

State Street Trust Company Canada

30 Septembre, 2016

Élément		Cadre du ratio de levier
Expositions au bilan		in \$ 000's
1	Postes au bilan (à l'exception des dérivés, des OFT et des expositions sur titrisation faisant l'objet de droits acquis, mais les garanties)	181,555
2	(Montants des actifs déduits du calcul des fonds propres de catégorie 1 « tout compris » de Bâle III	0
3	<b>Total des expositions au bilan</b> (à l'exclusion des dérivés et des OFT) (somme des lignes 1 et 2)	181,555
Expositions sur dérivés		
4	Coût de remplacement lié aux opérations sur dérivés (moins la marge pour variation admissible en espèces	0
5	Majorations pour exposition potentielle future (EPF) liée à toutes les opérations sur dérivé:	0
6	Majoration pour suretés sur dérivés lorsqu'elle est déduite des actifs au bilan en vertu du référentiel comptable applicable	0
7	(Dédutions d'actifs débiteurs au titre de la marge pour variation en espèces liée aux opérations sur dérivés	0
8	(Volet exonéré d'une contrepartie centrale [CC] sur les expositions du portefeuille bancaire compensées de client	0
9	Montant notionnel effectif ajusté des dérivés de crédit souscrit:	0
10	(Compensations notionnelles effectives ajustées et majorations déduites pour les dérivés de crédit souscrits	0
11	<b>Total – Expositions sur dérivés (somme des lignes 4 à 10)</b>	0
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)	0
13	(Montants compensés de liquidités à recevoir et de liquidités à payer sur actifs bruts d'OFT	0
14	Exposition de risque de contrepartie (RC) pour les OFT	0
15	Exposition sur opérations à titre de mandataire	0
16	<b>Total – Expositions sur opérations de financement par titres (somme des lignes 12 à 15)</b>	0
Autres expositions hors bilan		
17	Exposition hors bilan sous forme de montant notionnel brut	0
18	(Ajustements pour conversion en montants en équivalent-crédit	0
19	<b>Postes hors bilan (somme des lignes 17 et 18)</b>	0
Fonds propres et expositions totales		
20	<b>Fonds propres de catégorie 1</b>	168,049
21	<b>Total – (somme des lignes 3, 11, 16 et 19)</b>	181,555
Ratios de levier		
22	<b>Ratio de levier de Bâle III</b>	92.56%