

RELEVÉ DES NORMES DE FONDS PROPRES

- RISQUE DE MARCHÉ

AU (DATE)

NO. DE RELEVÉ INST. N°ST. N°A YEAR MONTH DAY
| SIF | M 3 | _ | _ | _ | _ | _ | _ | _ | _ |

Nom de l'institution

(EN MILLIERS DE DOLLARS)

Au date

SECTION I - CALCUL DU RATIO DE FONDS PROPRES

MINIMUM DE FONDS PROPRES REQUIS POUR RISQUE DE MARCHÉ :			
APPROCHE STANDARDISÉE			
RISQUE DE POSITION SUR TAUX D'INTÉRÊT		3930	
RISQUE DE POSITION SUR TITRES DE PROPRIÉTÉ		3931	
RISQUE DE CHANGE		3932	
RISQUE SUR PRODUITS DE BASE		3933	
OPTIONS :			
TAUX D'INTÉRÊT		3934	
TITRES DE PROPRIÉTÉ		3935	
CHANGE		3936	
PRODUITS DE BASE		3937	
MODÈLE INTERNE ACCEPTABLE			
EXIGENCE GLOBALE POUR VALEUR À RISQUE (SECTION I A, LIGNE Q)		3938	
TOTAL DU MINIMUM DE FONDS PROPRES REQUIS POUR RISQUE DU MARCHÉ		3939	
MINIMUM DE FONDS PROPRES REQUIS POUR RISQUE DE CRÉDIT :			
TOTAL DE L'ACTIF PONDÉRÉ EN FONCTION DES RISQUES, SELON NFP 1, LIGNE C		3940	
ACTIF FIGURANT AU BILAN PONDÉRÉ EN FONCTION DES RISQUES SELON LA NFP ET ASSUJETTI AU RISQUE SPÉCIFIQUE :		SOLDE	MONTANT PONDÉRÉ EN FONCTION DES RISQUES
DÉPÔTS AUPRÈS D'INSTITUTIONS FINANCIÈRES RÉGLEMENTÉES - FACTEUR DE PONDÉRATION : 0%	4467		
DÉPÔTS AUPRÈS D'INSTITUTIONS FINANCIÈRES RÉGLEMENTÉES - FACTEUR DE PONDÉRATION : 20%	4468		4470
DÉPÔTS AUPRÈS D'INSTITUTIONS FINANCIÈRES RÉGLEMENTÉES - FACTEUR DE PONDÉRATION : 100%	4469		4471
TITRES DE CRÉANCE - FACTEUR DE PONDÉRATION 0%	3941		
TITRES DE CRÉANCE - FACTEUR DE PONDÉRATION 20%	3942		3950
TITRES DE CRÉANCE - FACTEUR DE PONDÉRATION 50%	3943		3951
TITRES DE CRÉANCE - FACTEUR DE PONDÉRATION 100%	3944		3952
TITRES DE PROPRIÉTÉ - FACTEUR DE PONDÉRATION 20%	3945		3953
TITRES DE PROPRIÉTÉ - FACTEUR DE PONDÉRATION 50%	3946		3954
TITRES DE PROPRIÉTÉ - FACTEUR DE PONDÉRATION 100%	3947		3955
PRÊTS NON HYPOTHÉCAIRES - FACTEUR DE PONDÉRATION : 0%	4472		
PRÊTS NON HYPOTHÉCAIRES - FACTEUR DE PONDÉRATION : 20%	4473		4480
PRÊTS NON HYPOTHÉCAIRES - FACTEUR DE PONDÉRATION : 50%	4474		4481
PRÊTS NON HYPOTHÉCAIRES - FACTEUR DE PONDÉRATION : 100%	4475		4482

A

B

RELEVÉ DES NORMES DE FONDS PROPRES

- RISQUE DE MARCHÉ

AU (DATE)

NO. DE RELEVÉ INST. N° ST. N° A YEAR MONTH DAY
| SIF | M 3 | _ | _ | _ | _ | _ | _ | _ | _ |

(EN MILLIERS DE DOLLARS)

	SOLDE		MONTANT PONDÉRÉ EN FONCTION DES RISQUES	
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF - FACTEUR DE PONDÉRATION : 0%	4476			
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF - FACTEUR DE PONDÉRATION : 20%	4477		4483	
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF - FACTEUR DE PONDÉRATION : 50%	4478		4484	
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF - FACTEUR DE PONDÉRATION : 100%	4479		4485	
TOTAL DE L'ACTIF PONDÉRÉ EN FONCTION DES RISQUES SELON LA NFP ASSUJETTI AU RISQUE SPÉCIFIQUE			3956	

C

TOTAL DE L'ACTIF PONDÉRÉ EN FONCTION DES RISQUES HORS DU COMPTE DE NÉGOCIATION D = (B - C)			3957	
---	--	--	------	--

D

MINIMUM DE FONDS PROPRES REQUIS POUR RISQUE DE CRÉDIT E = D x 8%			3958	
---	--	--	------	--

E

AFFECTATION DE FONDS PROPRES EN FONCTION DU MINIMUM REQUIS	RISQUE DE CRÉDIT		RISQUE DE MARCHÉ	
CATÉGORIE 1	3959		3962	
CATÉGORIE 2	3960		3963	
CATÉGORIE 3			3964	
TOTAL	3961		3965	

F

FONDS PROPRES ADMISSIBLES				
MONTANT NET DES FONDS PROPRES DE CATÉGORIE 1 (NFP 2, LIGNE D)			3968	
MONTANT NET DES FONDS PROPRES DE CATÉGORIE 2 (NFP 2, LIGNE AC)			3969	
CATÉGORIE 3 (LIMITÉ AU MONTANT REQUIS POUR SATISFAIRE À L'EXIGENCE MINIMALE POUR RISQUE DE MARCHÉ)			3970	
TOTAL DES CATÉGORIES 1, 2, ET 3			3971	
MOINS :				
DÉDUCTIONS (NFP 2, TOTAL DES LIGNES N, O, P, Q ET AD)			3995	
TOTAL DES FONDS PROPRES ADMISSIBLES			3977	

G

H

F

I

MONTANT AJUSTÉ DE L'ACTIF PONDÉRÉ EN FONCTION DES RISQUES					
	MINIMUM DE FONDS PROPRES REQUIS (A)		FACTEUR	ÉQUIVALENT PONDÉRÉ EN FONCTION DES RISQUES	
RISQUE DE MARCHÉ	3978		12.5	3979	
RISQUE DE CRÉDIT - TOTAL DE L'ACTIF PONDÉRÉ EN FONCTION DES RISQUES EXCLUE DU COMPTE DE NÉGOCIATION (SECTION I, LIGNE D)				3980	
TOTAL DE L'ACTIF RAJUSTÉ PONDÉRÉ EN FONCTION DES RISQUES				3981	

J

CALCUL DU RATION DE FONDS PROPRES COMBINÉ					
RATIO COMBINÉ DE LA CATÉGORIE 1 (G/J) x 100				3982	
RATIO COMBINÉ DU TOTAL DE FONDS PROPRES (I/J) x 100				3983	

RELEVÉ DES NORMES DE FONDS PROPRES

- RISQUE DE MARCHÉ

AU (DATE)

NO. DE RELEVÉ INST. N°ST. N°C YEAR MONTH DAY
| SIF | M 3 | _ | _ | _ | _ | _ | _ |

(EN MILLIERS DE DOLLARS)

SECTION I A - EXIGENCES DU MODÈLE INTERNE

PARTIE A - CALCUL DES EXIGENCES DE LA VALEUR À RISQUE		
VALEUR À RISQUE CONSOLIDÉE POUR UNE PÉRIODE DE CONSERVATION DE 10 JOURS ET UN NIVEAU DE CONFIANCE DE 99 % :		
VAR À LA DATE DE DÉCLARATION, ABSTRACTION FAITE DU RISQUE SPÉCIFIQUE SELON LE MODÈLE	3984	
RISQUE SPÉCIFIQUE SELON LE MODÈLE À LA DATE DE DÉCLARATION	3985	
VAR MOYENNE À 60 JOURS, ABSTRACTION FAITE DU RISQUE SPÉCIFIQUE SELON LE MODÈLE	3986	
RISQUE SPÉCIFIQUE MOYEN SUR 60 JOURS SELON LE MODÈLE	3987	
EXIGENCE POUR RISQUE GÉNÉRAL DE MARCHÉ SELON LE MODÈLE [LE PLUS ÉLEVÉ DE K ET DE (M x3)]		
	3988	
EXIGENCE POUR RISQUE SPÉCIFIQUE SELON LE MODÈLE [LE PLUS ÉLEVÉ DE L ET DE (N x4)]		
	3989	
EXIGENCE TOTALE POUR VALEUR À RISQUE (O + P)		
	3990	

K
L
M
N

O
P
Q

PARTIE B - MODÈLE DE CONTRÔLE EX POST DE LA VALEUR À RISQUE CONSOLIDÉE				
CONTRÔLE PRUDENTIEL EXPOST DE LA VALEUR A RISQUE POUR UN JOUR				
CONTRÔLE PRUDENTIEL EXPOST DE LA VALEUR À RISQUE POUR UN JOUR	NOMBRE DE JOURS DE CONTRÔLE PRUDENTIEL EX POST DEPUIS LA DERNIÈRE DATE DE DÉCLARATION	NOMBRE D'EXCEPTIONS	MOYENNE DU TRIMESTRE	
			VALEUR À RISQUE POUR UN JOUR	DIVERGENCE MOYENNE
	3991	3992	3993	3994