



AVIS AUX MEMBRES

N° 2017 – 017

Le 31 janvier 2017

MISE À JOUR DES TAUX DE DÉCOTE SUR LES OBLIGATIONS GOUVERNEMENTALES DÉPOSÉES EN GARANTIE

La CDCC effectue une révision semestrielle de ses taux de décote applicables sur les obligations gouvernementales éligibles au dépôt en garantie.

Suite à cette révision, la CDCC a décidé de mettre à jour les taux de décote en vigueur.

Pour toute information complémentaire, veuillez communiquer avec le département de Gestion des risques au (514) 871-3505.

Glenn Goucher
Président et chef de la compensation

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés

The Exchange Tower
130, rue King ouest, 5^e étage
Toronto (Ontario)
M5X 1J2
Tél. : 416-367-2470

Tour de la Bourse
800, square Victoria, 3^e étage
Montréal (Québec)
H4Z 1A9
Tél. : 514-871-3545

www.cdcc.ca

Taux de décote

Forme de Garantie	Titres admissibles	Valeur considérée	CAD	CAD Indexées sur l'inflation	U.S.	U.S. Indexées sur l'inflation
Titres gouvernementaux	Bons du Trésor et obligations du Canada (y compris les obligations à rendement réel, mais non les bons d'épargne du Canada), bons du Trésor et obligations des États-Unis (y compris les obligations d'État indexées sur l'inflation) et certaines obligations provinciales dont l'échéance est de : 1					
	1 an ou moins	Marchande	1.00%	2.50%	3.50%	3.50%
	1 à 3 ans	Marchande	2.00%	2.50%	4.00%	4.00%
	3 à 5 ans	Marchande	2.50%	2.50%	4.50%	5.00%
	5 à 10 ans	Marchande	3.00%	3.50%	6.50%	6.50%
	10 à 20 ans	Marchande	3.50%	4.00%	9.50%	10.50%
	20 ans et plus	Marchande	5.50%	5.50%	9.50%	10.50%

Forme de Garantie	Titres admissibles	Valeur considérée	Province de l'Ontario	Province du Québec	Province de la Colombie-Britannique	Province de l'Alberta
Titres gouvernementaux	Bons du Trésor et obligations du Canada (y compris les obligations à rendement réel, mais non les bons d'épargne du Canada), bons du Trésor et obligations des États-Unis (y compris les obligations d'État indexées sur l'inflation) et certaines obligations provinciales dont l'échéance est de : 1					
	1 an ou moins	Marchande	3.50%	2.50%	3.00%	2.50%
	1 à 3 ans	Marchande	3.50%	2.50%	3.00%	2.50%
	3 à 5 ans	Marchande	3.50%	2.50%	3.00%	2.50%
	5 à 10 ans	Marchande	5.00%	5.50%	4.00%	4.00%
	10 à 20 ans	Marchande	7.00%	6.00%	4.50%	5.50%
	20 ans et plus	Marchande	10.50%	6.50%	7.50%	6.50%

Forme de Garantie	Titres admissibles	Valeur considérée	Province du Manitoba
Titres gouvernementaux	Bons du Trésor et obligations du Canada (y compris les obligations à rendement réel, mais non les bons d'épargne du Canada), bons du Trésor et obligations des États-Unis (y compris les obligations d'État indexées sur l'inflation) et certaines obligations provinciales dont l'échéance est de : 1		
	1 an ou moins	Marchande	2.50%
	1 à 3 ans	Marchande	2.50%
	3 à 5 ans	Marchande	2.50%
	5 à 10 ans	Marchande	3.50%
	10 à 20 ans	Marchande	5.50%
	20 ans et plus	Marchande	10.50%

Glenn Goucher
Président et chef de la compensation