



Tout règles de validation applicables au relevé H4

Pour de plus amples renseignements, veuillez écrire à James Younker (jyounker@banqueducanada.ca).

Principales règles de validation au sein d'un même relevé

Actifs grevés et non grevés

Actifs grevés =
Trésorerie (liquidités grevées)
+ Marge de liquidité fournie
+ Entrée de sûretés (non réhypothécables)
+ Sortie de sûretés
+ Ajustements

$$a106 = (-1)*a4 + (-1)*a15 + (-1)*(a41+a44+a52+a56+a65) + a38 + a102$$

Règles relatives aux mouvements des sûretés à des fins de rapprochement avec la partie B

Partie A : Sortie de sûretés applicables aux dérivés de gré à gré =
Partie B : Programme des OHC – *Sellers Swap* -> Sûretés engagées
+ Total des dérivés de gré à gré -> Sûretés engagées (IF seulement)

$$a57 + (-1)*a16 = b22+b99+b107+b115+b123+b131+b139+b147+b155$$

Partie A : Sûretés engagées auprès d'une IMF/CC =
Partie B : STPGV -> Sûretés engagées
+ Total des IMF -> Toutes les transactions-> Sûretés engagées (IMF seulement)

$$\begin{aligned} a62 + (-1)*a17 &= b1+b64+b69+b74+b77+b82+b85+b88+b89+b92 \\ a125 + (-1)*a121 &= b158+b160+b165+b167+b172+b177+b179+b184+b186 \\ a126 &= b161+b168+b173+b180+b187 \\ a127+a128 + (-1)*a122 + (-1)*a123 &= b162+b163+b169+b170+b174+b175+b181+b182+b188+b189 \\ a129 + (-1)*a124 &= b1+b159+b164+b166+b171+b176+b178+b183+b185+b190 \end{aligned}$$

Partie A : Sortie de sûretés applicables aux swaps =
Partie B : Total des swaps de sûretés -> Sûretés engagées (y compris banques centrales et IF)

$$a53 = b12+b25+b33+b42+b54+b97+b105+b113+b121+b129+b137+b145+b153$$

Partie A : Sûretés applicables aux cessions en pension (montant brut) =
Partie B : Total des cessions en pension -> Sûretés engagées (y compris banques centrales et IF)
+ SCHL/FCH Opérations de pension au bilan
[Remarque : Les sûretés applicables aux cessions en pension engagées auprès d'une CC sont prises en compte dans les sûretés engagées auprès d'une IMF/CC.]

$$a47 = b6+b8+b23+b29+b31+b38+b50+b93+b101+b109+b117+b125+b133+b141+b149$$



Partie A : Sûretés applicables au prêt de titres (montant brut) =

Partie B : Total des opérations de prêt de titres -> Sûretés engagées (y compris banques centrales et IF)

$$a49 = b40+b52+b95+b103+b111+b119+b127+b135+b143+b151$$

Partie A : Sortie d'autres sûretés =

Partie B : Total Autres -> Sûretés engagées (y compris banques centrales et IF)

$$a71+a69+a70 + (-1)*a4 + (-1)*a18 = b4+b14+b19+b20+b21+b27 + b35+b36+b44+b45+ b56+b57+b100+b108+b116+ b124+b132+b140 +b148+b156$$

Partie A : Entrée de sûretés applicables aux swaps =

Partie B : Total des sûretés applicables aux swaps -> Sûretés reçues (y compris banques centrales et IF)

$$a51+a52 = b13+b26+b34+b43+b55+b98+b106+b114+b122+b130+b138+b146+b154$$

Règles relatives à la section sur le bilan à des fins de rapprochement avec la partie B

Partie A : Total des cessions en pension au bilan (montant brut) =

Partie B : Total des cessions en pension -> Liquidités reçues (y compris IMF, banques centrales et IF)

$$a21 = b7+b9+b24+b30+b32+b39+b51+b62+b67+b72+b75+b80+b83+b86+b90+b94+b102+b110+b118 +b126+b134+b142+b150$$

$$a22 = b62+b67+b72+b75+b80+b83+b86+b90$$

$$a23 = b7+b9+ b24+b30+b32+b39+b51+ b94+b102+b110+b118 +b126+b134+b142+b150$$

Partie A : Prêt de titres au bilan (montant brut) (total) =

Partie B : Total des prêts de titres -> Liquidités reçues (y compris IMF, banques centrales et IF)

$$a25 = b41+b53+b63+b68+b73+b76+b81+b84+b87+b91+b96+b104+b112+b120+b128+b136+ b144+b152$$

$$a26 = b63+b68+b73+b76+b81+b84+b87+b91$$

$$a27 = b41+b53+ b96+b104+b112+b120+b128+b136+b144+b152$$

Principales règles de validation entre relevés

Règles de validation à des fins de rapprochement avec le relevé M4 (Bilan) (précision à ± seuil de 2 %)

Partie A : Valeurs mobilières en position longue (ajustements : y compris filiales non déclarées) = Valeurs mobilières (relevé M4)

Cell (a5, c52) = M4 0865 + M4 0866 + M4 0518 + M4 0520 [déclaration obligatoire à la fin du mois, mais les valeurs saisies sont reportées au jour ouvrable suivant]

Cell (a5, c52) = Cell (a5, c53) [précision à ± seuil de 2 % en dernier jour du mois]



Partie A : Prêts garantis (ajustements : position nette, y compris filiales non déclarées) = Prises en pension (relevé M4)

Cell (a6, c52) = M4 0666 [déclaration obligatoire à la fin du mois, mais les valeurs saisies sont reportées au jour ouvrable suivant]

Cell (a6, c52) = Cell (a6, c53) [précision à \pm seuil de 2 % en dernier jour du mois]

Partie A : Prêts (ajustements : y compris filiales non déclarées) = Prêts, déduction faite des prises en pension (relevé M4)

Cell (a10, c52) = M4 2310 + M4 2057 + M4 0524 + M4 0526 + M4 2067 + M4 0534 + M4 0572 + M4 0540 + M4 0542 + M4 0608 + M4 2117 [déclaration obligatoire à la fin du mois, mais les valeurs saisies sont reportées au jour ouvrable suivant]

Cell (a10, c52) = Cell (a10, c53) [précision à \pm seuil de 2 % en dernier jour du mois]

Partie A : Financement garanti (ajustements : position nette, y compris filiales non déclarées) = Accords de rachat (relevé M4)

Cell (a20, c52) = M4 0634 [déclaration obligatoire à la fin du mois, mais les valeurs saisies sont reportées au jour ouvrable suivant]

Cell (a20, c52) = Cell (a20, c53) [précision à \pm seuil de 2 % en dernier jour du mois]

Partie A : Valeurs mobilières en position courte (ajustements : filiales et autres non déclarés) = Engagements afférents aux valeurs mobilières empruntées

Cell (a28, c52) = M4 0632 [déclaration obligatoire à la fin du mois, mais les valeurs saisies sont reportées au jour ouvrable suivant]

Cell (a28, c52) = Cell (a28, c53) [précision à \pm seuil de 2 % en dernier jour du mois]

Règles de validation à des fins de rapprochement avec le relevé du ratio de liquidité à court terme (LCR) (précision à \pm seuil de 2 %)

Partie A : Actifs non grevés disponibles de niveau 1 = Valeur marchande des actifs de niveau 1 (relevé LCR)

Cell (a73, c17) = LCR 11001 + LCR 11002 + LCR 11003 + LCR 11004 + LCR 11005 + LCR 11006 + LCR 11007 + LCR 11008 + LCR 11009 + LCR 11010 [déclaration obligatoire à la fin du mois, mais les valeurs saisies sont reportées au jour ouvrable suivant]

Cell (a73, c17) = Cell (a72, c17) [précision à \pm seuil de 2 % en dernier jour du mois]

Partie A : Actifs non grevés disponibles de niveau 2A = Valeur marchande des actifs de niveau 2A (relevé LCR)

Cell (a73, c25) = LCR 99004 [déclaration obligatoire à la fin du mois, mais les valeurs saisies sont reportées au jour ouvrable suivant]

Cell (a73, c25) = Cell (a72, c25) [précision à \pm seuil de 2 % en dernier jour du mois]

Partie A : Actifs non grevés disponibles de niveau 2B = Valeur marchande des actifs de niveau 2B (relevé LCR)



Cell (a73, c30) = LCR 99009 + LCR 99012 [déclaration obligatoire à la fin du mois, mais les valeurs saisies sont reportées au jour ouvrable suivant]

Cell (a73, c30) = Cell (a72, c30) [précision à \pm seuil de 2 % en dernier jour du mois]

Autre règles

$$a2=a3+a4$$

$$a6=a7+a8$$

$$a10=a11+a12+a13+a14$$

$$a15=a16+a17+a18$$

$$a16=a119+a120$$

$$a17=a121+a122+a123+a124$$

$$a20=a21+a25$$

$$a21=a22+a23$$

$$a25=a26+a27$$

$$a29=a30+a31+a32$$

$$a33=a34+a35+a36$$

$$a37=a39+a51+a52+a55+a56+a61+a63$$

$$a38=a46+a53+a57+a62+a66$$

$$a39=a40+a41+a42+a44$$

$$a46=a47+a49$$

$$a50=a51+a52+a53$$

$$a54=a55+a56+a57$$

$$a57=a58+a59$$

$$a60=a61+a62$$

$$a62=a125+a126+a127+a128+a129$$

$$a63=a64+a65$$

$$a66=a67+a68+a69+a70+a71$$

$$a72=a74+a93$$

$$a74=a75+a76+a77+a78+a79+a80+a81+a82+a83+a84+a85+a86+a87+a88+a89+a90+a91+a92$$
 [exception: ne s'appliquent pas à cells (a74, c17), (a74, c31)]

$$a75=a3$$

$$a76=a5$$

$$a77=a10$$

$$a78=a40+a42$$

$$a79=a46$$

$$a80=(-1)*a28$$

$$a81=a51$$

$$a82=a53$$

$$a83=a55$$

$$a84=a57$$

$$a85=a61$$

$$a86=a62$$
 [exception: ne s'appliquent pas à cell (a86, c46)]

$$a87=a64$$
 [exception: ne s'appliquent pas à cell (a87, c46)]

$$a88=a67$$
 [exception: ne s'appliquent pas à cell (a88, c46)]

$$a89=a68$$

$$a90=a70$$

$$a91=a71$$
 [exception: ne s'appliquent pas à cell (a91, c46)]

$$a92=a102$$
 [exception: ne s'appliquent pas à cell (a92, c46)]

$$a93=a94+a95+a96+a97+a98+a99+a100+a101$$

$$a94=a10$$



a95=a67 [exception: ne s'appliquent pas à cell (a95, c46)]
a96=a68
a97=a69
a98=a62 [exception: ne s'appliquent pas à cell (a98, c46)]
a99=a64 [exception: ne s'appliquent pas à cell (a99, c46)]
a100=a71 [exception: ne s'appliquent pas à cell (a100, c46)]
a101=a102 [exception: ne s'appliquent pas à cell (a101, c46)]
a102=a103+a104+a105

b16=b1+b4+b6+b8+b10+b12+b14
b28=b20+b21+b22+b23+b25+b27
b47=b36+b38+b40+b42+b44+b45
b59=b50+b52+b54+b56+b57
b64=b158+b159
b69=b160+b161+b162+b163+b164
b74=b165+b166
b77=b167+b168+b169+b170+b171
b82=b172+b173+b174+b175+b176
b85=b177+b178
b88=b179+b180+b181+b182+b183
b89=b184+b185
b92=b186+b187+b188+b189+b190
b157=b16+b19+b28+b29+b31+b33+b35+b47+b59+b64+b69+b74+b77+b82+b85+b88+b89+b92+b93+b95+
b97+b99+b100+b101+b103+b105+b107+b108+b109+b111+b113+b115+b116+b117+b119+b121+b123+b124
+b125+b127+b129+b131+b132+b133+b135+b137+b139+b140+b141+b143+b145+b147+b148+b149+b151+ b153+b155+b156

c5=c6+c9+c11
c17=c2+c3+c4+c5+c16
c18=c19+c20
c25=c18+c22+c23+c24
c30=c26+c27+c28+c29
c31=c17+c25+c30
c32=c33+c34+c35+c36+c39+c40
c46=c32+c41+c42+c43+c44+c45
c47=c1+c31+c46 [Exception: cette règle doit être remplacée par c47=c1+c2+c3+c4 pour (a75, c47), (b5, c47), (b7, c47), (b9, c47), (b15, c47), (b24, c47), (b30, c47), (b32, c47), (b37, c47), (b39, c47), (b41, c47), (b44, c47), (b46, c47), (b51, c47), (b53, c47), (b56, c47), (b58, c47), (b62, c47), (b63, c47), (b67, c47), (b68, c47), (b72, c47), (b73, c47), (b75, c47), (b76, c47), (b80, c47), (b81, c47), (b83, c47), (b84, c47), (b86, c47), (b87, c47), (b90, c47), (b91, c47), (b94, c47), (b96, c47), (b102, c47), (b104, c47), (b110, c47), (b112, c47), (b118, c47), (b120, c47), (b126, c47), (b128, c47), (b134, c47), (b136, c47), (b142, c47), (b144, c47), (b150, c47), (b152, c47)]
c53=c47+c48+c49+c50+c51

a1 >=0
a2 >=0
a3 >=0
a4 >=0
a5 >=0
a6 >=0
a7 >=0
a8 >=0
a9 >=0
a10 >=0
a11 >=0
a12 >=0



a13 >=0
a14 >=0
a15 >=0
a16 >=0
a119 >=0
a120 >=0
a17 >=0
a121 >=0
a122 >=0
a123 >=0
a124 >=0
a18 >=0
a19 >=0
a20 >=0
a21 >=0
a22 >=0
a23 >=0
a24 >=0
a25 >=0
a26 >=0
a27 >=0
a28 >=0
a29 >=0
a30 >=0
a31 >=0
a32 >=0
a33 >=0
a34 >=0
a35 >=0
a36 >=0
a37 >=0
a39 >=0
a40 >=0
a41 >=0
a42 >=0
a43 >=0
a44 >=0
a45 >=0
a51 >=0
a52 >=0
a55 >=0
a56 >=0
a61 >=0
a63 >=0
a64 >=0
a65 >=0

a38 <=0
a46 <=0
a47 <=0
a48 <=0
a49 <=0
a53 <=0



a57 <=0
a58 <=0
a59 <=0
a62 <=0
a125 <=0
a126 <=0
a127 <=0
a128 <=0
a129 <=0
a66 <=0
a67 <=0
a68 <=0
a69 <=0
a70 <=0
a71 <=0

Cell (b20, c10) = Cell (b20, c54)
Cell (a10, c10) = Cell (a10, c54)
Cell (a11, c10) = Cell (a11, c54)
Cell (a12, c10) = Cell (a12, c54)
Cell (a13, c10) = Cell (a13, c54)
Cell (a14, c10) = Cell (a14, c54)
Cell (b20, c9) = Cell (b20, c10)
Cell (b49, c47) = (Cell (b48, c47) / Cell (b47, c47))*100
Cell (b61, c47) = (Cell (b60, c47) / Cell (b59, c47))*100
Cell (b66, c47) = (Cell (b65, c47) / Cell (b64, c47))*100
Cell (b71, c47) = (Cell (b70, c47) / Cell (b69, c47))*100
Cell (b79, c47) = (Cell (b78, c47) / Cell (b77, c47))*100