 3040021270 | 3040022270 | 3040023270 | 3040024270 | 3040025270 | 3040026270 | 3040027270 | 3040029270 | |

| | | | | | | | | | | |
|--|------------|-------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| Entités admissibles pour un facteur de 0 % | 3040010330 | 0,00% | 3040011330 | 3040012330 | 3040013330 | 3040014330 | 3040015330 | 3040016330 | 3040017330 | 3040019330 |
| Notés - AAA | 3040010340 | | 3040011340 | 3040012340 | 3040013340 | 3040014340 | 3040015340 | 3040016340 | 3040017340 | 3040019340 |
| Notés - AA | 3040010350 | | 3040011350 | 3040012350 | 3040013350 | 3040014350 | 3040015350 | 3040016350 | 3040017350 | 3040019350 |
| Notés - A | 3040010360 | | 3040011360 | 3040012360 | 3040013360 | 3040014360 | 3040015360 | 3040016360 | 3040017360 | 3040019360 |
| Notés - BBB | 3040010370 | | 3040011370 | 3040012370 | 3040013370 | 3040014370 | 3040015370 | 3040016370 | 3040017370 | 3040019370 |
| Redistribution de l'exposition pour une sûreté / garantie | 3040010380 | | 3040011380 | 3040012380 | 3040013380 | 3040014380 | 3040015380 | 3040016380 | 3040017380 | 3040019380 |

| | | | | | | | | |
|-------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| 0,00% | 3040021330 | 3040022330 | 3040023330 | 3040024330 | 3040025330 | 3040026330 | 3040027330 | 3040029330 |
| | 3040021340 | 3040022340 | 3040023340 | 3040024340 | 3040025340 | 3040026340 | 3040027340 | 3040029340 |
| | 3040021350 | 3040022350 | 3040023350 | 3040024350 | 3040025350 | 3040026350 | 3040027350 | 3040029350 |
| | 3040021360 | 3040022360 | 3040023360 | 3040024360 | 3040025360 | 3040026360 | 3040027360 | 3040029360 |
| | 3040021370 | 3040022370 | 3040023370 | 3040024370 | 3040025370 | 3040026370 | 3040027370 | 3040029370 |
| | 3040021380 | 3040022380 | 3040023380 | 3040024380 | 3040025380 | 3040026380 | 3040027380 | 3040029380 |

Échéance moyenne (facteurs fondés sur une notation externe)

| | | | | | | | | | | |
|-------------|--|--|------------|------------|------------|------------|------------|--|--|--|
| Notés - AAA | | | 3040012280 | 3040013280 | 3040014280 | 3040015280 | 3040016280 | | | |
| Notés - AA | | | 3040012290 | 3040013290 | 3040014290 | 3040015290 | 3040016290 | | | |
| Notés - A | | | 3040012300 | 3040013300 | 3040014300 | 3040015300 | 3040016300 | | | |
| Notés - BBB | | | 3040012310 | 3040013310 | 3040014310 | 3040015310 | 3040016310 | | | |

| | | | | | | | | | |
|--|--|------------|------------|------------|------------|------------|--|--|--|
| | | 3040022280 | 3040023280 | 3040024280 | 3040025280 | 3040026280 | | | |
| | | 3040022290 | 3040023290 | 3040024290 | 3040025290 | 3040026290 | | | |
| | | 3040022300 | 3040023300 | 3040024300 | 3040025300 | 3040026300 | | | |
| | | 3040022310 | 3040023310 | 3040024310 | 3040025310 | 3040026310 | | | |

| | | | | | | | | | | |
|---|------------|--------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| Prêts hypothécaires garantis par la SCHL | 3040010010 | 0,00% | 3040011010 | 3040012010 | 3040013010 | 3040014010 | 3040015010 | 3040016010 | 3040017010 | 3040019010 |
| Autres prêts hypothécaires assurés ¹ | 3040010020 | 2,00% | 3040011020 | 3040012020 | 3040013020 | 3040014020 | 3040015020 | 3040016020 | 3040017020 | 3040019020 |
| Prêts hypothécaires résidentiels admissibles ² | 3040010030 | 2,00% | 3040011030 | 3040012030 | 3040013030 | 3040014030 | 3040015030 | 3040016030 | 3040017030 | 3040019030 |
| Prêts hypothécaires commerciaux | 3040010040 | 6,00% | 3040011040 | 3040012040 | 3040013040 | 3040014040 | 3040015040 | 3040016040 | 3040017040 | 3040019040 |
| Prêts hypothécaires résidentiels non admissibles | 3040010050 | 6,00% | 3040011050 | 3040012050 | 3040013050 | 3040014050 | 3040015050 | 3040016050 | 3040017050 | 3040019050 |
| Prêts hypothécaires garantis par des terrains non aménagés | 3040010060 | 10,00% | 3040011060 | 3040012060 | 3040013060 | 3040014060 | 3040015060 | 3040016060 | 3040017060 | 3040019060 |
| Partie d'un prêt hypothécaire qui est fondée sur une augmentation de valeur due à un changement de vocation | 3040010070 | 10,00% | 3040011070 | 3040012070 | 3040013070 | 3040014070 | 3040015070 | 3040016070 | 3040017070 | 3040019070 |
| Prêts hypothécaires dépréciés et restructurés ³ | 3040010080 | 18,00% | 3040011080 | 3040012080 | 3040013080 | 3040014080 | 3040015080 | 3040016080 | 3040017080 | 3040019080 |
| Notés - AAA | 3040010090 | | 3040011090 | 3040012090 | 3040013090 | 3040014090 | 3040015090 | 3040016090 | 3040017090 | 3040019090 |
| Notés - AA | 3040010100 | | 3040011100 | 3040012100 | 3040013100 | 3040014100 | 3040015100 | 3040016100 | 3040017100 | 3040019100 |
| Notés - A | 3040010110 | | 3040011110 | 3040012110 | 3040013110 | 3040014110 | 3040015110 | 3040016110 | 3040017110 | 3040019110 |
| Notés - BBB | 3040010120 | | 3040011120 | 3040012120 | 3040013120 | 3040014120 | 3040015120 | 3040016120 | 3040017120 | 3040019120 |
| Exigence de capital | 3040010130 | | 3040011130 | 3040012130 | 3040013130 | 3040014130 | 3040015130 | 3040016130 | 3040017130 | 3040019130 |

| | | | | | | | | |
|--------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| 0,00% | 3040021010 | 3040022010 | 3040023010 | 3040024010 | 3040025010 | 3040026010 | 3040027010 | 3040029010 |
| 2,00% | 3040021020 | 3040022020 | 3040023020 | 3040024020 | 3040025020 | 3040026020 | 3040027020 | 3040029020 |
| 2,00% | 3040021030 | 3040022030 | 3040023030 | 3040024030 | 3040025030 | 3040026030 | 3040027030 | 3040029030 |
| 6,00% | 3040021040 | 3040022040 | 3040023040 | 3040024040 | 3040025040 | 3040026040 | 3040027040 | 3040029040 |
| 6,00% | 3040021050 | 3040022050 | 3040023050 | 3040024050 | 3040025050 | 3040026050 | 3040027050 | 3040029050 |
| 10,00% | 3040021060 | 3040022060 | 3040023060 | 3040024060 | 3040025060 | 3040026060 | 3040027060 | 3040029060 |
| 10,00% | 3040021070 | 3040022070 | 3040023070 | 3040024070 | 3040025070 | 3040026070 | 3040027070 | 3040029070 |
| 18,00% | 3040021080 | 3040022080 | 3040023080 | 3040024080 | 3040025080 | 3040026080 | 3040027080 | 3040029080 |
| | 3040021090 | 3040022090 | 3040023090 | 3040024090 | 3040025090 | 3040026090 | 3040027090 | 3040029090 |
| | 3040021100 | 3040022100 | 3040023100 | 3040024100 | 3040025100 | 3040026100 | 3040027100 | 3040029100 |
| | 3040021110 | 3040022110 | 3040023110 | 3040024110 | 3040025110 | 3040026110 | 3040027110 | 3040029110 |
| | 3040021120 | 3040022120 | 3040023120 | 3040024120 | 3040025120 | 3040026120 | 3040027120 | 3040029120 |
| | 3040021130 | 3040022130 | 3040023130 | 3040024130 | 3040025130 | 3040026130 | 3040027130 | 3040029130 |

¹ Voir les sections 3.1.6 et 3.3 de la Ligne directrice ESCAP au sujet de l'assurance hypothécaire, autre que

30.500

Risque de crédit

Comptes débiteurs, créances recouvrables et autres actifs

(en milliers de dollars)

| | TOTAL | | Produits sans participation | | | | Produits avec participation | | | |
|--|---------------------|------------|-----------------------------|---|-------------------|---------------------|-----------------------------|---|-------------------|---------------------|
| | Exigence de capital | | Montant | Redistribution de l'exposition pour une sûreté / garantie | Facteur de risque | Exigence de capital | Montant | Redistribution de l'exposition pour une sûreté / garantie | Facteur de risque | Exigence de capital |
| Espèces conservées dans les locaux de l'assureur | | 3050011010 | | | 0,0% | | 3050014010 | | | 0,0% |
| Autre encaisse | 3050010020 | | 3050011020 | | 0,3% | 3050013020 | | 3050014020 | | 0,3% |
| Actifs détenus pour la vente (ADV) - option par facteur ¹ | 3050010030 | | 3050011030 | | 20,0% | 3050013030 | | 3050014030 | | 20,0% |
| Actifs détenus pour la vente (ADV) - option de reclassement ¹ | 3050010040 | | 3050011040 | | | 3050013040 | | 3050014040 | | |
| Primes échelonnées impayées non échues | | | 3050011050 | | 0,0% | | | 3050014050 | | 0,0% |
| Primes dues / primes à recevoir / comptes débiteurs admissibles pour un facteur de 0 % | | | 3050011055 | | 0,0% | | | 3050014055 | | 0,0% |
| Primes de réassurance exigibles d'assureurs assujettis à une réglementation fédérale ou provinciale | 3050010060 | | 3050011060 | | 0,7% | 3050013060 | | 3050014060 | | 0,7% |
| Autres primes échues < 60 jours | 3050010070 | | 3050011070 | | 5,0% | 3050013070 | | 3050014070 | | 5,0% |
| Autres primes échues ≥ 60 jours | 3050010080 | | 3050011080 | | 10,0% | 3050013080 | | 3050014080 | | 10,0% |
| Comptes débiteurs découlant de réassurance agréée | 3050010090 | | 3050011090 | | 0,7% | 3050013090 | | 3050014090 | | 0,7% |
| Autres comptes débiteurs impayés < 60 jours | 3050010100 | | 3050011100 | | 5,0% | 3050013100 | | 3050014100 | | 5,0% |
| Autres comptes débiteurs impayés ≥ 60 jours | 3050010110 | | 3050011110 | | 10,0% | 3050013110 | | 3050014110 | | 10,0% |
| Avances sur police / certificat ² | | | 3050011120 | | 0,0% | | | 3050014120 | | 0,0% |
| Avances sur police / certificat ² | 3050010130 | | 3050011130 | | 10,0% | 3050013130 | | 3050014130 | | 10,0% |
| Soldes débiteurs de représentants (réduits des provisions) | 3050010140 | | 3050011140 | | 10,0% | 3050013140 | | 3050014140 | | 10,0% |
| Actifs de réassurance découlant de réassurance agréée (créances recouvrables) | 3050010160 | | 3050011160 | | 2,5% | 3050013160 | | 3050014160 | | 2,5% |
| Actifs d'impôt exigible | | | 3050011170 | | 0,0% | | | 3050014170 | | 0,0% |
| Actifs d'impôt différé déduits du capital | | | 3050011180 | | 0,0% | | | 3050014180 | | 0,0% |
| Actifs d'impôt différé (écarts temporaires) non déduits du capital | 3050010190 | | 3050011190 | | 25,0% | 3050013190 | | 3050014190 | | 25,0% |
| Écarts d'acquisition | | | 3050011200 | | 0,0% | | | 3050014200 | | 0,0% |
| Autres actifs incorporels (incluant ceux liés aux logiciels) | | | 3050011210 | | 0,0% | | | 3050014210 | | 0,0% |
| Régimes de retraite à prestations définies - actifs excédentaires (réduits des remboursements disponibles) | | | 3050011220 | | 0,0% | | | 3050014220 | | 0,0% |
| Régimes de retraite à prestations définies - remboursements disponibles d'actifs excédentaires | 3050010230 | | 3050011230 | | 10,0% | 3050013230 | | 3050014230 | | 10,0% |
| Frais payés d'avance et reportés | 3050010240 | | 3050011240 | | 10,0% | 3050013240 | | 3050014240 | | 10,0% |
| Autres actifs | 3050010250 | | 3050011250 | 3050012250 | 10,0% | 3050013250 | | 3050014250 | 3050015250 | 10,0% |
| Comptes débiteurs, créances recouvrables et autres actifs | 3050010260 | | 3050011260 | 3050012260 | | 3050013260 | | 3050014260 | 3050015260 | |

¹ Le facteur de risque est de 20 % ou utilisation d'une option de reclassement. Voir la section 3.1.8 de la Ligne directrice ESCAP.² Les avances sur police sont assujetties à un facteur de risque de 0 % ou de 10 % en vertu de la section 3.2.1 de la Ligne directrice ESCAP.

30.600

Risque de crédit
Baux et autres prêts
(en milliers de dollars)

| Total | Produits sans participation | | | | | | | Produits avec participation | | | | | | | | |
|--|-----------------------------|---------|---------|---------|---------|----------|-------------|-----------------------------|--------|---------|---------|---------|---------|----------|-------------|-------|
| | < 1 an | 1-2 ans | 2-3 ans | 3-4 ans | 4-5 ans | 5-10 ans | 10 ans et + | Total | < 1 an | 1-2 ans | 2-3 ans | 3-4 ans | 4-5 ans | 5-10 ans | 10 ans et + | Total |
| Entités admissibles pour un facteur de 0 % | 306001010 | | | | | | | | | | | | | | | |
| AAA | 306001020 | | | | | | | | | | | | | | | |
| AA | 306001030 | | | | | | | | | | | | | | | |
| A | 306001040 | | | | | | | | | | | | | | | |
| BBB | 306001050 | | | | | | | | | | | | | | | |
| BB | 306001060 | | | | | | | | | | | | | | | |
| B | 306001070 | | | | | | | | | | | | | | | |
| Inférieure à B | 306001080 | | | | | | | | | | | | | | | |
| Baux et autres prêts dépréciés et restructurés | 306001090 | | | | | | | | | | | | | | | |
| Sans notation | 306001200 | | | | | | | | | | | | | | | |
| Baux (VA des flux de trésorerie des baux) et autres prêts | 306001020 | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 306001210 | | | | | | | | | | | | | | | |

| | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--|-----------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
| Entités admissibles pour un facteur de 0 % | 306001030 | | | | | | | | | | | | | | | |
| AAA | 306001030 | | | | | | | | | | | | | | | |
| AA | 306001030 | | | | | | | | | | | | | | | |
| A | 306001030 | | | | | | | | | | | | | | | |
| BBB | 306001030 | | | | | | | | | | | | | | | |
| BB | 306001030 | | | | | | | | | | | | | | | |
| B | 306001030 | | | | | | | | | | | | | | | |
| Inférieure à B | 306001030 | | | | | | | | | | | | | | | |
| Baux et autres prêts dépréciés et restructurés | 306001030 | | | | | | | | | | | | | | | |
| Sans notation | 306001040 | | | | | | | | | | | | | | | |
| Redistribution de l'exposition pour une sûreté / garantie | 306001040 | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 306001410 | | | | | | | | | | | | | | | |

Échéance moyenne

| | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
| AAA | | | | | | | | | | | | | | | | |
| AA | | | | | | | | | | | | | | | | |
| A | | | | | | | | | | | | | | | | |
| BBB | | | | | | | | | | | | | | | | |
| BB | | | | | | | | | | | | | | | | |
| B | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Inférieure à B | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Baux et autres prêts dépréciés et restructurés | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Sans notation | | | | | | | | | | | | | | | | |

| | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--|-----------|---|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
| AAA | 306001000 | 0 | | | | | | | | | | | | | | |
| AA | 306001020 | 0 | | | | | | | | | | | | | | |
| A | 306001030 | 0 | | | | | | | | | | | | | | |
| BBB | 306001040 | 0 | | | | | | | | | | | | | | |
| BB | 306001050 | 0 | | | | | | | | | | | | | | |
| B | 306001060 | 0 | | | | | | | | | | | | | | |
| Inférieure à B | 306001070 | 0 | | | | | | | | | | | | | | |
| Baux et autres prêts dépréciés et restructurés | 306001080 | 0 | | | | | | | | | | | | | | |
| Sans notation | 306001090 | 0 | | | | | | | | | | | | | | |
| Exigence de capital | 306001100 | 0 | | | | | | | | | | | | | | |

* Voir la section 3.1.10 de la Ligne directrice ESCAP.

Facteurs utilisés pour calculer l'exigence de capital pour les baux et les autres prêts

| Notation | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 10 |
|--|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| AAA | 0,25% | 0,25% | 0,50% | 0,50% | 1,00% | 1,25% |
| AA | 0,25% | 0,50% | 0,75% | 1,00% | 1,25% | 1,75% |
| A | 0,75% | 1,00% | 1,75% | 1,75% | 2,00% | 3,00% |
| BBB | 1,50% | 2,75% | 3,25% | 3,75% | 4,00% | 4,75% |
| BB | 3,75% | 6,00% | 7,25% | 7,75% | 8,00% | 8,00% |
| B | 7,50% | 10,00% | 10,50% | 10,50% | 10,50% | 10,50% |
| Inférieure à B | 15,50% | 18,00% | 18,00% | 18,00% | 18,00% | 18,00% |
| Baux et autres prêts dépréciés et restructurés | 18,00% | 18,00% | 18,00% | 18,00% | 18,00% | 18,00% |
| Sans notation | 6,00% | 6,00% | 6,00% | 6,00% | 6,00% | 6,00% |

40.100

Risque de crédit
Activités hors bilan

(en milliers de dollars)

| Total | | Produits sans participation | | | | | | Produits avec participation | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--------------------------|--|---|--|------------------|-----------------------------|--|---------------------|--|---|--|------------------|-----------------------------|--|---------------------|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|-----------------------------------|------------|--|------------|
| Exigence de capital | Exposition (équivalent-crédit ou montant d'exposition) | Ajustment pour l'exposition à une sûreté (transactions sur les marchés de capitaux) | Redistribution de l'exposition pour une sûreté / garantie ¹ | Exposition nette | Notation de la contrepartie | Moyenne pondérée des échéances des expositions | Exigence de capital | Exposition (équivalent-crédit ou montant d'exposition) | Ajustment pour l'exposition à une sûreté (transactions sur les marchés de capitaux) | Redistribution de l'exposition pour une sûreté / garantie ¹ | Exposition nette | Notation de la contrepartie | Moyenne pondérée des échéances des expositions | Exigence de capital | | | | | | | | | | | | |
| <i>Dérivés hors cote</i> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 4010010010 | | 4010011010 | | 4010012010 | | 4010013010 | | 4010014010 | | Admissible pour un facteur de 0 % | 4010015010 | | 4010016010 | | 4010021010 | | 4010022010 | | 4010023010 | | 4010024010 | | Admissible pour un facteur de 0 % | 4010025010 | | 4010026010 |
| 4010010020 | | 4010011020 | | 4010012020 | | 4010013020 | | 4010014020 | | AAA | 4010015020 | | 4010016020 | | 4010021020 | | 4010022020 | | 4010023020 | | 4010024020 | | AAA | 4010025020 | | 4010026020 |
| 4010010030 | | 4010011030 | | 4010012030 | | 4010013030 | | 4010014030 | | AA | 4010015030 | | 4010016030 | | 4010021030 | | 4010022030 | | 4010023030 | | 4010024030 | | AA | 4010025030 | | 4010026030 |
| 4010010040 | | 4010011040 | | 4010012040 | | 4010013040 | | 4010014040 | | A | 4010015040 | | 4010016040 | | 4010021040 | | 4010022040 | | 4010023040 | | 4010024040 | | A | 4010025040 | | 4010026040 |
| 4010010050 | | 4010011050 | | 4010012050 | | 4010013050 | | 4010014050 | | BBB | 4010015050 | | 4010016050 | | 4010021050 | | 4010022050 | | 4010023050 | | 4010024050 | | BBB | 4010025050 | | 4010026050 |
| 4010010060 | | 4010011060 | | 4010012060 | | 4010013060 | | 4010014060 | | BB | 4010015060 | | 4010016060 | | 4010021060 | | 4010022060 | | 4010023060 | | 4010024060 | | BB | 4010025060 | | 4010026060 |
| 4010010070 | | 4010011070 | | 4010012070 | | 4010013070 | | 4010014070 | | B | 4010015070 | | 4010016070 | | 4010021070 | | 4010022070 | | 4010023070 | | 4010024070 | | B | 4010025070 | | 4010026070 |
| 4010010080 | | 4010011080 | | 4010012080 | | 4010013080 | | 4010014080 | | Inférieure à B | 4010015080 | | 4010016080 | | 4010021080 | | 4010022080 | | 4010023080 | | 4010024080 | | Inférieure à B | 4010025080 | | 4010026080 |
| 4010010090 | | 4010011090 | | 4010012090 | | 4010013090 | | 4010014090 | | Sans notation | 4010015090 | | 4010016090 | | 4010021090 | | 4010022090 | | 4010023090 | | 4010024090 | | Sans notation | 4010025090 | | 4010026090 |

Transactions assimilables aux pensions²

| | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|-----------------------------------|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|-----------------------------------|------------|--|------------|
| 4010010100 | | 4010011100 | | 4010012100 | | 4010013100 | | 4010014100 | | Admissible pour un facteur de 0 % | 4010015100 | | 4010016100 | | 4010021100 | | 4010022100 | | 4010023100 | | 4010024100 | | Admissible pour un facteur de 0 % | 4010025100 | | 4010026100 |
| 4010010110 | | 4010011110 | | 4010012110 | | 4010013110 | | 4010014110 | | AAA | 4010015110 | | 4010016110 | | 4010021110 | | 4010022110 | | 4010023110 | | 4010024110 | | AAA | 4010025110 | | 4010026110 |
| 4010010120 | | 4010011120 | | 4010012120 | | 4010013120 | | 4010014120 | | AA | 4010015120 | | 4010016120 | | 4010021120 | | 4010022120 | | 4010023120 | | 4010024120 | | AA | 4010025120 | | 4010026120 |
| 4010010130 | | 4010011130 | | 4010012130 | | 4010013130 | | 4010014130 | | A | 4010015130 | | 4010016130 | | 4010021130 | | 4010022130 | | 4010023130 | | 4010024130 | | A | 4010025130 | | 4010026130 |
| 4010010140 | | 4010011140 | | 4010012140 | | 4010013140 | | 4010014140 | | BBB | 4010015140 | | 4010016140 | | 4010021140 | | 4010022140 | | 4010023140 | | 4010024140 | | BBB | 4010025140 | | 4010026140 |
| 4010010150 | | 4010011150 | | 4010012150 | | 4010013150 | | 4010014150 | | BB | 4010015150 | | 4010016150 | | 4010021150 | | 4010022150 | | 4010023150 | | 4010024150 | | BB | 4010025150 | | 4010026150 |
| 4010010160 | | 4010011160 | | 4010012160 | | 4010013160 | | 4010014160 | | B | 4010015160 | | 4010016160 | | 4010021160 | | 4010022160 | | 4010023160 | | 4010024160 | | B | 4010025160 | | 4010026160 |
| 4010010170 | | 4010011170 | | 4010012170 | | 4010013170 | | 4010014170 | | Inférieure à B | 4010015170 | | 4010016170 | | 4010021170 | | 4010022170 | | 4010023170 | | 4010024170 | | Inférieure à B | 4010025170 | | 4010026170 |
| 4010010180 | | 4010011180 | | 4010012180 | | 4010013180 | | 4010014180 | | Sans notation | 4010015180 | | 4010016180 | | 4010021180 | | 4010022180 | | 4010023180 | | 4010024180 | | Sans notation | 4010025180 | | 4010026180 |

Engagements

| | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|------------|--|------------|--|--|--|------------|--|------------|--|-----------------------------------|------------|--|------------|--|------------|--|--|--|------------|--|------------|--|-----------------------------------|------------|--|------------|
| 4010010190 | | 4010011190 | | | | 4010013190 | | 4010014190 | | Admissible pour un facteur de 0 % | 4010015190 | | 4010016190 | | 4010021190 | | | | 4010023190 | | 4010024190 | | Admissible pour un facteur de 0 % | 4010025190 | | 4010026190 |
| 4010010200 | | 4010011200 | | | | 4010013200 | | 4010014200 | | AAA | 4010015200 | | 4010016200 | | 4010021200 | | | | 4010023200 | | 4010024200 | | AAA | 4010025200 | | 4010026200 |
| 4010010210 | | 4010011210 | | | | 4010013210 | | 4010014210 | | AA | 4010015210 | | 4010016210 | | 4010021210 | | | | 4010023210 | | 4010024210 | | AA | 4010025210 | | 4010026210 |
| 4010010220 | | 4010011220 | | | | 4010013220 | | 4010014220 | | A | 4010015220 | | 4010016220 | | 4010021220 | | | | 4010023220 | | 4010024220 | | A | 4010025220 | | 4010026220 |
| 4010010230 | | 4010011230 | | | | 4010013230 | | 4010014230 | | BBB | 4010015230 | | 4010016230 | | 4010021230 | | | | 4010023230 | | 4010024230 | | BBB | 4010025230 | | 4010026230 |
| 4010010240 | | 4010011240 | | | | 4010013240 | | 4010014240 | | BB | 4010015240 | | 4010016240 | | 4010021240 | | | | 4010023240 | | 4010024240 | | BB | 4010025240 | | 4010026240 |
| 4010010250 | | 4010011250 | | | | 4010013250 | | 4010014250 | | B | 4010015250 | | 4010016250 | | 4010021250 | | | | 4010023250 | | 4010024250 | | B | 4010025250 | | 4010026250 |
| 4010010260 | | 4010011260 | | | | 4010013260 | | 4010014260 | | Inférieure à B | 4010015260 | | 4010016260 | | 4010021260 | | | | 4010023260 | | 4010024260 | | Inférieure à B | 4010025260 | | 4010026260 |
| 4010010270 | | 4010011270 | | | | 4010013270 | | 4010014270 | | Sans notation | 4010015270 | | 4010016270 | | 4010021270 | | | | 4010023270 | | 4010024270 | | Sans notation | 4010025270 | | 4010026270 |

Substituts directs de crédit et autres éléments hors bilan³

| | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|------------|--|------------|--|--|--|------------|--|------------|--|-----------------------------------|------------|--|------------|--|------------|--|--|--|------------|--|------------|--|-----------------------------------|------------|--|------------|
| 4010010280 | | 4010011280 | | | | 4010013280 | | 4010014280 | | Admissible pour un facteur de 0 % | 4010015280 | | 4010016280 | | 4010021280 | | | | 4010023280 | | 4010024280 | | Admissible pour un facteur de 0 % | 4010025280 | | 4010026280 |
| 4010010290 | | 4010011290 | | | | 4010013290 | | 4010014290 | | AAA | 4010015290 | | 4010016290 | | 4010021290 | | | | 4010023290 | | 4010024290 | | AAA | 4010025290 | | 4010026290 |
| 4010010300 | | 4010011300 | | | | 4010013300 | | 4010014300 | | AA | 4010015300 | | 4010016300 | | 4010021300 | | | | 4010023300 | | 4010024300 | | AA | 4010025300 | | 4010026300 |
| 4010010310 | | 4010011310 | | | | 4010013310 | | 4010014310 | | A | 4010015310 | | 4010016310 | | 4010021310 | | | | 4010023310 | | 4010024310 | | A | 4010025310 | | 4010026310 |
| 4010010320 | | 4010011320 | | | | 4010013320 | | 4010014320 | | BBB | 4010015320 | | 4010016320 | | 4010021320 | | | | 4010023320 | | 4010024320 | | BBB | 4010025320 | | 4010026320 |
| 4010010330 | | 4010011330 | | | | 4010013330 | | 4010014330 | | BB | 4010015330 | | 4010016330 | | 4010021330 | | | | 4010023330 | | 4010024330 | | BB | 4010025330 | | 4010026330 |
| 4010010340 | | 4010011340 | | | | 4010013340 | | 4010014340 | | B | 4010015340 | | 4010016340 | | 4010021340 | | | | 4010023340 | | 4010024340 | | B | 4010025340 | | 4010026340 |
| 4010010350 | | 4010011350 | | | | 4010013350 | | 4010014350 | | Inférieure à B | 4010015350 | | 4010016350 | | 4010021350 | | | | 4010023350 | | 4010024350 | | Inférieure à B | 4010025350 | | 4010026350 |
| 4010010360 | | 4010011360 | | | | 4010013360 | | 4010014360 | | Sans notation | 4010015360 | | 4010016360 | | 4010021360 | | | | 4010023360 | | 4010024360 | | Sans notation | 4010025360 | | 4010026360 |

4010011370

4010016370

4010026370

Information : Titres donnés en garantie ou prêtés en vertu de transactions assimilables aux pensions dont l'exigence de capital est supérieure à celle pour l'exposition à la contrepartie

Total du montant et de l'exigence de capital pour les titres sous-jacents

| | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|------------|--|------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|------------|
| 4010010380 | | 4010011380 | | | | | | | | | | | 4010016380 | | | | | | | | | | | | | 4010026380 |
|------------|--|------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|------------|

Exposition et exigence de capital pour les contreparties à ces transactions

| | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|------------|--|------------|--|------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|------------|--|--|--|------------|--|--|--|--|--|--|--|------------|
| 4010010390 | | 4010011390 | | 4010012390 | | | | | | | | | | 4010016390 | | | | 4010022390 | | | | | | | | 4010026390 |
|------------|--|------------|--|------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|------------|--|--|--|------------|--|--|--|--|--|--|--|------------|

¹ Pour les dérivés et les transactions assimilables aux pensions, cette colonne peut être seulement utilisée pour refléter les garanties.² Exigences pour les contreparties seulement. Les expositions pour lesquelles l'exigence de capital des instruments donnés en garantie ou prêtés est supérieure à celle de la contrepartie sont exclues.³ Inclut l'offre de protection de crédit (voir la section 3.1.11 de la Ligne directrice ESCAP).

40.200

Risque de crédit Contrats sur dérivés

(en milliers de dollars)

1 de 2

| | | Contrats sur dérivés de crédit | | Contrats sur taux d'intérêt | Contrats sur devises et or | Contrats sur actions | Contrats sur métaux précieux (autres que l'or) | Autres contrats sur produits de base | Total - contrats | | | | | | | |
|--|--|--------------------------------|--------------|-----------------------------|----------------------------|----------------------|---|---|------------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| | | Garant | Bénéficiaire | Total | Total | Total | Total | Total | Total | | | | | | | |
| Tous les instruments dérivés - montant de principal notionnel | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Échéance résiduelle d'un an ou moins | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Hors cote | Contrats à terme | | | 4020012010 | | 4020013010 | | 4020014010 | | 4020015010 | | 4020016010 | | 4020017010 | | |
| | Swaps | 4020010020 | | 4020011020 | | 4020012020 | | 4020013020 | | 4020014020 | | 4020015020 | | 4020016020 | 4020017020 | |
| | Options achetées | | | 4020011030 | | 4020012030 | | 4020013030 | | 4020014030 | | 4020015030 | | 4020016030 | 4020017030 | |
| | Options souscrites | 4020010040 | | | | 4020012040 | | 4020013040 | | 4020014040 | | 4020015040 | | 4020016040 | 4020017040 | |
| | Total | 4020010050 | | 4020011050 | | 4020012050 | | 4020013050 | | 4020014050 | | 4020015050 | | 4020016050 | 4020017050 | |
| Inscrites à la bourse | Contrats à terme standardisés - position longue | | | | | 4020012060 | | 4020013060 | | 4020014060 | | 4020015060 | | 4020016060 | 4020017060 | |
| | Contrats à terme standardisés - position courte | | | | | 4020012070 | | 4020013070 | | 4020014070 | | 4020015070 | | 4020016070 | 4020017070 | |
| | Options achetées | | | | | 4020012080 | | 4020013080 | | 4020014080 | | 4020015080 | | 4020016080 | 4020017080 | |
| | Options souscrites | | | | | 4020012090 | | 4020013090 | | 4020014090 | | 4020015090 | | 4020016090 | 4020017090 | |
| | Total | | | | | 4020012100 | | 4020013100 | | 4020014100 | | 4020015100 | | 4020016100 | 4020017100 | |
| Total | | | 4020010110 | | 4020011110 | | 4020012110 | | 4020013110 | | 4020014110 | | 4020015110 | | 4020016110 | 4020017110 |
| Échéance résiduelle de plus d'un an jusqu'à cinq ans | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Hors cote | Contrats à terme | | | | | 4020012120 | | 4020013120 | | 4020014120 | | 4020015120 | | 4020016120 | 4020017120 | |
| | Swaps | 4020010130 | | 4020011130 | | 4020012130 | | 4020013130 | | 4020014130 | | 4020015130 | | 4020016130 | 4020017130 | |
| | Options achetées | | | 4020011140 | | 4020012140 | | 4020013140 | | 4020014140 | | 4020015140 | | 4020016140 | 4020017140 | |
| | Options souscrites | 4020010150 | | | | 4020012150 | | 4020013150 | | 4020014150 | | 4020015150 | | 4020016150 | 4020017150 | |
| | Total | 4020010160 | | 4020011160 | | 4020012160 | | 4020013160 | | 4020014160 | | 4020015160 | | 4020016160 | 4020017160 | |
| Inscrites à la bourse | Contrats à terme standardisés - position longue | | | | | 4020012170 | | 4020013170 | | 4020014170 | | 4020015170 | | 4020016170 | 4020017170 | |
| | Contrats à terme standardisés - position courte | | | | | 4020012180 | | 4020013180 | | 4020014180 | | 4020015180 | | 4020016180 | 4020017180 | |
| | Options achetées | | | | | 4020012190 | | 4020013190 | | 4020014190 | | 4020015190 | | 4020016190 | 4020017190 | |
| | Options souscrites | | | | | 4020012200 | | 4020013200 | | 4020014200 | | 4020015200 | | 4020016200 | 4020017200 | |
| | Total | | | | | 4020012210 | | 4020013210 | | 4020014210 | | 4020015210 | | 4020016210 | 4020017210 | |
| Total | | | 4020010220 | | 4020011220 | | 4020012220 | | 4020013220 | | 4020014220 | | 4020015220 | | 4020016220 | 4020017220 |
| Échéance résiduelle de plus de cinq ans | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Hors cote | Contrats à terme | | | | | 4020012230 | | 4020013230 | | 4020014230 | | 4020015230 | | 4020016230 | 4020017230 | |
| | Swaps | 4020010240 | | 4020011240 | | 4020012240 | | 4020013240 | | 4020014240 | | 4020015240 | | 4020016240 | 4020017240 | |
| | Options achetées | | | 4020011250 | | 4020012250 | | 4020013250 | | 4020014250 | | 4020015250 | | 4020016250 | 4020017250 | |
| | Options souscrites | 4020010260 | | | | 4020012260 | | 4020013260 | | 4020014260 | | 4020015260 | | 4020016260 | 4020017260 | |
| | Total | 4020010270 | | 4020011270 | | 4020012270 | | 4020013270 | | 4020014270 | | 4020015270 | | 4020016270 | 4020017270 | |
| Inscrites à la bourse | Contrats à terme standardisés - position longue | | | | | 4020012280 | | 4020013280 | | 4020014280 | | 4020015280 | | 4020016280 | 4020017280 | |
| | Contrats à terme standardisés - position courte | | | | | 4020012290 | | 4020013290 | | 4020014290 | | 4020015290 | | 4020016290 | 4020017290 | |
| | Options achetées | | | | | 4020012300 | | 4020013300 | | 4020014300 | | 4020015300 | | 4020016300 | 4020017300 | |
| | Options souscrites | | | | | 4020012310 | | 4020013310 | | 4020014310 | | 4020015310 | | 4020016310 | 4020017310 | |
| | Total | | | | | 4020012320 | | 4020013320 | | 4020014320 | | 4020015320 | | 4020016320 | 4020017320 | |
| Total | | | 4020010330 | | 4020011330 | | 4020012330 | | 4020013330 | | 4020014330 | | 4020015330 | | 4020016330 | 4020017330 |

40.300

Risque de crédit Contrats sur dérivés

(en milliers de dollars)

2 de 2

| | Contrats sur dérivés de crédit | Contrats sur taux d'intérêt | Contrats sur devises et or | Contrats sur actions | Contrats sur métaux précieux (autres que l'or) | Autres contrats sur produits de base | Total - contrats |
|--|--------------------------------|-----------------------------|----------------------------|----------------------|--|--------------------------------------|------------------|
| Expositions au risque de crédit de contrepartie - Dérivés hors cote | | | | | | | |
| Montant notionnel | 4030010010 | 4030011010 | 4030012010 | 4030013010 | 4030014010 | 4030015010 | 4030016010 |
| Coût de remplacement (valeur marchande) | | | | | | | |
| (a) Tous les contrats avant la compensation permise | | | | | | | |
| Coût de remplacement positif brut | 4030010020 | 4030011020 | 4030012020 | 4030013020 | 4030014020 | 4030015020 | 4030016020 |
| Coût de remplacement négatif brut | 4030010030 | 4030011030 | 4030012030 | 4030013030 | 4030014030 | 4030015030 | 4030016030 |
| (b) Contrats assujettis à la compensation permise | | | | | | | |
| Coût de remplacement positif brut | 4030010040 | 4030011040 | 4030012040 | 4030013040 | 4030014040 | 4030015040 | 4030016040 |
| Coût de remplacement négatif brut | 4030010050 | 4030011050 | 4030012050 | 4030013050 | 4030014050 | 4030015050 | 4030016050 |
| Coût de remplacement net | 4030010060 | 4030011060 | 4030012060 | 4030013060 | 4030014060 | 4030015060 | 4030016060 |
| (c) Total des contrats - après la compensation permise | | | | | | | |
| Coût de remplacement net | 4030010070 | 4030011070 | 4030012070 | 4030013070 | 4030014070 | 4030015070 | 4030016070 |
| Majoration pour exposition potentielle future | | | | | | | |
| Contrats non assujettis à la compensation permise | | 4030011080 | 4030012080 | 4030013080 | 4030014080 | 4030015080 | 4030016080 |
| Contrats assujettis à la compensation permise | | 4030011090 | 4030012090 | 4030013090 | 4030014090 | 4030015090 | 4030016090 |
| Montant d'équivalent-crédit | | | | | | | |
| Contrats non assujettis à la compensation permise | 4030010100 | 4030011100 | 4030012100 | 4030013100 | 4030014100 | 4030015100 | 4030016100 |
| Contrats assujettis à la compensation permise | 4030010110 | 4030011110 | 4030012110 | 4030013110 | 4030014110 | 4030015110 | 4030016110 |

Engagements et instruments hors bilan

| | Montant de principal notionnel | Facteur de conversion de crédit | Montant d'équivalent-crédit |
|--|--------------------------------|---------------------------------|-----------------------------|
| Révocables sans condition à tout moment | 4030020010 | 0% | |
| Échéance initiale d'un an ou moins | 4030020020 | 20% | 4030021020 |
| Échéance initiale de plus d'un an | 4030020030 | 50% | 4030021030 |
| Engagements portant sur des transactions hors bilan ¹ | 4030020040 | variable | 4030021040 |
| Engagements | 4030020050 | | 4030021050 |
| Dérivés de crédit vendus | 4030020060 | 100% | 4030021060 |
| Autres substituts directs de crédit | 4030020070 | 100% | 4030021070 |
| Éventualités liées à des transactions | 4030020080 | 50% | 4030021080 |
| Éventualités à court terme à dénouement automatique liées à des activités commerciales | 4030020090 | 20% | 4030021090 |
| Engagements de mise et de prise en pension ² | 4030020100 | 100% | 4030021100 |
| Achats à terme d'actifs ² | 4030020110 | 100% | 4030021110 |
| Dépôts terme contre terme | 4030020120 | 100% | 4030021120 |
| Actions et titres partiellement libérés | 4030020130 | 100% | 4030021130 |
| Facilités d'émission garantie et facilités de prise ferme renouvelables | 4030020140 | 50% | 4030021140 |
| Substituts directs de crédit et instruments hors bilan | 4030020150 | | 4030021150 |

¹ Engagements pour lesquels les éléments hors bilan exigent un facteur de conversion en équivalent-crédit inférieur à celui de l'engagement.

² Comprendent seulement les éléments d'actif sans participation qui seront achetés ou rachetés et qui ne figurent pas au bilan. Toutes les expositions sur actions hors bilan doivent être déclarées à page 50.200.

50.100

Risque de marché Risque de taux d'intérêt

(en milliers de dollars)

| VA des flux de trésorerie nets (incluant les PÉD) : | Produits sans participation | | | | | | | | | | |
|---|-----------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|--|--|--|--|
| | TOTAL | CANADA | É-U. | R.-U. | EUROPE | JAPON | AUTRES | | | | |
| Taux d'actualisation du scénario initial | 5010020010 | 5010021010 | 5010022010 | 5010023010 | 5010024010 | 5010025010 | 5010029010 | | | | |
| Scénario 1 | 5010020020 | 5010021020 | 5010022020 | 5010023020 | 5010024020 | 5010025020 | 5010029020 | | | | |
| Scénario 2 | 5010020030 | 5010021030 | 5010022030 | 5010023030 | 5010024030 | 5010025030 | 5010029030 | | | | |
| Scénario 3 | 5010020040 | 5010021040 | 5010022040 | 5010023040 | 5010024040 | 5010025040 | 5010029040 | | | | |
| Scénario 4 | 5010020050 | 5010021050 | 5010022050 | 5010023050 | 5010024050 | 5010025050 | 5010029050 | | | | |
| <i>Pire scénario commun (CANADA/É.-U.)</i> | | | | | | | | | | | |
| <i>Pire scénario (autres que CANADA/É.-U.)</i> | | | | | | | | | | | |
| VA des flux de trésorerie nets (incluant les PÉD) selon scénario commun sélectionné / pires scénarios | 5010020080 | 5010021080 | 5010022080 | 5010023080 | 5010024080 | 5010025080 | 5010029080 | | | | |
| Capital requis pour les produits sans participation | 5010020090 | 5010021090 | 5010022090 | 5010023090 | 5010024090 | 5010025090 | 5010029090 | | | | |

| VA des flux de trésorerie nets (incluant les PÉD) : | Produits avec participation (sans transfert) | | | | | | | | | | |
|---|--|------------|------------|------------|------------|------------|------------|--|--|--|--|
| | TOTAL | CANADA | É-U. | R.-U. | EUROPE | JAPON | AUTRES | | | | |
| Taux d'actualisation du scénario initial | 5010030010 | 5010031010 | 5010032010 | 5010033010 | 5010034010 | 5010035010 | 5010039010 | | | | |
| Scénario 1 | 5010030020 | 5010031020 | 5010032020 | 5010033020 | 5010034020 | 5010035020 | 5010039020 | | | | |
| Scénario 2 | 5010030030 | 5010031030 | 5010032030 | 5010033030 | 5010034030 | 5010035030 | 5010039030 | | | | |
| Scénario 3 | 5010030040 | 5010031040 | 5010032040 | 5010033040 | 5010034040 | 5010035040 | 5010039040 | | | | |
| Scénario 4 | 5010030050 | 5010031050 | 5010032050 | 5010033050 | 5010034050 | 5010035050 | 5010039050 | | | | |
| <i>Pire scénario commun (CANADA/É.-U.)</i> | | | | | | | | | | | |
| <i>Pire scénario (autres que CANADA/É.-U.)</i> | | | | | | | | | | | |
| VA des flux de trésorerie nets (incluant les PÉD) selon scénario commun sélectionné / pires scénarios | 5010030080 | 5010031080 | 5010032080 | 5010033080 | 5010034080 | 5010035080 | 5010039080 | | | | |
| Capital requis pour les produits avec participation | 5010030090 | 5010031090 | 5010032090 | 5010033090 | 5010034090 | 5010035090 | 5010039090 | | | | |

| VA des flux de trésorerie nets (incluant les PÉD) : | Produits avec participation (avec transfert) | | | | | | | | | | |
|---|--|------------|------------|------------|------------|------------|------------|--|--|--|--|
| | TOTAL | CANADA | É-U. | R.-U. | EUROPE | JAPON | AUTRES | | | | |
| Taux d'actualisation du scénario initial | 5010030010 | 5010031010 | 5010032010 | 5010033010 | 5010034010 | 5010035010 | 5010039010 | | | | |
| Scénario 1 | 5010030020 | 5010031020 | 5010032020 | 5010033020 | 5010034020 | 5010035020 | 5010039020 | | | | |
| Scénario 2 | 5010030030 | 5010031030 | 5010032030 | 5010033030 | 5010034030 | 5010035030 | 5010039030 | | | | |
| Scénario 3 | 5010030040 | 5010031040 | 5010032040 | 5010033040 | 5010034040 | 5010035040 | 5010039040 | | | | |
| Scénario 4 | 5010030050 | 5010031050 | 5010032050 | 5010033050 | 5010034050 | 5010035050 | 5010039050 | | | | |
| <i>Pire scénario commun (CANADA/É.-U.)</i> | | | | | | | | | | | |
| <i>Pire scénario (autres que CANADA/É.-U.)</i> | | | | | | | | | | | |
| VA des flux de trésorerie nets (incluant les PÉD) selon scénario commun sélectionné / pires scénarios | 5010030080 | 5010031080 | 5010032080 | 5010033080 | 5010034080 | 5010035080 | 5010039080 | | | | |
| Capital requis pour les produits avec participation | 5010030090 | 5010031090 | 5010032090 | 5010033090 | 5010034090 | 5010035090 | 5010039090 | | | | |

| VA des flux de trésorerie nets (incluant les PÉD) : | TOTAL | | | | | | | | | | |
|---|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| | TOTAL | CANADA | É-U. | R.-U. | EUROPE | JAPON | AUTRES | | | | |
| Taux d'actualisation du scénario initial | 5010010010 | 5010011010 | 5010012010 | 5010013010 | 5010014010 | 5010015010 | 5010019010 | | | | |
| Scénario 1 | 5010010020 | 5010011020 | 5010012020 | 5010013020 | 5010014020 | 5010015020 | 5010019020 | | | | |
| Scénario 2 | 5010010030 | 5010011030 | 5010012030 | 5010013030 | 5010014030 | 5010015030 | 5010019030 | | | | |
| Scénario 3 | 5010010040 | 5010011040 | 5010012040 | 5010013040 | 5010014040 | 5010015040 | 5010019040 | | | | |
| Scénario 4 | 5010010050 | 5010011050 | 5010012050 | 5010013050 | 5010014050 | 5010015050 | 5010019050 | | | | |
| <i>Pire scénario commun (CANADA/É.-U.)</i> | | 5010011060 | Scénario 1 | 5010012060 | Scénario 1 | | | | | | |
| <i>Pire scénario (autres que CANADA/É.-U.)</i> | | | | 5010013070 | Scénario 1 | 5010014070 | Scénario 1 | 5010015070 | Scénario 1 | 5010019070 | Scénario 1 |
| VA des flux de trésorerie nets (incluant les PÉD) selon scénario commun sélectionné / pires scénarios | 5010010080 | 5010011080 | 5010012080 | 5010013080 | 5010014080 | 5010015080 | 5010019080 | | | | |
| Capital requis total | 5010010090 | 5010011090 | 5010012090 | 5010013090 | 5010014090 | 5010015090 | 5010019090 | | | | |

50.200

Risque de marché

Risque relatif aux actions et risque lié aux actions privilégiées

(en milliers de dollars)

| | Total | | Produits sans participation | | | | Produits avec participation | | | | | |
|---|---------------------|--|-----------------------------|--|-----------------------|---------------------|-----------------------------|------------|--|-----------------------|---------------------|--|
| | Exigence de capital | | Solde | | Facteur de risque | Exigence de capital | | Solde | | Facteur de risque | Exigence de capital | |
| Positions longues brutes sur des actions ordinaires | 5020010010 | | 5020011010 | | | 5020012010 | | 5020013010 | | | 5020014010 | |
| Positions courtes brutes sur des actions ordinaires | 5020010020 | | 5020011020 | | | 5020012020 | | 5020013020 | | | 5020014020 | |
| Positions longues nettes sur des actions cotées des marchés développés qui ne constituent pas une participation notable | 5020010030 | | 5020011030 | | 35,00% | 5020012030 | | 5020013030 | | 35,00% | 5020014030 | |
| Positions courtes nettes sur des actions cotées des marchés développés qui ne constituent pas une participation notable | 5020010040 | | 5020011040 | | 35,00% | 5020012040 | | 5020013040 | | 35,00% | 5020014040 | |
| Positions longues nettes sur des actions non cotées des marchés développés ou qui constituent une participation notable | 5020010050 | | 5020011050 | | 40,00% | 5020012050 | | 5020013050 | | 40,00% | 5020014050 | |
| Positions courtes nettes sur des actions non cotées des marchés développés ou qui constituent une participation notable | 5020010060 | | 5020011060 | | 40,00% | 5020012060 | | 5020013060 | | 40,00% | 5020014060 | |
| Positions longues nettes sur des actions cotées des autres marchés qui ne constituent pas une participation notable | 5020010070 | | 5020011070 | | 45,00% | 5020012070 | | 5020013070 | | 45,00% | 5020014070 | |
| Positions courtes nettes sur des actions cotées des autres marchés qui ne constituent pas une participation notable | 5020010080 | | 5020011080 | | 45,00% | 5020012080 | | 5020013080 | | 45,00% | 5020014080 | |
| Positions longues nettes sur des actions non cotées des autres marchés ou qui constituent une participation notable | 5020010090 | | 5020011090 | | 50,00% | 5020012090 | | 5020013090 | | 50,00% | 5020014090 | |
| Positions courtes nettes sur des actions non cotées des autres marchés ou qui constituent une participation notable | 5020010100 | | 5020011100 | | 50,00% | 5020012100 | | 5020013100 | | 50,00% | 5020014100 | |
| Positions sur actions étroitement corrélées | 5020010110 | | 5020011110 | | variable ¹ | 5020012110 | | 5020013110 | | variable ¹ | 5020014110 | |
| Exigence de la matrice des scénarios pour options | 5020010120 | | 5020011120 | | variable ¹ | 5020012120 | | 5020013120 | | variable ¹ | 5020014120 | |
| Exigence réduite pour couvertures par options | 5020010130 | | 5020011130 | | variable ¹ | 5020012130 | | 5020013130 | | variable ¹ | 5020014130 | |
| Fonds communs de placement, fonds indiciaire négociable en bourse, fiducies d'investissement immobilier | 5020010140 | | 5020011140 | | variable ¹ | 5020012140 | | 5020013140 | | variable ¹ | 5020014140 | |
| Exigence de capital du risque relatif aux actions | 5020010150 | | 5020011150 | | | 5020012150 | | 5020013150 | | | 5020014150 | |

| Notation | Total | | Produits sans participation | | | | Produits avec participation | | | | | |
|---|---------------------|--|-----------------------------|--|-----------------------|---------------------|-----------------------------|------------|--|-----------------------|---------------------|--|
| | Exigence de capital | | Montant | | Facteur de risque | Exigence de capital | | Montant | | Facteur de risque | Exigence de capital | |
| P1 | 5020020010 | | 5020021010 | | 3,00% | 5020022010 | | 5020023010 | | 3,00% | 5020024010 | |
| P2 | 5020020020 | | 5020021020 | | 5,00% | 5020022020 | | 5020023020 | | 5,00% | 5020024020 | |
| P3 | 5020020030 | | 5020021030 | | 10,00% | 5020022030 | | 5020023030 | | 10,00% | 5020024030 | |
| P4 | 5020020040 | | 5020021040 | | 20,00% | 5020022040 | | 5020023040 | | 20,00% | 5020024040 | |
| P5 et sans notation | 5020020050 | | 5020021050 | | variable ² | 5020022050 | | 5020023050 | | variable ² | 5020024050 | |
| Exigence de capital du risque lié aux actions privilégiées | 5020020060 | | 5020021060 | | | 5020022060 | | 5020023060 | | | 5020024060 | |

¹ Voir le chapitre 5 de la Ligne directrice ESCAP. Inclure les renseignements détaillés du calcul et du coefficient utilisé dans le Rapport sur l'attestation relative à la ligne directrice de capital.

² Doit être conforme au facteur pertinent du risque relatif aux actions.

50.300

Risque de marché Risque lié à l'immobilier

(en milliers de dollars)

| | | TOTAL | | Produits sans participation | | Produits avec participation | |
|---|-----|------------|--|-----------------------------|--|-----------------------------|--|
| Valeur au bilan | | 5030010160 | | 5030011160 | | 5030012160 | |
| VA des flux de trésorerie des baux ¹ | | 5030010170 | | 5030011170 | | 5030012170 | |
| <i>Valeur résiduelle</i> | | 5030010180 | | 5030011180 | | 5030012180 | |
| <i>Exigence de capital pour la valeur résiduelle (30 %)</i> | | 5030010190 | | | | | |
| Immeubles de placement (composante de la valeur résiduelle)² | (A) | 5030010200 | | 5030011200 | | 5030012200 | |
| Juste valeur | | 5030010210 | | 5030011210 | | 5030012210 | |
| Valeur établie selon la moyenne mobile ou coût d'acquisition, réduit des amortissements | | 5030010220 | | 5030011220 | | 5030012220 | |
| Immeubles occupés par leur propriétaire^{2, 3} | (B) | 5030010230 | | 5030011230 | | 5030012230 | |
| Juste valeur | | 5030010240 | | 5030011240 | | 5030012240 | |
| Valeur au bilan | | 5030010250 | | 5030011250 | | 5030012250 | |
| Valeur au bilan des actifs loués | | 5030010255 | | 5030011255 | | 5030012255 | |
| Autres immobilisations corporelles | | 5030010256 | | 5030011256 | | 5030012256 | |
| Toutes les autres immobilisations corporelles (notamment, pétrole et gaz, immobilisations de production, etc.)² | (C) | 5030010260 | | 5030011260 | | 5030012260 | |
| Exigence de capital du risque lié à l'immobilier (A + B + C) | | 5030010050 | | 5030011050 | | 5030012050 | |

¹ Limité aux baux en vigueur, aucun renouvellement.

² Les renseignements détaillés des calculs doivent être inclus dans le Rapport sur l'attestation relative à la ligne directrice de capital.

³ L'exigence de capital doit être déterminée immeuble par immeuble.

50.400

Risque de marché Risque lié aux produits indexés

(en milliers de dollars)

| | Total | | | | Produits sans participation | | | | Produits avec participation | | | |
|---|--|-------------------|---------------------|--|--|-------------------|---------------------|--|--|-------------------|---------------------|--|
| | Valeur marchande des actifs adossés aux produits | Facteur de risque | Exigence de capital | | Valeur marchande des actifs adossés aux produits | Facteur de risque | Exigence de capital | | Valeur marchande des actifs adossés aux produits | Facteur de risque | Exigence de capital | |
| Simplification - facteur pour les actions ordinaires | 5040010040 | variable | 5040011040 | | 50400XXXXX | variable | 50400XXXXX | | 50400XXXXX | variable | 50400XXXXX | |
| Produits avec un $F > 25\%$ et $\leq 35\%$ ¹ | 5040010050 | variable | 5040011050 | | 50400XXXXX | variable | 50400XXXXX | | 50400XXXXX | variable | 50400XXXXX | |
| Produits avec un $F > 15\%$ et $\leq 25\%$ ¹ | 5040010060 | variable | 5040011060 | | 50400XXXXX | variable | 50400XXXXX | | 50400XXXXX | variable | 50400XXXXX | |
| Produits avec un $F > 10\%$ et $\leq 15\%$ ¹ | 5040010070 | variable | 5040011070 | | 50400XXXXX | variable | 50400XXXXX | | 50400XXXXX | variable | 50400XXXXX | |
| Produits avec un $F > 5\%$ et $\leq 10\%$ ¹ | 5040010080 | variable | 5040011080 | | 50400XXXXX | variable | 50400XXXXX | | 50400XXXXX | variable | 50400XXXXX | |
| Produits avec un $F > 2\%$ et $\leq 5\%$ ¹ | 5040010090 | variable | 5040011090 | | 50400XXXXX | variable | 50400XXXXX | | 50400XXXXX | variable | 50400XXXXX | |
| Produits avec un $F \leq 2\%$ ¹ | 5040010100 | variable | 5040011100 | | 50400XXXXX | variable | 50400XXXXX | | 50400XXXXX | variable | 50400XXXXX | |
| Exigence de capital pour les produits indexés | 5040010110 | | 5040011110 | | 50400XXXXX | | 50400XXXXX | | 50400XXXXX | | 50400XXXXX | |

| | Total | |
|--|------------------|--|
| | Montant au bilan | |
| <i>Actifs adossés aux produits indexés :</i> | | |
| <i>Actifs au bilan :</i> | | |
| Titres à court terme | 5040020010 | |
| Obligations / placements privés | 5040020020 | |
| Placements en actions | 5040020030 | |
| Unités de fonds distincts de l'assureur | 5040020040 | |
| Unités de fonds communs de placement | 5040020050 | |
| Autres actifs | 5040020060 | |
| Actifs hors bilan | 5040020070 | |
| Total - actifs adossés aux produits indexés | 5040020080 | |

| Produits sans participation | |
|-----------------------------|--|
| Montant au bilan | |
| | |
| 50400XXXXX | |
| 50400XXXXX | |
| 50400XXXXX | |
| 50400XXXXX | |
| 50400XXXXX | |
| 50400XXXXX | |
| 50400XXXXX | |
| 50400XXXXX | |

| Produits avec participation | |
|-----------------------------|--|
| Montant au bilan | |
| | |
| 50400XXXXX | |
| 50400XXXXX | |
| 50400XXXXX | |
| 50400XXXXX | |
| 50400XXXXX | |
| 50400XXXXX | |
| 50400XXXXX | |
| 50400XXXXX | |

¹ Le facteur F est défini dans la section 5.5.2 de la Ligne directrice ESCAP.

50.500

Risque de marché Risque de change

(en milliers de dollars)

| | Position ouverte nette ¹ | | Valeur des actifs (CAD) | | Valeur des passifs (CAD) | | Compensation ² (jusqu'à 120 % du Coefficient de l'exigence solvabilité individuelle de capital pour les actifs et les passifs) | | Positions ouvertes totales dans des garanties en réassurance non agréée | |
|------------------------------------|-------------------------------------|--|-------------------------|--|--------------------------|--|---|--|---|--|
| USD | 5050020010 | | 5050021010 | | 5050022010 | | 5050023010 | | 5050024010 | |
| GBP | 5050020020 | | 5050021020 | | 5050022020 | | 5050023020 | | 5050024020 | |
| EUR | 5050020030 | | 5050021030 | | 5050022030 | | 5050023030 | | 5050024030 | |
| JPY | 5050020040 | | 5050021040 | | 5050022040 | | 5050023040 | | 5050024040 | |
| Or | 5050020060 | | 5050021060 | | 5050022060 | | | | | |
| Total - devises principales | | | 5050021070 | | 5050023070 | | | | 5050025070 | |

| | Positions longues ouvertes nettes totales ³³ | | Positions courtes ouvertes nettes totales ³⁴ | | Compensation ² (jusqu'à 120 % du Coefficient de l'exigence solvabilité individuelle de capital pour les actifs et les passifs) | |
|--|---|--|---|--|---|--|
| Afrique subsaharienne | 5050030010 | | 5050031010 | | 5050032010 | |
| Asie de l'Est and Pacifique | 5050030020 | | 5050031020 | | 5050032020 | |
| Europe and Asie centrale | 5050030030 | | 5050031030 | | 5050032030 | |
| Amérique latine et Caraïbes | 5050030040 | | 5050031040 | | 5050032040 | |
| Afrique du Nord et Moyen-Orient | 5050030050 | | 5050031050 | | 5050032050 | |
| Asie du Sud | 5050030060 | | 5050031060 | | 5050032060 | |
| Exposition aux autres devises, par région | 5050030070 | | 5050031070 | | 5050032070 | |

| | TOTAL | | CANADA | | É.-U. | | R.-U. | | EUROPE | | JAPON | | AUTRES | |
|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|
| Produits sans participation | 5050040010 | | 5050041010 | | 5050042010 | | 5050043010 | | 5050044010 | | 5050045010 | | 5050049010 | |
| Produits avec participation | 5050040020 | | 5050041020 | | 5050042020 | | 5050043020 | | 5050044020 | | 5050045020 | | 5050049020 | |
| Allocation du capital requis du risque de change fondée sur la contribution de la région à l'exposition nette | 5050040030 | | 5050041030 | | 5050042030 | | 5050043030 | | 5050044030 | | 5050045030 | | 5050049030 | |

| | | |
|--|------------|------------|
| Exposition nette = maximum (Positions longues ouvertes nettes moins les compensations ; Valeur absolue des positions courtes ouvertes nettes) + Valeur absolue de la position ouverte nette sur l'or | 5050010010 | |
| Exigence de capital pour la position ouverte nette globale (30 % de l'exposition nette) | (A) | 5050010020 |
| Exigence de capital pour les positions ouvertes totales dans des garanties en réassurance non agréée (30 % des positions ouvertes totales) | (B) | 5050010030 |
| Exigence de capital pour le risque de volatilité de change relié aux options | (C) | 5050010040 |
| Capital requis du risque de change (A + B + C) | | 5050010050 |

¹ Inscrire un montant positif pour les positions longues et un montant négatif pour les positions courtes.

² Voir la section 5.6.1 de la ligne directrice ESCAP pour le calcul de la valeur de la compensation.

³ Inscrire un montant positif pour les positions longues en CAD.

⁴ Inscrire un montant négatif pour les positions courtes en CAD.

60.010

Risque d'assurance Produits sans participation

(en milliers de dollars)

| | TOTAL | | CANADA | | É.-U. | | R.-U. | | EUROPE | | JAPON | | AUTRES | |
|---|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|
| Niveau et tendance | 6001010010 | | 6001011010 | | 6001012010 | | 6001013010 | | 6001014010 | | 6001015010 | | 6001019010 | |
| Volatilité et catastrophe | 6001010020 | | 6001011020 | | 6001012020 | | 6001013020 | | 6001014020 | | 6001015020 | | 6001019020 | |
| Prestation de décès minimum garantie sur les produits indexés | 6001010030 | | 6001011030 | | 6001012030 | | 6001013030 | | 6001014030 | | 6001015030 | | 6001019030 | |
| Moins : Crédit pour volume de portefeuille | 6001010040 | | | | | | | | | | | | | |
| Mortalité | 6001010050 | | 6001011050 | | 6001012050 | | 6001013050 | | 6001014050 | | 6001015050 | | 6001019050 | |
| Niveau | 6001010060 | | 6001011060 | | 6001012060 | | 6001013060 | | 6001014060 | | 6001015060 | | 6001019060 | |
| Tendance | 6001010070 | | 6001011070 | | 6001012070 | | 6001013070 | | 6001014070 | | 6001015070 | | 6001019070 | |
| Longévité | 6001010080 | | 6001011080 | | 6001012080 | | 6001013080 | | 6001014080 | | 6001015080 | | 6001019080 | |
| Niveau | 6001010090 | | 6001011090 | | 6001012090 | | 6001013090 | | 6001014090 | | 6001015090 | | 6001019090 | |
| Tendance | 6001010100 | | 6001011100 | | 6001012100 | | 6001013100 | | 6001014100 | | 6001015100 | | 6001019100 | |
| Volatilité et catastrophe | 6001010110 | | 6001011110 | | 6001012110 | | 6001013110 | | 6001014110 | | 6001015110 | | 6001019110 | |
| Moins : Crédit pour volume de portefeuille | 6001010120 | | | | | | | | | | | | | |
| Morbidité - incidence | 6001010130 | | 6001011130 | | 6001012130 | | 6001013130 | | 6001014130 | | 6001015130 | | 6001019130 | |
| Niveau | 6001010140 | | 6001011140 | | 6001012140 | | 6001013140 | | 6001014140 | | 6001015140 | | 6001019140 | |
| Tendance | 6001010150 | | 6001011150 | | 6001012150 | | 6001013150 | | 6001014150 | | 6001015150 | | 6001019150 | |
| Moins : Crédit pour volume de portefeuille | 6001010160 | | | | | | | | | | | | | |
| Morbidité - cessation | 6001010170 | | 6001011170 | | 6001012170 | | 6001013170 | | 6001014170 | | 6001015170 | | 6001019170 | |
| Niveau et tendance | 6001010180 | | 6001011180 | | 6001012180 | | 6001013180 | | 6001014180 | | 6001015180 | | 6001019180 | |
| Volatilité et catastrophe | 6001010190 | | 6001011190 | | 6001012190 | | 6001013190 | | 6001014190 | | 6001015190 | | 6001019190 | |
| Déchéance - produits fondés sur les déchéances | 6001010200 | | 6001011200 | | 6001012200 | | 6001013200 | | 6001014200 | | 6001015200 | | 6001019200 | |
| Niveau et tendance | 6001010210 | | 6001011210 | | 6001012210 | | 6001013210 | | 6001014210 | | 6001015210 | | 6001019210 | |
| Volatilité et catastrophe | 6001010220 | | 6001011220 | | 6001012220 | | 6001013220 | | 6001014220 | | 6001015220 | | 6001019220 | |
| Déchéance - produits sensibles aux déchéances | 6001010230 | | 6001011230 | | 6001012230 | | 6001013230 | | 6001014230 | | 6001015230 | | 6001019230 | |
| Niveau, tendance, volatilité et catastrophe | 6001010240 | | 6001011240 | | 6001012240 | | 6001013240 | | 6001014240 | | 6001015240 | | 6001019240 | |
| Dépenses | 6001010250 | | 6001011250 | | 6001012250 | | 6001013250 | | 6001014250 | | 6001015250 | | 6001019250 | |
| Capital requis du risque d'assurance | 6001010260 | | 6001011260 | | 6001012260 | | 6001013260 | | 6001014260 | | 6001015260 | | 6001019260 | |
| Information | | | | | | | | | | | | | | |
| Crédit pour réassurance en excédent de pertes | 6001010270 | | 6001011270 | | 6001012270 | | 6001013270 | | 6001014270 | | 6001015270 | | 6001019270 | |

60.020

Risque d'assurance Produits ajustables

(en milliers de dollars)

| | TOTAL | | CANADA | | É.-U. | | R.-U. | | EUROPE | | JAPON | | AUTRES | |
|---|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|------------|--|
| Niveau et tendance | 6002010010 | | 6002011010 | | 6002012010 | | 6002013010 | | 6002014010 | | 6002015010 | | 6002019010 | |
| Volatilité et catastrophe | 6002010020 | | 6002011020 | | 6002012020 | | 6002013020 | | 6002014020 | | 6002015020 | | 6002019020 | |
| Prestation de décès minimum garantie sur les produits indexés | 6002010030 | | 6002011030 | | 6002012030 | | 6002013030 | | 6002014030 | | 6002015030 | | 6002019030 | |
| Moins : Crédit pour volume de portefeuille | 6002010040 | | | | | | | | | | | | | |
| Mortalité | 6002010050 | | 6002011050 | | 6002012050 | | 6002013050 | | 6002014050 | | 6002015050 | | 6002019050 | |
| Niveau | 6002010060 | | 6002011060 | | 6002012060 | | 6002013060 | | 6002014060 | | 6002015060 | | 6002019060 | |
| Tendance | 6002010070 | | 6002011070 | | 6002012070 | | 6002013070 | | 6002014070 | | 6002015070 | | 6002019070 | |
| Longévité | 6002010080 | | 6002011080 | | 6002012080 | | 6002013080 | | 6002014080 | | 6002015080 | | 6002019080 | |
| Niveau | 6002010090 | | 6002011090 | | 6002012090 | | 6002013090 | | 6002014090 | | 6002015090 | | 6002019090 | |
| Tendance | 6002010100 | | 6002011100 | | 6002012100 | | 6002013100 | | 6002014100 | | 6002015100 | | 6002019100 | |
| Volatilité et catastrophe | 6002010110 | | 6002011110 | | 6002012110 | | 6002013110 | | 6002014110 | | 6002015110 | | 6002019110 | |
| Moins : Crédit pour volume de portefeuille | 6002010120 | | | | | | | | | | | | | |
| Morbidité - incidence | 6002010130 | | 6002011130 | | 6002012130 | | 6002013130 | | 6002014130 | | 6002015130 | | 6002019130 | |
| Niveau | 6002010140 | | 6002011140 | | 6002012140 | | 6002013140 | | 6002014140 | | 6002015140 | | 6002019140 | |
| Tendance | 6002010150 | | 6002011150 | | 6002012150 | | 6002013150 | | 6002014150 | | 6002015150 | | 6002019150 | |
| Moins : Crédit pour volume de portefeuille | 6002010160 | | | | | | | | | | | | | |
| Morbidité - cessation | 6002010170 | | 6002011170 | | 6002012170 | | 6002013170 | | 6002014170 | | 6002015170 | | 6002019170 | |
| Niveau et tendance | 6002010180 | | 6002011180 | | 6002012180 | | 6002013180 | | 6002014180 | | 6002015180 | | 6002019180 | |
| Volatilité et catastrophe | 6002010190 | | 6002011190 | | 6002012190 | | 6002013190 | | 6002014190 | | 6002015190 | | 6002019190 | |
| Déchéance - produits fondés sur les déchéances | 6002010200 | | 6002011200 | | 6002012200 | | 6002013200 | | 6002014200 | | 6002015200 | | 6002019200 | |
| Niveau et tendance | 6002010210 | | 6002011210 | | 6002012210 | | 6002013210 | | 6002014210 | | 6002015210 | | 6002019210 | |
| Volatilité et catastrophe | 6002010220 | | 6002011220 | | 6002012220 | | 6002013220 | | 6002014220 | | 6002015220 | | 6002019220 | |
| Déchéance - produits sensibles aux déchéances | 6002010230 | | 6002011230 | | 6002012230 | | 6002013230 | | 6002014230 | | 6002015230 | | 6002019230 | |
| Niveau, tendance, volatilité et catastrophe | 6002010240 | | 6002011240 | | 6002012240 | | 6002013240 | | 6002014240 | | 6002015240 | | 6002019240 | |
| Dépenses | 6002010250 | | 6002011250 | | 6002012250 | | 6002013250 | | 6002014250 | | 6002015250 | | 6002019250 | |
| Capital requis du risque d'assurance | 6002010260 | | 6002011260 | | 6002012260 | | 6002013260 | | 6002014260 | | 6002015260 | | 6002019260 | |
| Information | | | | | | | | | | | | | | |
| Crédit pour réassurance en excédent de pertes | 6002010270 | | 6002011270 | | 6002012270 | | 6002013270 | | 6002014270 | | 6002015270 | | 6002019270 | |

60.030

Risque d'assurance Produits avec participation

(en milliers de dollars)

| | TOTAL | CANADA | É.-U. | R.-U. | EUROPE | JAPON | AUTRES |
|---|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| Niveau et tendance | 6003010010 | 6003011010 | 6003012010 | 6003013010 | 6003014010 | 6003015010 | 6003019010 |
| Volatilité et catastrophe | 6003010020 | 6003011020 | 6003012020 | 6003013020 | 6003014020 | 6003015020 | 6003019020 |
| Prestation de décès minimum garantie sur les produits indexés | 6003010030 | 6003011030 | 6003012030 | 6003013030 | 6003014030 | 6003015030 | 6003019030 |
| Moins : Crédit pour volume de portefeuille | 6003010040 | | | | | | |
| Mortalité | 6003010050 | 6003011050 | 6003012050 | 6003013050 | 6003014050 | 6003015050 | 6003019050 |
| Niveau | 6003010060 | 6003011060 | 6003012060 | 6003013060 | 6003014060 | 6003015060 | 6003019060 |
| Tendance | 6003010070 | 6003011070 | 6003012070 | 6003013070 | 6003014070 | 6003015070 | 6003019070 |
| Longévité | 6003010080 | 6003011080 | 6003012080 | 6003013080 | 6003014080 | 6003015080 | 6003019080 |
| Niveau | 6003010090 | 6003011090 | 6003012090 | 6003013090 | 6003014090 | 6003015090 | 6003019090 |
| Tendance | 6003010100 | 6003011100 | 6003012100 | 6003013100 | 6003014100 | 6003015100 | 6003019100 |
| Volatilité et catastrophe | 6003010110 | 6003011110 | 6003012110 | 6003013110 | 6003014110 | 6003015110 | 6003019110 |
| Moins : Crédit pour volume de portefeuille | 6003010120 | | | | | | |
| Morbidité - incidence | 6003010130 | 6003011130 | 6003012130 | 6003013130 | 6003014130 | 6003015130 | 6003019130 |
| Niveau | 6003010140 | 6003011140 | 6003012140 | 6003013140 | 6003014140 | 6003015140 | 6003019140 |
| Tendance | 6003010150 | 6003011150 | 6003012150 | 6003013150 | 6003014150 | 6003015150 | 6003019150 |
| Moins : Crédit pour volume de portefeuille | 6003010160 | | | | | | |
| Morbidité - cessation | 6003010170 | 6003011170 | 6003012170 | 6003013170 | 6003014170 | 6003015170 | 6003019170 |
| Niveau et tendance | 6003010180 | 6003011180 | 6003012180 | 6003013180 | 6003014180 | 6003015180 | 6003019180 |
| Volatilité et catastrophe | 6003010190 | 6003011190 | 6003012190 | 6003013190 | 6003014190 | 6003015190 | 6003019190 |
| Déchéance - produits fondés sur les déchéances | 6003010200 | 6003011200 | 6003012200 | 6003013200 | 6003014200 | 6003015200 | 6003019200 |
| Niveau et tendance | 6003010210 | 6003011210 | 6003012210 | 6003013210 | 6003014210 | 6003015210 | 6003019210 |
| Volatilité et catastrophe | 6003010220 | 6003011220 | 6003012220 | 6003013220 | 6003014220 | 6003015220 | 6003019220 |
| Déchéance - produits sensibles aux déchéances | 6003010230 | 6003011230 | 6003012230 | 6003013230 | 6003014230 | 6003015230 | 6003019230 |
| Niveau, tendance, volatilité et catastrophe | 6003010240 | 6003011240 | 6003012240 | 6003013240 | 6003014240 | 6003015240 | 6003019240 |
| Dépenses | 6003010250 | 6003011250 | 6003012250 | 6003013250 | 6003014250 | 6003015250 | 6003019250 |
| Capital requis du risque d'assurance | 6003010260 | 6003011260 | 6003012260 | 6003013260 | 6003014260 | 6003015260 | 6003019260 |
| Information | | | | | | | |
| Crédit pour réassurance en excédent de pertes | 6003010270 | 6003011270 | 6003012270 | 6003013270 | 6003014270 | 6003015270 | 6003019270 |

60.100

Risque d'assurance Mortalité

(en milliers de dollars)

| | Produits sans participation | | | | | | Produits ajustables | | | | | | Produits avec participation | | | |
|---|-----------------------------|--|----------------------------|--|--|--|---|--|----------------------------|--|--|--|---|--|----------------------------|--|
| | TOTAL | | Assurance vie individuelle | | Assurance vie collective - produits souscrits souscription individuellement seulement | | Assurance vie collective - sauf les produits souscrits excluant souscription- individuellement | | Assurance vie individuelle | | Assurance vie collective - produits souscrits souscription individuellement seulement | | Assurance vie collective - sauf les produits souscrits excluant souscription- individuellement | | Assurance vie individuelle | |
| Capital requis - niveau | 6010010010 | | 6010011010 | | 6010012010 | | 6010013010 | | 6010014010 | | 6010015010 | | 6010016010 | | 6010017010 | |
| Capital requis - tendance | 6010010020 | | 6010011020 | | 6010012020 | | 6010013020 | | 6010014020 | | 6010015020 | | 6010016020 | | 6010017020 | |
| Capital requis - volatilité | 6010010030 | | 6010011030 | | 6010012030 | | 6010013030 | | 6010014030 | | 6010015030 | | 6010016030 | | 6010017030 | |
| Capital requis - catastrophe | 6010010040 | | 6010011040 | | 6010012040 | | 6010013040 | | 6010014040 | | 6010015040 | | 6010016040 | | 6010017040 | |
| Capital requis - niveau et tendance (avant diversification) | 6010010050 | | 6010011050 | | 6010012050 | | 6010013050 | | 6010014050 | | 6010015050 | | 6010016050 | | 6010017050 | |
| Moins : Crédit pour diversification ¹ | 6010010080 | | | | | | | | | | | | | | | |
| Capital requis - niveau et tendance (après diversification) | 6010010090 | | | | | | | | | | | | | | | |
| Capital requis - volatilité et catastrophe | 6010010060 | | | | | | | | | | | | | | | |
| Capital requis du risque de mortalité | 6010010070 | | | | | | | | | | | | | | | |

¹ Crédit pour diversification entre les produits fondés sur la survie et les produits fondés sur les décès (voir la section 11.1.1 de la Ligne directrice ESCAP).

60.200

Risque d'assurance Longévité

(en milliers de dollars)

| | TOTAL | | Produits sans participation | | | | Produits ajustables | | | | Produits avec participation | | | |
|--|------------|--|-----------------------------|--|---------------------|--|-------------------------|--|---------------------|--|-----------------------------|--|---------------------|--|
| | | | Rentes non enregistrées | | Rentes enregistrées | | Rentes non enregistrées | | Rentes enregistrées | | Rentes non enregistrées | | Rentes enregistrées | |
| Capital requis - niveau | 6020010010 | | 6020011010 | | 6020012010 | | 6020013010 | | 6020014010 | | 6020015010 | | 6020016010 | |
| Capital requis - tendance | 6020010020 | | 6020011020 | | 6020012020 | | 6020013020 | | 6020014020 | | 6020015020 | | 6020016020 | |
| Capital requis du risque de longévité | 6020010030 | | 6020011030 | | 6020012030 | | 6020013030 | | 6020014030 | | 6020015030 | | 6020016030 | |

60.300

**Risque d'assurance
Morbidité**

(en milliers de dollars)

| | Taux d'incidence | | | | | | | | | | | | | | | |
|--|------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------|---------------------------------------|---------------------------|------------------------------------|------------|--------------------------------|------------------------|---------------|-------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|-------------------|-----------------|
| | TOTAL | RI individuelle - actifs | EP individuelle - actifs | MG individuelle | MG - individuelle produits ajustables | SLD individuelle - actifs | SLD - actifs - produits ajustables | Autres A-M | ICD et ILD collective - actifs | EP collective - actifs | MG collective | SLD collective - actifs | Maladie individuelle et collective | Dentaire individuelle et collective | Voyage collective | Prêt collective |
| Capital requis - niveau (avant diversification) | 60300237010 | 6030020010 | 6030021010 | 6030022010 | 6030023010 | 6030024010 | 6030025010 | 6030026010 | 6030028010 | 6030029010 | 6030030010 | 6030031010 | 6030032010 | 6030033010 | 6030034010 | 6030035010 |
| Moins : Crédit pour diversification | 6030037020 | 6030020020 | 6030021020 | 6030022020 | 6030023020 | 6030024020 | 6030025020 | | 6030028020 | 6030029020 | 6030030020 | 6030031020 | | | 6030034020 | 6030035020 |
| Capital requis - volatilité (avant diversification) | 6030037030 | 6030020030 | 6030021030 | 6030022030 | 6030023030 | 6030024030 | 6030025030 | 6030026030 | 6030028030 | 6030029030 | 6030030030 | 6030031030 | 6030032030 | 6030033030 | 6030034030 | 6030035030 |
| Moins : Crédit pour diversification | 6030037040 | 6030020040 | 6030021040 | 6030022040 | 6030023040 | 6030024040 | 6030025040 | 6030026040 | 6030028040 | 6030029040 | 6030030040 | 6030031040 | 6030032040 | 6030033040 | 6030034040 | 6030035040 |
| Capital requis - niveau (après diversification) | 6030037050 | 6030020050 | 6030021050 | 6030022050 | 6030023050 | 6030024050 | 6030025050 | 6030026050 | 6030028050 | 6030029050 | 6030030050 | 6030031050 | 6030032050 | 6030033050 | 6030034050 | 6030035050 |
| Capital requis - tendance | 6030037060 | 6030020060 | 6030021060 | 6030022060 | 6030023060 | 6030024060 | 6030025060 | 6030026060 | 6030028060 | 6030029060 | 6030030060 | 6030031060 | 6030032060 | 6030033060 | 6030034060 | 6030035060 |
| Capital requis - volatilité (après diversification) | 6030037070 | 6030020070 | 6030021070 | 6030022070 | 6030023070 | 6030024070 | 6030025070 | 6030026070 | 6030028070 | 6030029070 | 6030030070 | 6030031070 | 6030032070 | 6030033070 | 6030034070 | 6030035070 |
| Capital requis - catastrophe | 6030037080 | 6030020080 | 6030021080 | 6030022080 | 6030023080 | 6030024080 | 6030025080 | 6030026080 | 6030028080 | 6030029080 | 6030030080 | 6030031080 | | | | |
| Capital requis du risque d'incidence de morbidité | 6030037090 | | | | | | | | | | | | | | | |

| | Taux de cessation | | | | | |
|---|-------------------|-----------------------------|--|----------------------------|--|---|
| | TOTAL | RI individuelle - invalides | ICD individuelle et collective - invalides | ILD collective - invalides | SLD individuelle et collective - invalides | EP individuelle et collective - invalides |
| Capital requis - niveau (avant diversification) | 6030040001 | 6030040010 | 6030041010 | 6030042010 | 6030043010 | 6030044010 |
| Moins : Crédit pour diversification | 6030040002 | 6030040020 | 6030041020 | 6030042020 | 6030043020 | 6030044020 |
| Capital requis - volatilité (avant diversification) | | | | | | |
| Moins : Crédit pour diversification | | | | | | |
| Capital requis - niveau (après diversification) | 6030040005 | 6030040050 | 6030041050 | 6030042050 | 6030043050 | 6030044050 |
| Capital requis - tendance | 6030040006 | 6030040060 | 6030041060 | 6030042060 | 6030043060 | 6030044060 |
| Capital requis - volatilité (après diversification) | | | | | | |
| Capital requis - catastrophe | | | | | | |
| Capital requis du risque de cessation de morbidité | 6030040009 | | | | | |

| | TOTAL | Total - taux d'incidence | Total - taux de cessation |
|---|------------|--------------------------|---------------------------|
| Capital requis - niveau (avant diversification) | 6030010010 | 6030011010 | 6030012010 |
| Moins : Crédit pour diversification | 6030010020 | 6030011020 | 6030012020 |
| Capital requis - volatilité (avant diversification) | 6030010030 | 6030011030 | |
| Moins : Crédit pour diversification | 6030010040 | 6030011040 | |
| Capital requis - niveau (après diversification) | 6030010050 | 6030011050 | 6030012050 |
| Capital requis - tendance | 6030010060 | 6030011060 | 6030012060 |
| Capital requis - volatilité (après diversification) | 6030010070 | 6030011070 | |
| Capital requis - catastrophe | 6030010080 | 6030011080 | |
| Capital requis - niveau et tendance | 6030010090 | 6030011090 | 6030012090 |
| Capital requis - volatilité et catastrophe | 6030010100 | 6030011100 | |
| Capital requis du risque de morbidité | 6030010110 | 6030011110 | 6030012110 |

60.400

Risque d'assurance Déchéance

(en milliers de dollars)

| | Produits sans participation | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--|-----------------------------|------------------------------------|----------------------------|--------------------------|-----------------|---------------------------|------------|-----------------------------------|----------------------------|--------------------------|-----------------|---------------------------|------------|--|--|--|--|--|--|
| | Total | Produits fondés sur les déchéances | | | | | | Produits sensibles aux déchéances | | | | | | | | | | | |
| | | Total | Assurance vie individuelle | RI individuelle - actifs | MG individuelle | SLD individuelle - actifs | Autres A-M | Total | Assurance vie individuelle | RI individuelle - actifs | MG individuelle | SLD individuelle - actifs | Autres A-M | | | | | | |
| Capital requis - niveau et tendance | 6040020010 | 6040021010 | 6040022010 | 6040023010 | 6040024010 | 6040025010 | 6040026010 | 6040031010 | 6040032010 | 6040033010 | 6040034010 | 6040035010 | 6040036010 | | | | | | |
| Capital requis - volatilité | 6040020020 | 6040021020 | 6040022020 | 6040023020 | 6040024020 | 6040025020 | 6040026020 | 6040031020 | 6040032020 | 6040033020 | 6040034020 | 6040035020 | 6040036020 | | | | | | |
| Capital requis - catastrophe | 6040020030 | 6040021030 | 6040022030 | 6040023030 | 6040024030 | 6040025030 | 6040026030 | 6040031030 | 6040032030 | 6040033030 | 6040034030 | 6040035030 | 6040036030 | | | | | | |
| Capital requis du risque de déchéance | 6040020040 | 6040021040 | | | | | | 6040031040 | | | | | | | | | | | |

| | Produits ajustables | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--|---------------------|------------------------------------|----------------------------|--------------------------|-----------------|---------------------------|------------|-----------------------------------|----------------------------|--------------------------|-----------------|---------------------------|------------|--|--|--|--|--|--|
| | Total | Produits fondés sur les déchéances | | | | | | Produits sensibles aux déchéances | | | | | | | | | | | |
| | | Total | Assurance vie individuelle | RI individuelle - actifs | MG individuelle | SLD individuelle - actifs | Autres A-M | Total | Assurance vie individuelle | RI individuelle - actifs | MG individuelle | SLD individuelle - actifs | Autres A-M | | | | | | |
| Capital requis - niveau et tendance | 6040040010 | 6040041010 | 6040042010 | 6040043010 | 6040044010 | 6040045010 | 6040046010 | 6040051010 | 6040052010 | 6040053010 | 6040054010 | 6040055010 | 6040056010 | | | | | | |
| Capital requis - volatilité | 6040040020 | 6040041020 | 6040042020 | 6040043020 | 6040044020 | 6040045020 | 6040046020 | 6040051020 | 6040052020 | 6040053020 | 6040054020 | 6040055020 | 6040056020 | | | | | | |
| Capital requis - catastrophe | 6040040030 | 6040041030 | 6040042030 | 6040043030 | 6040044030 | 6040045030 | 6040046030 | 6040051030 | 6040052030 | 6040053030 | 6040054030 | 6040055030 | 6040056030 | | | | | | |
| Capital requis du risque de déchéance | 6040040040 | 6040041040 | | | | | | 6040051040 | | | | | | | | | | | |

| | Produits avec participation | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--|-----------------------------|------------------------------------|----------------------------|--------------------------|-----------------|---------------------------|------------|-----------------------------------|----------------------------|--------------------------|-----------------|---------------------------|------------|--|--|--|--|--|--|
| | Total | Produits fondés sur les déchéances | | | | | | Produits sensibles aux déchéances | | | | | | | | | | | |
| | | Total | Assurance vie individuelle | RI individuelle - actifs | MG individuelle | SLD individuelle - actifs | Autres A-M | Total | Assurance vie individuelle | RI individuelle - actifs | MG individuelle | SLD individuelle - actifs | Autres A-M | | | | | | |
| Capital requis - niveau et tendance | 6040060010 | 6040061010 | 6040062010 | 6040063010 | 6040064010 | 6040065010 | 6040066010 | 6040071010 | 6040072010 | 6040073010 | 6040074010 | 6040075010 | 6040076010 | | | | | | |
| Capital requis - volatilité | 6040060020 | 6040061020 | 6040062020 | 6040063020 | 6040064020 | 6040065020 | 6040066020 | 6040071020 | 6040072020 | 6040073020 | 6040074020 | 6040075020 | 6040076020 | | | | | | |
| Capital requis - catastrophe | 6040060030 | 6040061030 | 6040062030 | 6040063030 | 6040064030 | 6040065030 | 6040066030 | 6040071030 | 6040072030 | 6040073030 | 6040074030 | 6040075030 | 6040076030 | | | | | | |
| Capital requis du risque de déchéance | 6040060040 | 6040061040 | | | | | | 6040071040 | | | | | | | | | | | |

| | Total | Total - produits fondés sur les déchéances | Total - produits sensibles aux déchéances |
|--|------------|--|---|
| Capital requis - niveau et tendance | 6040010010 | 6040011010 | 6040012010 |
| Capital requis - volatilité | 6040010020 | 6040011020 | 6040012020 |
| Capital requis - catastrophe | 6040010030 | 6040011030 | 6040012030 |
| Capital requis - volatilité et catastrophe | 6040010040 | 6040011040 | 6040012040 |
| Capital requis du risque de déchéance | 6040010050 | 6040011050 | 6040012050 |

60.500

Risque d'assurance Dépenses

(en milliers de dollars)

| | Total | | Produits sans participation | | Vie - produits ajustables | | Rentes - produits ajustables | | A-M - produits ajustables | | Produits avec participation | |
|--|------------|--|-----------------------------|--|---------------------------|--|------------------------------|--|---------------------------|--|-----------------------------|--|
| Capital requis - niveau, tendance, volatilité et catastrophe | 6050010010 | | 6050011010 | | 6050012010 | | 6050013010 | | 6050014010 | | 6050015010 | |

70.100

Risque relatif aux garanties des fonds distincts

Total par catégorie de fonds

(en milliers de dollars)

| | Valeur garantie | | Valeur marchande | | TBCR ¹ | | Crédit pour cession en réassurance | | TBCR net | | Provisions techniques nettes détenues | | Capital requis ² | |
|--|-----------------|--|------------------|--|-------------------|--|------------------------------------|--|------------|--|---------------------------------------|--|-----------------------------|--|
| <i>Catégorie de fonds :</i> | Col. 01 | | Col. 02 | | Col. 03 | | Col. 04 | | Col. 05 | | Col. 07 | | Col. 08 | |
| Marché monétaire/court terme | 7010010010 | | 7010020010 | | 7010030010 | | 7010040010 | | 7010050010 | | 7010070010 | | 7010090010 | |
| Revenu fixe (jusqu'à 25 % en actions) | 7010010020 | | 7010020020 | | 7010030020 | | 7010040020 | | 7010050020 | | 7010070020 | | 7010090020 | |
| Équilibré (max 75 % en actions) | 7010010030 | | 7010020030 | | 7010030030 | | 7010040030 | | 7010050030 | | 7010070030 | | 7010090030 | |
| Fonds diversifié à faible volatilité | 7010010040 | | 7010020040 | | 7010030040 | | 7010040040 | | 7010050040 | | 7010070040 | | 7010090040 | |
| Fonds d'actions diversifié élargi | 7010010050 | | 7010020050 | | 7010030050 | | 7010040050 | | 7010050050 | | 7010070050 | | 7010090050 | |
| Fonds d'actions à risque intermédiaire | 7010010060 | | 7010020060 | | 7010030060 | | 7010040060 | | 7010050060 | | 7010070060 | | 7010090060 | |
| Fonds d'actions exotiques/aggressifs | 7010010070 | | 7010020070 | | 7010030070 | | 7010040070 | | 7010050070 | | 7010070070 | | 7010090070 | |
| Exigences à partir du modèle interne autorisé par l'Autorité ³ | 7010010080 | | 7010020080 | | 7010030080 | | 7010040080 | | 7010050080 | | 7010070080 | | 7010090080 | |
| Sous-total (A) | 7010010100 | | 7010020100 | | 7010030100 | | 7010040100 | | 7010050100 | | 7010070100 | | 7010090100 | |
| Moins : Crédit pour les dépôts excédentaires obtenus de la part des réassureurs non agréés (B) | | | | | | | | | | | | | 7010090910 | |
| Capital requis du risque relatif aux garanties des fonds distincts⁴ (A - B) | | | | | | | | | | | | | 7010090920 | |

¹ Si l'assureur utilise l'approche selon la méthode de la section 7.2.7.2 ou la méthode de la section 7.2.8 de la Ligne directrice ESCAP, le TBCR représente respectivement 100 % du capital requis ou 100 % du capital requis après ajustement selon le modèle interne auquel on ajoute les provisions techniques nettes détenues.

² La formule pour déterminer le capital requis comprend un facteur de 1,25 pour entraîner son montant au niveau cible d'intervention (voir la section 7.3.1 de la Ligne directrice ESCAP).

³ Au cours de la première année suivant la mise en application du modèle interne selon la méthode de la section 7.2.7 de la ligne directrice ESCAP, le capital requis équivaut à 50 % du capital requis selon les facteurs prescrits + 50 % du capital requis selon le modèle interne. Pendant cette première année, les lignes 010 à 080 doivent comprendre 50 % des montants utilisés pour calculer le capital requis selon les facteurs prescrits et le capital requis selon le modèle interne. Au cours des années suivantes, 100 % de ces montants doivent être inclus dans la ligne 080.

⁴ Ce montant ne doit pas être inférieur à zéro.

70.200

Risque relatif aux garanties des fonds distincts

Total selon le lieu des opérations

(en milliers de dollars)

| <i>Lieu des opérations :</i> | Valeur garantie | | Valeur marchande | | TBCR ¹ | | Crédit pour cession en réassurance | | TBCR net | | Provisions techniques nettes détenues | | Capital requis ² | |
|--|-----------------|------------|------------------|------------|-------------------|---------|------------------------------------|---------|------------|---------|---------------------------------------|---------|-----------------------------|---------|
| | Col. 01 | Col. 02 | Col. 03 | Col. 04 | Col. 05 | Col. 06 | Col. 07 | Col. 08 | Col. 09 | Col. 10 | Col. 11 | Col. 12 | Col. 13 | Col. 14 |
| Facteurs prescrits | 7020010003 | 7020020003 | 7020030003 | 7020040003 | 7020050003 | | 7020070003 | | 7020090003 | | | | 7020090003 | |
| Modèle interne ³ | 7020010006 | 7020020006 | 7020030006 | 7020040006 | 7020050006 | | 7020070006 | | 7020090006 | | | | 7020090006 | |
| Opérations au Canada | 7020010010 | 7020020010 | 7020030010 | 7020040010 | 7020050010 | | 7020070010 | | 7020090010 | | | | 7020090010 | |
| Facteurs prescrits | 7020010013 | 7020020013 | 7020030013 | 7020040013 | 7020050013 | | 7020070013 | | 7020090013 | | | | 7020090013 | |
| Modèle interne ³ | 7020010016 | 7020020016 | 7020030016 | 7020040016 | 7020050016 | | 7020070016 | | 7020090016 | | | | 7020090016 | |
| Opérations aux É.-U. | 7020010020 | 7020020020 | 7020030020 | 7020040020 | 7020050020 | | 7020070020 | | 7020090020 | | | | 7020090020 | |
| Facteurs prescrits | 7020010023 | 7020020023 | 7020030023 | 7020040023 | 7020050023 | | 7020070023 | | 7020090023 | | | | 7020090023 | |
| Modèle interne ³ | 7020010026 | 7020020026 | 7020030026 | 7020040026 | 7020050026 | | 7020070026 | | 7020090026 | | | | 7020090026 | |
| Autres opérations à l'étranger | 7020010030 | 7020020030 | 7020030030 | 7020040030 | 7020050030 | | 7020070030 | | 7020090030 | | | | 7020090030 | |
| <i>Sous-total</i> (A) | 7020010040 | 7020020040 | 7020030040 | 7020040040 | 7020050040 | | 7020070040 | | 7020090040 | | | | 7020090040 | |
| Moins : Crédit pour les dépôts excédentaires obtenus de la part des réassureurs non agréés (B) | | | | | | | | | | | | | 7020090910 | |
| Capital requis du risque relatif aux garanties des fonds distincts⁴ (A - B) | | | | | | | | | | | | | 7020090920 | |

¹ Si l'assureur utilise l'approche selon la méthode de la section 7.2.7.2 ou la méthode de la section 7.2.8 de la Ligne directrice ESCAP, le TBCR représente respectivement 100 % du capital requis ou 100 % du capital requis après ajustement selon le modèle interne auquel on ajoute les provisions techniques nettes détenues.

² La formule pour déterminer le capital requis comprend un facteur de 1,25 pour entraîner son montant au niveau cible d'intervention (voir la section 7.3.2 de la Ligne directrice ESCAP).

³ Au cours de la première année suivant la mise en application du modèle interne selon la méthode de la section 7.2.7 de la ligne directrice ESCAP, le capital requis équivaut à 50 % du capital requis selon les facteurs prescrits + 50 % du capital requis selon le modèle interne. Pendant cette première année, les lignes 003 à 040 doivent comprendre 50 % des montants utilisés pour calculer le capital requis selon les facteurs prescrits et le capital requis selon le modèle interne. Au cours des années suivantes, 100 % de ces montants doivent être inclus dans les lignes 006, 016 et 026.

⁴ Ce montant doit être égal à celui de la cellule 7010090920 de la page 70.100.