

Divulcation 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 — T3 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)	4 007 451 \$
2	Majoration pour suretés sur dérivés lorsqu'elles sont déduites des actifs au bilan en vertu du référentiel comptable applicable (IFRS)	-
3	(Déductions 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)	(5 354) \$
5	Total des expositions au bilan (à l'exclusion des dérivés et des OFT)	4 002 097 \$
Expositions sur dérivés		
6	Coût de remplacement lié aux opérations sur dérivés	133 182 \$
7	Majorations pour exposition potentielle future liée à toutes les opérations sur dérivés	196 031 \$
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	329 213 \$
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)	2 271 600 \$
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	2 271 600 \$
Autres expositions hors bilan		
17	Exposition hors bilan sous forme de montant notionnel brut	903 795 \$
18	(Ajustements pour conversion en montants en équivalent-crédit)	(105 749) \$
19	Postes hors bilan	798 046 \$
Fonds propres et expositions totales		
20	Fonds propres de catégorie 1	1 168 444 \$
21	Total des expositions	7 400 956 \$
Ratio de levier		
22	Ratio de levier – Bâle III	15,79%