

Divulgarion au titre du ratio de levier Bâle III – Pilier 3

Depuis le 1^{er} janvier 2013, le Bureau du surintendant des institutions financières (BSIF) exige des institutions financières canadiennes qu'elles gèrent et déclarent leur capital réglementaire conformément à un nouveau cadre de gestion du capital, communément appelé Bâle III. Les exigences relatives à la divulgation publique du troisième pilier de Bâle III visent à améliorer à la fois la transparence et la comparabilité de la situation du compte capital de la Banque et à répondre aux exigences du BSIF émises dans l'avis du BSIF intitulé « Exigences en matière de divulgation publique au titre du ratio de levier de Bâle III » en novembre 2014. Cette divulgation a été préparée sur la base du modèle de divulgation commun du ratio de levier fourni à l'Annexe I — Tableau de déclaration pour les banques d'importance non systémique qui exercent des activités à l'étranger, paru dans cet avis. Tous les bilans sont présentés en dollars canadiens arrondis au millier le plus près, sauf indication contraire.

Cadre du ratio de levier — T1 2021		
Expositions au bilan		
1	Postes au bilan (à l'exclusion des dérivés, des OFT et des expositions sur titrisation faisant l'objet de droits acquis, mais compte tenu des suretés)	4 534 624
2	Majoration pour suretés sur dérivés lorsqu'elles sont déduites des actifs au bilan en vertu du référentiel comptable applicable (IFRS)	
3	(Dédutions d'actifs débiteurs au titre de la marge pour variation en espèces liée aux opérations sur dérivés)	
4	(Montants de l'actif déduits dans le calcul des fonds propres de catégorie 1)	(5 120)
5	Total des expositions au bilan (à l'exclusion des dérivés et des OFT)	4 529 504
Expositions sur dérivés		
6	Coût de remplacement lié aux opérations sur dérivés	139 615
7	Majorations pour exposition potentielle future liée à toutes les opérations sur dérivés	232 756
8	(Volet exonéré d'une contrepartie centrale sur les expositions compensées de client)	
9	Montant notionnel effectif ajusté des dérivés de crédit souscrits	
10	(Compensations notionnelles effectives ajustées et majorations déduites pour les dérivés de crédit souscrits)	
11	Total des expositions sur dérivés	372 371
Expositions sur opérations de financement par titres		
12	Actifs bruts liés aux OFT constatés à des fins comptables (sans comptabilisation de la compensation), après ajustement pour opérations comptables de vente)	3 066 605
13	(Montants compensés de liquidités à recevoir et de liquidités à payer sur actifs bruts d'OFT)	
14	Exposition au risque de contrepartie (RC) pour OFT	
15	Exposition sur opérations à titre de mandataire	
16	Total des expositions sur opérations de financement par titres	3 066 605
Autres expositions hors bilan		
17	Exposition hors bilan sous forme de montant notionnel brut	786 526
18	(Ajustements pour conversion en montants en équivalent-crédit)	(20 355)
19	Postes hors bilan	766 171
Fonds propres et expositions totales		
20	Fonds propres de catégorie 1	1 149 746
21	Total des expositions	8 734 651
Ratio de levier		
22	Ratio de levier – Bâle III	13,16