



State Street Trust Company Canada
Communications dans le cadre du Pilier 3
31 décembre 2023



State Street Trust Company Canada

Contenu

CC1 : Composition des capitaux propres	3
LR : Ratio de levier	4
KM1 : Mesures clés	4

CC1 : Composition des capitaux propres

31-déc.-23

Capitaux propres de base de catégorie 1 : instruments et réserves		
1	Capital-actions de base remplissant les critères et émis directement (et équivalent pour les sociétés autres que sociétés par actions) plus l'excédent de capital lié correspondant	54 513
2	Bénéfices non distribués	138 622
3	Autres éléments cumulés du résultat étendu (et autres réserves)	- 9
6	Capitaux propres de base de catégorie 1 avant ajustements réglementaires	193 126
Capitaux propres de base de catégorie 1 : ajustements réglementaires		
28	Total des ajustements réglementaires aux capitaux propres de base de catégorie 1	N/A
29	Capitaux propres de base de catégorie 1 (CET1)	193 126
Capitaux propres de base de catégorie 1 supplémentaires : instruments		
36	Capitaux propres de base de catégorie 1 supplémentaires avant ajustements réglementaires	N/A
Capitaux propres de base de catégorie 1 supplémentaires : avant ajustements réglementaires		
43	Total des ajustements réglementaires des capitaux propres de base de catégorie 1 supplémentaires	N/A
44	Capitaux propres de base de catégorie 1 supplémentaires (AT1)	N/A
45	Capitaux propres de base de catégorie 1 (T1 = CET1 + AT1)	193 126
Capitaux propres de catégorie 2 : instruments et réserves		
51	Capitaux propres de catégorie 2 avant ajustements réglementaires	N/A
Capitaux propres de catégorie 2 : ajustements réglementaires		
57	Total des ajustements réglementaires des capitaux propres de catégorie 2	N/A
58	Capitaux propres de catégorie 2 (T2)	N/A
59	Total des capitaux propres (TC = T1 + T2)	193 126
60	Actifs pondérés du risque totaux	623 439
60a	Ajustement de l'évaluation du crédit (CVA) Actifs pondérés du risque (RWA)	N/A
Ratios de capitaux propres		
61	Capitaux propres de base de catégorie 1 (en pourcentage des actifs pondérés du risque)	30.98 %
62	Catégorie 1 (en pourcentage des actifs pondérés du risque)	30.98 %
63	Total des capitaux propres (en pourcentage des actifs pondérés du risque)	30.98 %
Objectif du BSIF		
69	Ratio cible de capitaux propres de base et assimilés de catégorie 1	7.00 %
70	Ratio cible de capitaux propres de catégorie 1	8.50 %
71	Ratio cible du total des capitaux propres	10.50 %

LR : Ratio de levier

	31-déc.-23	30-sept.-23
Expositions au bilan		
1 Postes au bilan (à l'exception des dérivés, des OFT et des expositions sur titrisation faisant l'objet de droits acquis, mais comprenant les garanties)	244 181	232 525
4 (Montants des actifs déduits du calcul des capitaux propres de catégorie 1)	0	0
5 Total des expositions au bilan (à l'exclusion des dérivés et des OFT) (somme des lignes 1 à 4)	244 181	232 525
Capitaux propres et expositions totales		
20 Capitaux propres de catégorie 1	193 126	181 732
21 Total – Expositions (somme des lignes 5, 11, 16 et 19)	244 181	232 525
Ratio de levier		
22 Ratio de levier de Bâle III	79.09 %	78.16 %

KM1 : Mesures clés

	31-déc.-23	30-sept.-23	30-juin-23	31-mars-23	31-déc.-22
Capitaux propres disponibles (montants)					
1 Capitaux propres de base de catégorie 1 (CET1)	193 126	181 732	288 945	268 120	245 944
2 Catégorie 1	193 126	181 732	288 945	268 120	245 944
3 Total des capitaux propres	193 126	181 732	288 945	268 120	245 944
Actifs pondérés du risque (montants)					
4 Actifs pondérés du risque totaux (RWA)	623 439	613 250	618 087	621 969	593 337
Ratios de capitaux propres fondés sur le risque en pourcentage des RWA					
5 Ratio CET1 (%)	30.98 %	29.63 %	46.75 %	43.11 %	41.45 %
6 Ratio de catégorie 1 (%)	30.98 %	29.63 %	46.75 %	43.11 %	41.45 %
7 Ratio de capital propres total (%)	30.98 %	29.63 %	46.75 %	43.11 %	41.45 %
Exigences supplémentaires en matière de tampon CET1 en pourcentage des RWA					
8 Exigence de tampon de conservation des capitaux propres (2,5 % par rapport à 2019) (%)	2.50 %	2.50 %	2.50 %	2.50 %	2.50 %
9 Exigence de tampon anticyclique (%)	0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
11 Total des exigences de tampon spécifiques CET1 de la banque (%) (ligne 8 + ligne 9 + ligne 10)	2.50 %	2.50 %	2.50 %	2.50 %	2.50 %
12 CET1 disponible après avoir satisfait aux exigences de capitaux propres minimales de la banque (%)	23.98 %	22.63 %	39.75 %	36.11 %	34.45 %
Ratio de levier de Bâle III					
13 Mesure de l'exposition totale au ratio de levier de Bâle III :	244 181	232 525	337 007	318 345	303 323
14 Ratio de levier de Bâle III (ligne 2/ligne 13)	79.09 %	78.16 %	85.74 %	84.22 %	81.08 %