

BNP PARIBAS (Canada)

Modèle modifié de déclaration des fonds propres <i>(en milliers de dollars canadiens)</i>		Tout compris T4-2015
Actions ordinaires et assimilées de T1 : Instruments et réserves		
1	Actions ordinaires et assimilées admissibles directement émises plus primes liées au capital correspondantes	158 714
2	Bénéfices non répartis	428 034
3	Cumul des autres éléments du résultat étendu (et autres réserves)	(5 665)
4	Fonds propres directement émis qui seront progressivement éliminés de CET1	0
5	Actions ordinaires et assimilées émises par des filiales et détenus par des tiers (montant autorisé dans CET1)	0
6	Actions ordinaires et assimilées de T1 avant ajustements réglementaires	581 083
Actions ordinaires et assimilées de T1 : Ajustements réglementaires		
28	Total des ajustements réglementaires appliqués aux actions ordinaires et assimilées de T1	0
29	Actions ordinaires et assimilées de T1 (CET1)	581 083
Autres éléments de T1 : Instruments		
30	Autres éléments de T1 admissibles directement émis plus primes liées au capital correspondantes	0
31	dont : instruments désignés comme fonds propres selon les normes comptables applicables	0
32	dont : instruments désignés comme passifs selon les normes comptables applicables	0
33	Instruments de fonds propres émis directement qui seront progressivement éliminés des autres éléments de T1	0
34	Autres éléments de T1 (et instruments de CET1 non compris à la ligne 5) émis par des filiales et détenus par des tiers (montant autorisé dans AT1)	0
35	dont : instruments émis par des filiales et qui seront progressivement éliminés	0
36	Autres éléments de T1 avant ajustements réglementaires	0
Autres éléments de T1 : Ajustements réglementaires		
43	Total des ajustements réglementaires appliqués aux autres éléments de T1	0
44	Autres éléments de T1 (AT1)	0
45	Fonds propres T1 (T1 = CET1 + AT1)	581 083
Fonds propres complémentaires (T2) : Instruments et provisions		
46	Instruments de T2 admissibles directement émis, plus primes liées au capital	0
47	Instruments de fonds propres émis directement qui seront progressivement éliminés de T2.	200
48	Instruments de T2 (et instruments de CET1 et d'AT1 non compris aux lignes 5 ou 34) émis par des filiales et détenus par des tiers (montant autorisé dans T2)	0
49	dont : instruments émis par des filiales et qui seront progressivement éliminés	0
50	Provisions collectives	0
51	T2 avant ajustements réglementaires	200
Fonds propres complémentaires (T2) : Ajustements réglementaires		
57	Total des ajustements réglementaires appliqués aux instruments de T2	0
58	Fonds propres complémentaires (T2)	200
59	Total des fonds propres (TC = T1 + T2)	581 283
60	Total - Actifs pondérés des risques	434 466
60a	APR pour fonds propres sous forme d'actions ordinaires et assimilées de T1	434 466
60b	APR pour fonds propres de catégorie 1 (T1)	434 466
60c	APR pour le total des fonds propres	434 466
Ratios de fonds propres		
61	Actions ordinaires et assimilées de T1 (en pourcentage des actifs pondérés des risques)	133,75%
62	T1 (en pourcentage des actifs pondérés des risques)	133,75%
63	Total des fonds propres (en pourcentage des actifs pondérés des risques)	133,79%
Cible tout compris du BSIF		
69	Ratio cible tout compris d'actions ordinaires et assimilées de T1	7,0%
70	Ratio cible tout compris de fonds propres T1	8,5%
71	Ratio cible tout compris du total des fonds propres	10,5%
Instruments de fonds propres qui seront éliminés progressivement		
80	Plafond en vigueur sur les instruments de CET1 qui seront progressivement éliminés	0
81	Montants exclus de CET1 en raison d'un plafond (excédent par rapport au plafond après rachats et remboursements à l'échéance)	0
82	Plafond en vigueur sur les instruments d'AT1 destinés à être éliminés	0
83	Montants exclus d'AT1 en raison d'un plafond (excédent par rapport au plafond après rachats et remboursements à l'échéance)	0
84	Plafond en vigueur sur les instruments de T2 qui seront progressivement éliminés	200
85	Montants exclus de T2 en raison d'un plafond (excédent par rapport au plafond après rachats et remboursements à l'échéance)	0

BNP PARIBAS (Canada)

Cadre du ratio de levier <i>(en milliers de dollars canadiens)</i>		Tout compris T4-2015
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)	690 628
2	(Montants des actifs déduits du calcul des fonds propres de catégorie 1 « tout compris » de Bâle III)	0
3	Total des expositions au bilan (à l'exclusion des dérivés et des OFT)	690 628
Expositions sur dérivés		
4	Coût de remplacement lié aux opérations sur dérivés (moins la marge pour variation admissible en espèces)	80 169
5	Majorations pour exposition potentielle future (EPF) liée à toutes les opérations sur dérivés	113 894
6	Majoration pour suretés sur dérivés lorsqu'elle est déduite des actifs au bilan aux termes 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 compensée 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	Total – Expositions sur dérivés	194 063
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	Total – Expositions sur opérations de financement par titres	0
Autres expositions hors bilan		
17	Exposition hors bilan sous forme de montant notionnel brut	47 076
18	(Ajustements pour conversion en montants en équivalent-crédit)	(14 222)
19	Postes hors bilan	32 854
Fonds propres et expositions totales		
20	Fonds propres de catégorie 1	581 083
21	Total – Expositions	917 545
Ratios de levier		
22	Ratio de levier de Bâle III	63,33%