

Banque du Canada
Renseignements complémentaires sur les prêts et créances figurant au bilan
au 30 juin 2020

Tableau 1 : Prêts et créances – Ventilation détaillée

(En millions \$)

Mécanisme permanent d'octroi de liquidités à plus d'un jour ^[1]	606,2
Mécanisme permanent d'octroi de liquidités à un jour ^[2]	-
Avances aux membres de l'Association Canadienne des paiements	606,2
Opérations de prise en pension à plus d'un jour ^[3]	205 185,5
Mécanisme conditionnel de prise en pension à plus d'un jour ^[4]	-
Opérations de prise en pension à un jour ^[5]	-
Total des titres achetés dans le cadre de conventions de revente	205 185,5
Autres créances	4,4
Encours des prêts et créances	<u>205 796,1</u>

Tableau 2 : Valeur au marché des titres achetés dans le cadre des opérations de prise en pension à plus d'un jour

(En millions \$)

Titres émis ou garantis par le gouvernement canadien	7 853,7
Titres émis ou garantis par un gouvernement provincial	50 544,7
Titres émis par une municipalité	419,8
Titres d'autres émetteurs du secteur public	630,9
Titres corporatifs	141 470,6
Papier commercial adossé à des actifs	14 357,3
Valeur totale des titres pris en pension à plus d'un jour	<u>215 277,0</u>
Encours des prises en pension à plus d'un jour	<u>205 185,5</u>
Taux de nantissement	104.9%

Tableau 3 : Valeur au marché des titres achetés dans le mécanisme conditionnel de prise en pension à plus d'un jour

	(En millions \$)
Titres émis ou garantis par le gouvernement canadien	-
Titres émis ou garantis par un gouvernement provincial	-
Valeur totale des titres pris en mécanisme conditionnel de prise en pension à plus d'un jour	<u><u>-</u></u>
Encours de mécanisme conditionnel de prise en pension à plus d'un jour	-
Taux de nantissement	

[1] Le mécanisme permanent d'octroi de liquidités à plus d'un jour consiste à faire des avances aux membres de paiements Canada qui sont sous réglementation prudentielle fédérale ou provinciale. Les avances sont garanties par des titres admissibles à cette fin dans le cadre du mécanisme permanent d'octroi de liquidités à plus d'un jour. Le solde comprend des avances de 605,2 millions de dollars plus des intérêts courus de 1,0 million de dollars. Le solde est adossé par des titres négociables et prêts hypothécaires et non-hypothécaires de 982,6 millions. Pour de plus amples renseignements, cliquez sur ce lien : <https://www.banquedcanada.ca/marches/operations-marches-octroi-liquidites/operations-programmes-et-facilites/mecanisme-permanent-octroi-liquidites-plus-un-jour-modalites-application/>

[2] Le mécanisme d'octroi de liquidités à un jour concerne des avances qui sont garanties par des titres admissibles à cette fin dans le cadre du mécanisme permanent d'octroi de liquidités de la Banque. Pour de plus amples renseignements, cliquez sur ce lien: <https://www.banquedcanada.ca/2019/07/actifs-acceptes-garantie-cadre-mecanisme-octroi-liquidites-290719/>

[3] La Banque effectue des opérations de prise en pension à plus d'un jour pour gérer le bilan de la Banque, promouvoir le bon fonctionnement des marchés financiers canadiens et afin de fournir des informations sur les conditions des marchés de financement à court terme. Consultez le tableau 2 pour plus de détails sur les titres utilisés dans les opérations de prise en pension à plus d'un jour. Les modalités d'application des prise en pension à plus d'un jour sont disponibles au lien suivant: <https://www.banquedcanada.ca/taux/indicateurs/indicateurs-operations-marches/operations-de-prise-en-pension-a-plus-dun-jour/>

[4] Le mécanisme conditionnel de prise en pension à plus d'un jour est le mécanisme permanent de prise en pension de la Banque du Canada destiné à contrecarrer toute tension grave sur la liquidité dans tous les segments du marché et à consolider la stabilité du système financier canadien. Il permet d'octroyer des fonds en dollars canadiens à échéance d'un mois à des contreparties admissibles, dans un cadre bilatéral permanent, contre des titres émis ou garantis par le gouvernement du Canada ou une province. Les modalités d'application de mécanisme conditionnel de prise en pension à plus d'un jour sont disponibles au lien suivant: <https://www.banquedcanada.ca/marches/operations-marches-octroi-liquidites/operations-programmes-et-facilites/mecanisme-conditionnel-de-prise-en-pension-a-plus-dun-jour/mecanisme-conditionnel-de-prise-en-pension-a-plus-dun-jour-modalites-dapplication/>

[5] La Banque effectue des opérations de prise en pension à un jour et de cession en pension à un jour pour assurer la mise en œuvre efficace de son cadre de conduite de la politique monétaire. Ces opérations injectent ou retirent des liquidités intrajournalières, ce qui renforce le taux cible du financement à un jour de la Banque. Les modalités d'application sont disponibles au lien suivant: <https://www.banquedcanada.ca/marches/operations-marches-octroi-liquidites/operations-programmes-et-facilites/operations-prise-pension-un-jour-cession-pension-un-jour/>