

NORMES DE FONDS PROPRES

| SIF | G3 | | | | | | | | |

Nom de l'institution

Au date

NFP 1

(EN MILLIERS DE DOLLARS, À L'EXCEPTION DES RATIOS)

RATIO DES FONDS PROPRES À RISQUE

ACTIF PONDÉRÉ EN FONCTION DES RISQUES		
ACTIF FIGURANT AU BILAN (NFP 3)	0300	
ENGAGEMENTS HORS BILAN (NFP 4)	0301	
TOTAL DE L'ACTIF PONDÉRÉ EN FONCTION DES RISQUES	A+B	0302
FONDS PROPRES DE CATÉGORIE 1 NETS (NFP 2)		
TOTAL DES FONDS PROPRES (NFP 2)	2282	0303
RATIO DES FONDS PROPRES DE CATÉGORIE 1 À RISQUE	(D+C)x100	2283
RATIO DES FONDS PROPRES À RISQUE	(E+C)x100	0304

A
B
C

D
E

RATIO ACTIF/FONDS PROPRES

ACTIF FIGURANT AU BILAN - VALEUR COMPTABLE (NFP 3)	0305	
ENGAGEMENTS HORS BILAN (NFP 4)		
SUBSTITUTS DIRECT DE CRÉDIT	0306	
ENGAGEMENTS DE GARANTIE LIÉS À DES TRANSACTIONS	0307	
ENGAGEMENTS À COURT TERME À DÉNOUEMENT AUTOMATIQUE LIÉS À DES OPÉRATIONS COMMERCIALES	0308	
ENGAGEMENTS DE REPRISE	0309	
TOTAL DE L'ACTIF FIGURANT AU BILAN ET HORS BILAN	F+G+H+I+J	0310
MOINS :		
LES ÉLÉMENTS D'ACTIF INCORPORELS EXCÉDENTAIRES	2284	
ACHALANDAGE	0311	
PLACEMENTS DANS DES FILIALES NON CONSOLIDÉES/INTÉRÊT DE GROUPE FINANCIER	0312	
AUTRES INSTRUMENTS CONSIDÉRÉS COMME DES FONDS PROPRES	0313	
ACHATS MUTUELS ENTRE INSTITUTIONS DE TITRES NOUVELLEMENT ÉMIS	0314	
PROTECTION DE PREMIER NIVEAU	1907	
GARANTIES DE PRÊTS DE TITRES	1908	
IMPACT DE L'ACCORD CADRE DE COMPENSATION	2308	
AUTRES	0315	
DÉDUCTIONS TOTALES	L+M+N+O+P+Q+R+S+T	0316
ACTIF FIGURANT AU BILAN ET HORS BILAN - NET	K-V	0317
TOTAL DES FONDS PROPRES (NFP 2)	2286	0318
RATIO ACTIF/FONDS PROPRES	W+E	0318
POSTE POUR MÉMOIRE		
RATIO ACTIF/FONDS PROPRES AUTORISÉ	0298	

F
G
H
I
J
K

L
M
N
O
P
Q
R
T
U
V

W
E

NORMES DE FONDS PROPRES

ÉLÉMENTS DES FONDS PROPRES (VOIR LA SECTION A-2 DE LA LIGNE DIRECTRICE)

NFP 2

CATÉGORIE 1			
ACTIONS ORDINAIRES	0319		
SURPLUS D'APPORT	0320		
BÉNÉFICES NON DISTRIBUÉS	0321		
REDRESSEMENT DES CONVERSIONS EN DEVISE ÉTRANGÈRE	0449		
ACTIONS PRIVILÉGIÉES PERPÉTUELLES NON CUMULATIVES	0322		
INSTRUMENTS NOVATEURS INCLUS DANS LES FONDS PROPRES DE CATÉGORIE 1	2289		Y
PARTICIPATIONS SANS CONTRÔLE DANS DES FILIALES DE LA CATÉGORIE 1 (EXCLUANT LES NOVATEURS DE LA CATÉGORIE 1)			
ACTIONS ORDINAIRES	0521		
ACTIONS PRIVILÉGIÉES PERPÉTUELLES NON CUMULATIVES	0522		
FONDS PROPRES BRUTS DE LA CATÉGORIE 1	0324		
MOINS :			
ÉLÉMENTS D'ACTIF INCORPORELS EXCÉDENTAIRES	2290		L
ACHALANDAGE	0325		M
CESSION DE POSITION VENDEUR DE SES PROPRES ACTIONS (MONTANT BRUT)	2291		
POUR USAGE ULTÉRIEUR	2292		
FONDS PROPRES NETS DE LA CATÉGORIE 1	0326		D
CATÉGORIE 2A			
ACTIONS PRIVILÉGIÉES	0327		
DETTES SUBORDONNÉES	0328		
PROVISIONS GÉNÉRALES ADMISSIBLES*	0299		Z
PARTICIPATIONS SANS CONTRÔLE DANS DES FILIALES (INSTRUMENTS HYBRIDES)	0329		
FONDS PROPRES BRUTS DE LA CATÉGORIE 2A	0330		AA
CATÉGORIE 2B			
ACTIONS PRIVILÉGIÉES	0331		
DETTES SUBORDONNÉES	0332		
PARTICIPATIONS SANS CONTRÔLE DANS DES FILIALES (INSTRUMENTS SUBORDONNÉS À TERME)	0333		
FONDS PROPRES BRUTS DE LA CATÉGORIE 2B	0334		AB
FONDS PROPRES DE LA CATÉGORIE 2	AA+AB	0335	
MOINS : POUR USAGE ULTÉRIEUR	2293		
MONTANT NET DES FONDS PROPRES DE CATÉGORIE 2	2294		AC
TOTAL DES FONDS PROPRES DES CATÉGORIES 1 ET 2	D+AC	0336	
MOINS :			
PLACEMENTS DANS DES FILIALES NON CONSOLIDÉES/INTÉRÊT DE GROUPE FINANCIER	0337		N
AUTRES INSTRUMENTS CONSIDÉRÉS COMME DES FONDS PROPRES	0338		O
ACHATS MUTUELS ENTRE INSTITUTIONS DE TITRES NOUVELLEMENT ÉMIS	0339		P
PROTECTION DE PREMIER NIVEAU	1909		Q
AUTRES	0340		AD
TOTAL DES FONDS PROPRES	(D+AC)-(N+O+P+Q+AD)	0341	E

NORMES DE FONDS PROPRES

| SIF | G3 | | | | | |

ÉLÉMENTS DES FONDS PROPRES (VOIR LA SECTION A-2 DE LA LIGNE DIRECTRICE)

NFP 2

LIMITES

RATIO DES FONDS PROPRES DE LA CATÉGORIE 1	(AC+D)x100	0342	
RATIO DES FONDS PROPRES DE LA CATÉGORIE 2	(AB+D)x100	0343	
INSTRUMENTS NOVATEURS INCLUS DANS LES FONDS PROPRES DE CATÉGORIE 1 EN % DU MONTANT NET DES FONDS PROPRES DE CATÉGORIE 1	(Y+D)x100	2295	

POSTE POUR MÉMOIRE

INSTRUMENTS FINANCIERS COMPRIS DANS LES FONDS PROPRES DE CATÉGORIE 1, DÉCLARÉS COMME DES ENGAGEMENTS OU NON CONSOLIDÉS, MAIS BÉNÉFICIAIRES DE DROITS ACQUIS EN VERTU DES PRÉAVIS DE JUILLET 2003 ET(OU) DE FÉVRIER 2004 DU BSIF, ET DÉCLARÉS CI-DESSOUS SOUS:			
ACTIONS PRIVILÉGIÉES PERPÉTUELLES NON CUMULATIVES (POINT DE DONNÉE 0322)		2328	
INSTRUMENTS NOVATEURS (POINT DE DONNÉE 2289)		2329	
PARTICIPATION SANS CONTRÔLE - ACTIONS PRIVILÉGIÉES PERPÉTUELLES NON CUMULATIVES (POINT DE DONNÉE 0522)		2330	

Nota : Les instruments de la catégorie 2 doivent être déclarés nets de l'amortissement. Joindre le détail du calcul de l'amortissement.

NORMES DE FONDS PROPRES

(EN MILLIERS DE DOLLARS, À L'EXCEPTION DES RATIOS)
VOIR LA SECTION A-3 DE LA LIGNE DIRECTRICE

NFP 3

ÉLÉMENTS D'ACTIF	PONDÉRATION EN FONCTION DES RISQUES	0344	SOLDE	AJUSTEMENT AUX FINS DES NANTISSEMENT		AJUSTEMENT AUX FINS DES GARANTIES		ACTIF NET	0389	ACTIF NET PONDÉRÉ EN FONCTION DES RISQUES
				0354	0364	0374	0399			
PIÈCES D'OR ET LINGOTS D'OR ET D'ARGENT	100%	0344		0354	0364	0374		0389		
	20%			0355	0365	0375		0390		
	0%	0345		0356	0366	0376				
AUTRES PIÈCES ET BILLETS DE BANQUE	0%	0447					0448			
DEPÔTS À LA BANQUE DU CANADA	0%	0348					0379			
DEPÔTS À DES INSTITUTIONS FINANCIÈRES RÉGLEMENTÉES, MOINS RÉSERVE POUR CRÉANCES DOUTEUSES										
a) BANQUES CENTRALES DE L'OCDE	0%	0349					0380			
b) BANQUES CENTRALES NON MEMBRES DE L'OCDE, EN MONNAIES LOCALES	0%	0350					0381			
c) BANQUES DE L'OCDE ET INSTITUTIONS DE DÉPÔTS CANADIENNES	20%	0351		0357	0367		0382		0391	
	0%			0358	0368		0383			
d) BANQUES NON MEMBRES DE L'OCDE - ÉCHÉANCE RÉSIDUELLE D'UN AN OU MOINS	20%	0352		0359	0369		0384		0392	
	0%			0360	0370		0385			
e) AUTRES	100%	0353		0361	0371		0386		0393	
	20%	2309		0362	0372		0387		0394	
	0%			0363	0373		0388			
CHEQUES ET AUTRES EFFÊTS EN COURS DE COMPENSATION (VALEUR NETTE)	20%	0395		0405	0416		0427		0440	
	0%			0406	0417		0428			
VALEURS MOBILIÈRES ÉMISES OU GARANTIS PAR LE CANADA	0%	0396					0429			
VALEURS MOBILIÈRES ÉMISES OU GARANTIES PAR LES PROVINCES OU TERRITOIRES CAN	0%	0397					0430			
VALEURS MOBILIÈRES ÉMISES OU GARANTIES PAR DES MUNICIPALITÉS OU DES CONSEIL SCOLAIRES DU CANADA	20%	0398		0407	0418		0431		0441	
	0%			0408	0419		0432			
AUTRES VALEURS MOBILIÈRES, MOINS RÉSERVE POUR CRÉANCES DOUTEUSES	100%	0399		0409	0420		0433		0442	
	50%	0400		0410	0421		0434		0443	
	20%	0401		0411	0422		0435		0444	
	0%	0402		0412	0423		0436			

NORMES DE FONDS PROPRES

| SIF | G3 | | | | | | |

(EN MILLIERS DE DOLLARS, À L'EXCEPTION DES RATIOS)
VOIR LA SECTION A-3 DE LA LIGNE DIRECTRICE

NFP 3

ÉLÉMENTS D'ACTIF	PONDÉRATION EN FONCTION DES RISQUES	SOLDE	AJUSTEMENT AUX FINS DES NANTISSEMENT		AJUSTEMENT AUX FINS DES GARANTIES		ACTIF NET	ACTIF NET PONDÉRÉ EN FONCTION DES RISQUES	
PRÊTS NON HYPOTHÉCAIRES, MOINS RÉSERVE POUR CRÉANCES DOUTEUSES									
a) À VUE ET À COURT TERME À DES NÉGOCIANTS EN PLACEMENTS ET DES COURTIERS, GARANTIS	100%	0403		0413		0424		0437	0445
	20%	0404		0414		0425		0438	0446
	0%			0415		0426		0439	
b) À DES INSTITUTIONS FINANCIÈRES RÉGLEMENTÉES									
(i) BANQUES CENTRALES DE L'OCDE	0%	0450					0480		
(ii) BANQUES MULTILATÉRALES DE DEVELOPPEMENT	20%	0451		0457		0468		0481	0493
	0%			0458		0469		0482	
(iii) BANQUES DE L'OCDE ET INSTITUTIONS DE DÉPÔT CDN.	20%	0452		0459		0470		0483	0494
	0%			0460		0471		0484	
(iv) BANQUES AYANT LEUR SIÈGE SOCIAL HORS DE L'OCDE - ASSORTIS D'UNE ÉCHÉANCE RÉSIDUELLE D'UN AN OU MOINS	20%	0453		0461		0472		0485	0495
	0%			0462		0473		0486	
(v) AUTRES	100%	0454		0463		0474		0487	0496
	20%	2311		0464		0475		0488	0497
	0%			0465		0476		0489	
c) AU GOUVERNEMENT FÉDÉRAL, AUX PROVINCES ET À DES CORPS MUNICIPAUX OU SCOLAIRES DU CANADA	20%	1824		1828		1832		1836	1839
	0%	0455		1829		1833		0490	
d) À DES ADMINISTRATION PUBLIQUES ÉTRANGÈRES	100%	1825		1830		1834		1837	1840
	50%	1826		1831		1835		1838	1841
	20%	0456		0466		0477		0491	0498
	0%	1827		0467		0478		0492	
e) CRÉANCES DE CRÉDIT-BAIL	100%	0500		0511		0525		0540	0555
	20%	0501		0512		0526		0541	0556
	0%	0502		0513		0527		0542	

NORMES DE FONDS PROPRES

| SIF | G3 | | | | | |

(EN MILLIERS DE DOLLARS, À L'EXCEPTION DES RATIOS)
VOIR LA SECTION A-3 DE LA LIGNE DIRECTRICE

NFP 3

ÉLÉMENTS D'ACTIF	PONDÉRATION EN FONCTION DES RISQUES	SOLDE		AJUSTEMENT AUX FINS DES NANTISSEMENT	AJUSTEMENT AUX FINS DES GARANTIES	ACTIF NET	ACTIF NET PONDÉRÉ EN FONCTION DES RISQUES
PRÊTS NON HYPOTHÉCAIRES, MOINS RÉSERVE POUR CRÉANCES DOUTEUSES							
f) À DES PARTICULIERS À DES FINS NON COMMERCIALES	100%	0503	0514	0528	0543	0557	
	50%	0504	0515	0529	0544	0558	
	20%	0505	0516	0530	0545	0559	
	0%	0506	0517	0531	0546		
g) À DES PARTICULIERS ET À D'AUTRES À DES FINS COMMERCIALES ET ACCORDS DE PRISE EN PENSION	100%	1843	1848	1853	1858	1864	
	50%	1844	1849	1854	1859	1865	
	20%	1845	1850	1855	1860	1866	
	0%	1846	1851	1856	1861		
PRÊTS HYPOTHÉCAIRES, MOINS RÉSERVE POUR CRÉANCES DOUTEUSES							
a) RÉSIDENTIELS							
(i) ASSURÉS							
(A) LNH	0%	0507	0518	0532	0548	1868	
(B) AUTRES	50%	0508	1852	1857	1862		
	0%	1847	1852	1857	1862		
(ii) NON ASSURÉS							
	100%	1869	1872	1878	1884	1890	
	50%	1870	1873	1879	1885	1891	
	0%		1874	1880	1886		
b) NON RÉSIDENTIELS							
	100%	1871	1875	1881	1887	1892	
	20%		1876	1882	1888	1893	
	0%		1877	1883	1889		
ENGAGEMENTS DE CLIENTS AU TITRE D'ACCEPTATIONS, MOINS RÉSERVE POUR CRÉANCES DOUTEUSES							
	100%	0565	0574	0583	0592	0601	
	20%	0566	0575	0584	0593	0602	
	0%	0567	0576	0585	0594		
TERRAINS, BÂTIMENTS ET MATÉRIEL, MOINS AMORTISSEMENT CUMULÉ							
	100%	0568			0595	0603	
ÉLÉMENTS D'ACTIF LIÉS AUX							
OPÉRATIONS D'ASSURANCES ET	100%	0569	0578	0587	0596	0604	
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF	50%	0570	0579	0588	0597	0605	
	20%	0571	0580	0589	0598	0606	
	0%	0572	0581	0590	0599		
TOTAL DE L'ACTIF FIGURANT AU BILAN							
		0573	0582	0591	0600	0607	
PLUS : PROVISION GÉNÉRALE ADMISSIBLE INCLUSE DANS LES FONDS PROPRES DE CATEGORIE 2A							
		2296			2306	2302	Z
TOTAL RAJUSTÉ DES ÉLÉMENTS D'ACTIF AU BILAN							
		2297	2298	2299	2300	2304	A

NORMES DE FONDS PROPRES

ENGAGEMENTS HORS BILAN (EN MILLIERS DE DOLLARS)

VOIR LA SECTION A-4 DE LA LIGNE DIRECTRICE

NFP 4

INSTRUMENT		MONTANT NOMINAL DE RÉFÉRENCE (1)	FACTEUR DE CONVERSION EN ÉQUIVALENT- CRÉDIT (2)	FACTEUR DE PONDÉRATION DES RISQUES (3)	ÉQUIVALENT DU FACTEUR DE PONDÉRATION DES RISQUES (1x2x3)
SUBSTITUTS DIRECTS DE CRÉDIT		0610	100%	0%	
	G	0611	100%	20%	0625
		0612	100%	100%	0626
ENGAGEMENTS DE GARANTIE LIÉS À DES TRANSACTIONS		0613	50%	0%	
	H	0614	50%	20%	0627
		0615	50%	100%	0628
ENGAGEMENTS À COURT TERME À DÉNOUEMENT AUTOMATIQUE LIÉS À DES OPÉRATIONS COMMERCIALES		0616	20%	0%	
	I	0617	20%	20%	0629
		0618	20%	100%	0630
ENGAGEMENTS DE REPRISE		0619	100%	0%	
	J	0620	100%	20%	0631
		0621	100%	100%	0632
ACHATS À TERME D'ÉLÉMENTS D'ACTIF		0622	100%	0%	
		0623	100%	20%	0633
		0624	100%	100%	0634
DÉPÔTS TERME CONTRE TERME		0635	100%	0%	
		0636	100%	20%	0651
		0637	100%	100%	0652
AUTRES ENGAGEMENTS AVEC CERTITUDE D'APPEL DE FONDS		0638	100%	0%	
		0639	100%	20%	0653
		0640	100%	100%	0654
FACILITÉS D'ÉMISSION D'EFFETS (NIF) ET FACILITÉS RENOUVELABLES À PRISE FERME (RUF)		0641	50%	0%	
		0642	50%	20%	0655
		0643	50%	100%	0656
ENGAGEMENTS À L'ÉGARD DE LA TITRISATION DE L'ACTIF - FACILITÉS DE FINANCEMENT ADMISSIBLES ¹					
		0861	0%	0%	
		0862	10%	100%	0903
AUTRES ENGAGEMENTS		0644	0%	0%	
		0645	50%	0%	
		0646	50%	20%	0657
		0647	50%	100%	0658
CONTRATS DÉRIVÉS (ANNEXE II)					
					0659
					0660
					1910
					1911
					1912
TOTAL DES ENGAGEMENTS HORS BILAN					0661

¹ - Entre en vigueur au même moment que la nouvelle version de la ligne directrice B-5

NORMES DE FONDS PROPRES

| SIF | G3 | | | | | | |

(EN MILLIERS DE DOLLARS)

NFP 4 - ANNEXE I

TOTAL DES CONTRATS - ÉCHÉANCE RÉSIDUELLES

CONTRATS DÉRIVÉS MONTANTS NOTIONNELS	CONTRATS DÉTENUS À DES FINS COMMERCIALES		TOTAL DES CONTRATS	JUSQU'À UN AN	PLUS D'UN AN - JUSQU'À 5 ANS	PLUS DE 5 ANS
CONTRATS SUR TAUX D'INTÉRÊT						
CONTRATS HORS-COTE						
CONTRATS À TERME	1913	1928	1943	1958	1973	
CONTRATS D'ÉCHANGE	1914	1929	1944	1959	1974	
OPTIONS ACHETÉES	1915	1930	1945	1960	1975	
OPTIONS SOUSCRITES	1916	1931	1946	1961	1976	
Total	1917	1932	1947	1962	1977	
CONTRATS INSCRITS À LA BOURSE						
CONTRATS À TERME NORMALISÉS - POSITIONS CRÉDITRICES	1918	1933	1948	1963	1978	
CONTRATS À TERME NORMALISÉS - POSITIONS À DÉCOUVERT	1919	1934	1949	1964	1979	
OPTIONS ACHETÉES	1920	1935	1950	1965	1980	
OPTIONS SOUSCRITES	1921	1936	1951	1966	1981	
Total	1922	1937	1952	1967	1982	
CONTRATS SUR DEVICES ET OR						
CONTRATS HORS-COTE						
CONTRATS À TERME	1923	1938	1953	1968	1983	
CONTRATS D'ÉCHANGE	1924	1939	1954	1969	1984	
OPTIONS ACHETÉES	1925	1940	1955	1970	1985	
OPTIONS SOUSCRITES	1926	1941	1956	1971	1986	
Total	1927	1942	1957	1972	1987	
CONTRATS INSCRITS À LA BOURSE						
CONTRATS À TERME NORMALISÉS - POSITIONS CRÉDITRICES	1988	2003	2018	2033	2048	
CONTRATS À TERME NORMALISÉS - POSITIONS À DÉCOUVERT	1989	2004	2019	2034	2049	
OPTIONS ACHETÉES	1990	2005	2020	2035	2050	
OPTIONS SOUSCRITES	1991	2006	2021	2036	2051	
Total	1992	2007	2022	2037	2052	
CONTRATS SUR ACTIONS						
CONTRATS HORS-COTE						
CONTRATS À TERME		2008				
CONTRATS D'ÉCHANGE		2009				
OPTIONS ACHETÉES		2010	2025	2040	2055	
OPTIONS SOUSCRITES		2011				
Total	1997	2012	2027	2042	2057	

NORMES DE FONDS PROPRES

| SIF | G3 | | | | | |

(EN MILLIERS DE DOLLARS)

NFP 4 - ANNEXE I

TOTAL DES CONTRATS - ÉCHÉANCE RÉSIDUELLES

CONTRATS DÉRIVÉS MONTANTS NOTIONNELS	CONTRATS DÉTENUS À DES FINS COMMERCIALES		TOTAL DES CONTRATS	JUSQU'À UN AN	PLUS D'UN AN - JUSQU'À 5 ANS	PLUS DE 5 ANS
CONTRATS SUR ACTIONS						
CONTRATS INSCRITS À LA BOURSE						
CONTRATS À TERME NORMALISÉS - POSITIONS CRÉDITRICES		2013				
CONTRATS À TERME NORMALISÉS - POSITIONS À DÉCOUVERT		2014				
OPTIONS ACHETÉES		2015	2030	2045	2060	
OPTIONS SOUSCRITES		2016				
Total	2002	2017	2032	2047	2062	
CONTRATS SUR MÉTAUX (AUTRES QUE L'OR)						
CONTRATS HORS-COTE						
CONTRATS À TERME		2073				
CONTRATS D'ÉCHANGE		2074				
OPTIONS ACHETÉES		2075	2085	2095	2105	
OPTIONS SOUSCRITES		2076				
Total	2067	2077	2087	2097	2107	
CONTRATS INSCRITS À LA BOURSE						
CONTRATS À TERME NORMALISÉS - POSITIONS CRÉDITRICES		2078				
CONTRATS À TERME NORMALISÉS - POSITIONS À DÉCOUVERT		2079				
OPTIONS ACHETÉES		2080	2090	2100	2110	
OPTIONS SOUSCRITES		2081				
Total	2072	2082	2092	2102	2112	
CONTRATS SUR PRODUITS DE BASE						
CONTRATS HORS-COTE						
CONTRATS À TERME		2123				
CONTRATS D'ÉCHANGE		2124				
OPTIONS ACHETÉES		2125	2135	2145	2155	
OPTIONS SOUSCRITES		2126				
Total	2117	2127	2137	2147	2157	
CONTRATS INSCRITS À LA BOURSE						
CONTRATS À TERME NORMALISÉS - POSITIONS CRÉDITRICES		2128				
CONTRATS À TERME NORMALISÉS - POSITIONS À DÉCOUVERT		2129				
OPTIONS ACHETÉES		2130	2140	2150	2160	
OPTIONS SOUSCRITES		2131				
Total	2122	2132	2142	2152	2162	
Total	2272	2273	2274	2275	2276	

NORMES DE FONDS PROPRES

| SIF | G3 | | | | | | |

(EN MILLIERS DE DOLLARS)

NFP 4 - ANNEXE II

COÛT DE REMPLACEMENT, RISQUE DE CRÉDIT POTENTIEL, ÉQUIVALENT RISQUE
DE CRÉDIT ET ÉQUIVALENT DU FACTEUR DE PONDÉRATION DES RISQUES

		CONTRATS SUR TAX D'INTÉRÊT	CONTRATS SUR DEVISES ET OR	CONTRATS SUR ACTIONS	CONTRATS SUR MÉTAUX PRÉCIEUX (AUTRES QUE L'OR)	CONTRATS SUR PRODUITS DE BASE
COÛT DE REMPLACEMENT (VALEUR MARCHANDE)						
(a) CONTRATS DÉTENUS À DES FINS COMMERCIALES (INCLURE TOUS LES CONTRATS AVANT LA COMPENSATION PERMISE)						
COÛT DE REMPLACEMENT POSITIF BRUT	2163	2179	2195	2211	2227	
COÛT DE REMPLACEMENT NÉGATIF BRUT	2164	2180	2196	2212	2228	
(b) CONTRATS DÉTENUS À DES FINS AUTRES QUE COMMERCIALES (INCLURE TOUS LES CONTRATS AVANT LA COMPENSATION PERMISE)						
COÛT DE REMPLACEMENT POSITIF BRUT	2165	2181	2197	2213	2229	
COÛT DE REMPLACEMENT NÉGATIF BRUT	2166	2182	2198	2214	2230	
(c) CONTRATS ASSUJETTIS À LA COMPENSATION PERMISE (INCLUS DANS a) ET b) CI-DESSUS)						
COÛT DE REMPLACEMENT POSITIF BRUT	2167	2183	2199	2215	2231	
COÛT DE REMPLACEMENT NÉGATIF BRUT	2168	2184	2200	2216	2232	
COÛT DE REMPLACEMENT POSITIF NET	2169	2185	2201	2217	2233	
(d) TOTAL DES CONTRATS (APRÈS LA COMPENSATION PERMISE)						
COÛT DE REMPLACEMENT POSITIF BRUT	2170	2186	2202	2218	2234	
RISQUE DE CRÉDIT POTENTIEL						
CONTRATS NON ASSUJETTIS À LA COMPENSATION PERMISE	2171	2187	2203	2219	2235	
CONTRATS ASSUJETTIS À LA COMPENSATION PERMISE	2172	2188	2204	2220	2236	
MONTANT EN ÉQUIVALENT RISQUE DE CRÉDIT (COMPTE TENU DES NANTISSEMENTS ET GARANTIES)						
CONTRATS NON ASSUJETTIS À LA COMPENSATION PERMISE	2173	2189	2205	2221	2237	
CONTRATS ASSUJETTIS À LA COMPENSATION PERMISE	2174	2190	2206	2222	2238	
ÉQUIVALENT DU FACTEUR DE PONDÉRATION DES RISQUES (COMPTE TENU DES NANTISSEMENTS ET GARANTIES)						
CONTRATS NON ASSUJETTIS À LA COMPENSATION PERMISE	20%	2175	2191	2207	2223	2239
	50%	2176	2192	2208	2224	2240
CONTRATS ASSUJETTIS À LA COMPENSATION PERMISE	20%	2177	2193	2209	2225	2241
	50%	2178	2194	2210	2226	2242
TOTAL DES CONTRATS (REPORTER AU NFP 4)						
	2277	2278	2279	2280	2281	

NORMES DE FONDS PROPRES

| SIF | G3 | | | | | | |

(EN MILLIERS DE DOLLARS)

NFP 4 - ANNEXE III

CONTRATS DÉRIVÉS HORS-COTE - QUALITÉ DE CRÉDIT

TABLEAU 1 - DONNÉES SUR LA QUALITÉ DE CRÉDIT DES CONTRATS DÉRIVÉS HORS-COTE

MONTANTS À RISQUE AVANT NANTISSEMENTS ET GARANTIES

EQUIVALENT RISQUE DE
CRÉDIT APRÈS
NANTISSEMENT ET GARANTIES

		VALEUR MARCHANDE POSITIVE BRUTE (avant compensation)		RISQUE DE CRÉDIT ACTUEL (après compensation)		RISQUE DE CRÉDIT POTENTIEL	
PONDERATION DES RISQUES DE CONTREPARTIE	0%	2243		2251		2259	
	20%	2244		2252		2260	
	50%	2245		2253		2261	
TOTAL		2246		2254		2262	

QUALITÉ DE CRÉDIT		Collateral		Garantees	
	0%	2247		2255	
	20%	2248		2256	
	50%				
TOTAL		2250		2258	

TABLEAU II - DONNÉES SUR LES INSTRUMENTS DÉRIVÉS HORS-COTE EN SOUFFRANCE ET LES CRÉANCES IRRÉCOUVRABLES

INSTRUMENTS DÉRIVÉS EN SOUFFRANCE DE 30 À 89 JOURS		
VALEUR COMPTABLE		2267
COÛT DE REMPLACEMENT POSITIF BRUT		2268
INSTRUMENTS DÉRIVÉS EN SOUFFRANCE D'AU MOINS 90 JOURS		
VALEUR COMPTABLE		2269
COÛT DE REMPLACEMENT POSITIF BRUT		2270
CRÉANCES IRRÉCOUVRABLES SUR INSTRUMENTS DÉRIVÉS PERTES CUMULATIVES POUR L'EXERCICE EN COURS		2271

NORMES DE FONDS PROPRES

| SIF | G3 | | | | | | |

CAR 5

(EN MILLIERS DE DOLLARS)

NOTES ADDITIONNELLES - REMPLIR À LA FIN DE L'EXERCICE SEULEMENT

		BANQUES CANADIENNES		BANQUES ÉTRANGÈRES
PLACEMENTS DANS DES INSTRUMENTS DE CATÉGORIE 1 D'AUTRES BANQUES	1814		1819	
PLACEMENTS DANS DES INSTRUMENTS DE CATÉGORIE 2A D'AUTRES BANQUES	1815		1820	
PLACEMENTS DANS DES INSTRUMENTS DE CATÉGORIE 2B D'AUTRES BANQUES	1816		1821	
TOTAL DES PLACEMENTS DANS DES INSTRUMENTS D'AUTRES BANQUES	1817		1822	
PLACEMENTS COMPTABILISÉS À LA VALEUR DE CONSOLIDATION COMPRIS DANS LE TOTAL PRÉCÉDENT	1818		1823	

Renseignements supplémentaires

Il n'est plus nécessaire de fournir les renseignements suivants, à moins que le BSIF en fasse la demande :

- 1) Les détails des émissions émanant des dettes subordonnées et des actions privilégiées comprises dans les fonds propres de catégorie 2, en faisant la distinction entre les fonds propres de catégorie 2(A) et celles de la catégorie 2(B).
- 2) La cédule de l'amortissement des émissions venant à maturité d'ici cinq ans.