

(En millier de dollars)

	Élément	Cadre du ratio de levier
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)	395171
2	(Montants des actifs déduits du calcul des fonds propres de catégorie 1 « tout compris » de Bâle III)	217
3	Total des expositions au bilan (à l'exclusion des dérivés et des OFT) (somme des lignes 1 et 2)	394954
Expositions sur dérivés		
4	Coût de remplacement lié aux opérations sur dérivés (moins la marge pour variation admissible en espèces)	
5	Majorations pour exposition potentielle future (EPF) liée à toutes les opérations sur dérivés	
6	Majoration pour suretés sur dérivés lorsqu'elle est déduite des actifs au bilan aux termes du référentiel comptable applicable	
7	(Dédutions d'actifs débiteurs au titre de la marge pour variation en espèces liée aux opérations sur dérivés)	
8	(Volet exonéré d'une contrepartie centrale [CC] sur les expositions du portefeuille bancaire compensées de client)	
9	Montant notionnel effectif ajusté des dérivés de crédit souscrits	
10	(Compensations notionnelles effectives ajustées et majorations déduites pour les dérivés de crédit souscrits)	
11	Total – Expositions sur dérivés (somme des lignes 4 à 10)	
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)	443098
13	(Montants compensés de liquidités à recevoir et de liquidités à payer sur actifs bruts d'OFT)	
14	Exposition de risque de contrepartie (RC) pour les OFT	
15	Exposition sur opérations à titre de mandataire	
16	Total – Expositions sur opérations de financement par titres (somme des lignes 12 à 15)	443098

Autres expositions hors bilan		
17	Exposition hors bilan sous forme de montant notionnel brut	
18	(Ajustements pour conversion en montants en équivalent-crédit)	
19	Postes hors bilan (somme des lignes 17 et 18)	
Fonds propres et expositions totales		
20	Fonds propres de catégorie 1	96550
21	Total - Expositions (somme des lignes 3, 11, 16 et 19)	838052
Ratios de levier		
22	Ratio de levier de Bâle III	11.5