



**AUTORITÉ
DES MARCHÉS
FINANCIERS**

GUIDE

Ratio structurel de liquidité à long terme (NSFR)

Avril 2024

1. Ratio structurel de liquidité à long terme

Objet

Ce relevé rend compte du ratio structurel de liquidité à long terme (NSFR) de l'institution déclarante, ainsi que de la méthode de calcul utilisée.

Institutions visées

Ce relevé s'applique aux institutions financières d'importance systémique intérieure (IFIS-i) et aux petites et moyennes institutions de dépôts (PMID) de catégorie I.

Fréquence

Trimestrielle

Échéance

Ce relevé doit être produit dans les 30 jours suivant la fin du trimestre.

Instructions générales

Le relevé NSFR doit être établi selon les méthodologies et les calculs décrits au chapitre 6 de la *Ligne directrice sur les normes relatives à la suffisance des liquidités* (la « Ligne directrice ») de l'Autorité des marchés financiers (l'« Autorité »). Des instructions spécifiques pour chacun des items requis dans le formulaire se retrouvent dans la feuille « Instructions » du formulaire NSFR. Pour faciliter la production du relevé NSFR, les instructions renvoient aux paragraphes pertinents de la Ligne directrice (p. ex., par. 43 (d)).

Le relevé NSFR doit être produit sur une base consolidée (les montants en devises doivent être convertis en dollars canadiens).

Tous les montants doivent être déclarés en milliers de dollars canadiens.

Langue

Dans la feuille « Page titre » du formulaire Excel, sélectionner « Fr » pour obtenir la version française du formulaire.