

State Street Trust Company Canada

|  |   | 30 juin, 2021            |
|--|---|--------------------------|
| Élément  |   | Leverage Ratio Framework |
| 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)                | 476,136                  |
| 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)  | 476,136                  |
| 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 dérivés   | 0                        |
| 6  | Majoration pour suretés sur dérivés lorsqu'elle est déduite des actifs au bilan en vertu du référentiel comptable applicable                                | 0                        |
| 7  | (Déductions 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 souscrits   | 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>   | 430,279                  |
| 21   | <b>Total – (somme des lignes 3, 11, 16 et 19)</b>   | 476,136                  |
| Ratios de levier                                     |   |                          |
| 22   | <b>Ratio de levier de Bâle III</b>  | 90.37%                   |