

Compagnie Trust CIBC Mellon Capital et ratios réglementaires - Bâle III Pilier 3

Modèle modifié de déclaration des fonds propres	T1 2022		T2 2022		T3 2022		T4 2022		T1 2023	
	Tout compris	Transitoire	Tout compris	Transitoire	Tout compris	Transitoire	Tout compris	Transitoire	Tout compris	Transitoire
Actions ordinaires et assimilées de T1 : Instruments et réserves										
1 Actions ordinaires et assimilées admissibles directement émises (et leur équivalent dans le cas des institutions qui ne sont pas constituées en société par actions) plus primes liées au capital correspondantes	199,789		199,789		199,789		199,789		199,789	
2 Bénéfices non répartis	907,350		936,769		953,992		981,404		1,011,773	
3 Cumul des autres éléments du résultat étendu (et autres réserves)	(82,473)		-281,928		-276,642		-420,678		-320,948	
4 Fonds propres directement émis qui seront progressivement éliminés de CET1 (applicable uniquement aux institutions qui ne sont pas constituées en société par actions)	N/A		N/A		N/A		N/A		N/A	
5 Actions ordinaires et assimilées émises par des filiales et détenues par des tiers (montant autorisé dans CET1)	N/A		N/A		N/A		N/A		N/A	
6 Actions ordinaires et assimilées de T1 avant ajustements réglementaires	1,024,666		854,630		877,139		760,515		890,614	
Actions ordinaires et assimilées de T1 : Ajustements réglementaires										
28 Total des ajustements réglementaires appliqués aux actions ordinaires et assimilées de T1	0		0		0		0		0	
29 Actions ordinaires et assimilées de T1 (CET1)	1,024,666		854,630		877,139		760,515		890,614	
Autres éléments de T1 : Instruments										
30 Autres éléments de T1 admissibles directement émis plus primes liées au capital correspondantes	N/A		N/A		N/A		N/A		N/A	
31 dont : instruments désignés comme fonds propres selon les normes comptables applicables	N/A		N/A		N/A		N/A		N/A	
32 dont : instruments désignés comme passifs selon les normes comptables applicables	N/A		N/A		N/A		N/A		N/A	
33 Instruments de fonds propres émis directement qui seront progressivement éliminés des autres éléments de T1	N/A		N/A		N/A		N/A		N/A	
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)	N/A		N/A		N/A		N/A		N/A	
35 dont : instruments émis par des filiales et qui seront progressivement éliminés	N/A		N/A		N/A		N/A		N/A	
36 Autres éléments de T1 avant ajustements réglementaires	N/A		N/A		N/A		N/A		N/A	
Autres éléments de T1 : Ajustements réglementaires										
43 Total des ajustements réglementaires appliqués aux autres éléments de T1	N/A		N/A		N/A		N/A		N/A	
44 Autres éléments de T1 (AT1)	N/A		N/A		N/A		N/A		N/A	
45 Fonds propres T1 (T1 = CET1 + AT1)	1,024,666		854,630		877,139		760,515		890,614	
Fonds propres complémentaires (T2) : Instruments et provisions										
46 Instruments de T2 admissibles directement émis, plus primes liées au capital	N/A		N/A		N/A		N/A		N/A	
47 Instruments de fonds propres émis directement qui seront progressivement éliminés de T2	N/A		N/A		N/A		N/A		N/A	
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)	N/A		N/A		N/A		N/A		N/A	
49 dont : instruments émis par des filiales et qui seront progressivement éliminés	N/A		N/A		N/A		N/A		N/A	
50 Provisions collectives	N/A		N/A		N/A		N/A		N/A	
51 T2 avant ajustements réglementaires	N/A		N/A		N/A		N/A		N/A	
Fonds propres complémentaires (T2) : Ajustements réglementaires										
57 Total des ajustements réglementaires appliqués aux instruments de T2	N/A		N/A		N/A		N/A		N/A	
58 Fonds propres complémentaires (T2)	N/A		N/A		N/A		N/A		N/A	
59 Total des fonds propres (TC = T1 + T2)	1,024,666		854,630		877,139		760,515		890,614	
60 Total - Actifs pondérés des risques	3,732,210		3,114,451		3,388,971		3,112,863		3,319,532	
Ratios de fonds propres										
61 Actions ordinaires et assimilées de T1 (en pourcentage des actifs pondérés des risques)	27.45		27.44		25.88		24.43		26.83	
62 T1 (en pourcentage des actifs pondérés des risques)	27.45		27.44		25.88		24.43		26.83	
63 Total des fonds propres (en pourcentage des actifs pondérés des risques)	27.45		27.44		25.88		24.43		26.83	
Cible tout compris du BSIF										
69 Ratio cible tout compris d'actions ordinaires et assimilées de T1	7.00		7.00		7.00		7.00		7.00	
70 Ratio cible tout compris de fonds propres T1	8.50		8.50		8.50		8.50		8.50	
71 Ratio cible tout compris du total des fonds propres	10.50		10.50		10.50		10.50		10.50	
Instruments de fonds propres qui seront éliminés progressivement (dispositions applicables uniquement entre le 1er janvier 2013 et le 1er janvier 2022)										
80 Plafond en vigueur sur les instruments de CET1 qui seront progressivement éliminés	N/A		N/A		N/A		N/A		N/A	
81 Montants exclus de CET1 en raison d'un plafond (excédent par rapport au plafond après rachats et remboursements à l'échéance)	N/A		N/A		N/A		N/A		N/A	
82 Plafond en vigueur sur les instruments d'AT1 destinés à être éliminés	N/A		N/A		N/A		N/A		N/A	
83 Montants exclus d'AT1 en raison d'un plafond (excédent par rapport au plafond après rachats et remboursements à l'échéance)	N/A		N/A		N/A		N/A		N/A	
84 Plafond en vigueur sur les instruments de T2 qui seront progressivement éliminés	N/A		N/A		N/A		N/A		N/A	
85 Montants exclus de T2 en raison d'un plafond (excédent par rapport au plafond après rachats et remboursements à l'échéance)	N/A		N/A		N/A		N/A		N/A	

Réserve de capitaux contracyclique	Pourcentage d'exposition au risque		Taux de réserves		Pourcentage d'exposition au risque		Taux de réserves		Pourcentage d'exposition au risque		Taux de réserves		Exposures	
	au risque	Taux de réserves	d'exposition au risque	Taux de réserves	au risque	Taux de réserves	d'exposition au risque	Taux de réserves	au risque	Taux de réserves	Exposures	Percentage	Taux de réserves	Taux de réserves
Canada	6%	0.00%	1%	0.00%	0%	0.00%	0%	0.00%	0%	0.00%	0%	0.00%	0%	0.00%
Allemagne	0%	0.00%	0%	0.00%	0%	0.00%	0%	0.00%	0%	0.00%	0%	0.00%	0%	0.00%
Japon	16%	0.00%	13%	0.00%	12%	0.00%	15%	0.00%	11%	0.00%	11%	0.00%	11%	0.00%
États Unis	77%	0.00%	79%	0.00%	80%	0.00%	85%	0.00%	89%	0.00%	89%	0.00%	89%	0.00%
La France	0%	0.00%	7%	0.00%	8%	0.00%	0%	0.00%	0%	0.00%	0%	0.00%	0%	0.00%
Réserve contracyclique totale	100%	0.00%	100%	0.00%	100%	0.00%	100%	0.00%	100%	0.00%	100%	0.00%	100%	0.00%