

AVIS AUX MEMBRES

No. 2024 – 029

Le 27 mars 2024

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

La CDCC effectue une révision trimestrielle 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. Les nouveaux taux de décote seront effectifs le 28 Mars 2024. La CDCC s'est réservée le droit d'établir les taux de décote à 100% des taux de décotes de la Banque du Canada pour tous les ISINs.

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

Anne Linardakis
Directrice, Activités commerciales
CDCC

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					
	3 mois ou moins	Marchande	0.25%	0.25%	5.00%	5.00%
	3 mois à 1 an	Marchande	0.50%	0.50%	5.25%	5.25%
	1 à 3 ans	Marchande	1.00%	1.00%	5.75%	5.75%
	3 à 5 ans	Marchande	1.50%	1.50%	6.25%	6.25%
	5 à 10 ans	Marchande	2.00%	2.00%	7.50%	7.50%
	10 à 20 ans	Marchande	3.50%	3.50%	10.00%	10.00%
	20 à 35 ans	Marchande	6.00%	6.00%	13.00%	13.00%
	35 ans et plus	Marchande	6.50%	6.50%		

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					
	3 mois ou moins	Marchande	1.50%	1.50%	1.50%	1.50%
	3 mois à 1 an	Marchande	1.75%	1.75%	1.75%	1.75%
	1 à 3 ans	Marchande	2.50%	2.50%	2.50%	2.50%
	3 à 5 ans	Marchande	3.00%	3.00%	3.00%	3.00%
	5 à 10 ans	Marchande	3.50%	3.50%	3.50%	3.50%
	10 à 20 ans	Marchande	5.00%	5.00%	5.00%	5.00%
	20 à 35 ans	Marchande	8.50%	8.50%	8.50%	8.50%
	35 ans et plus	Marchande	9.00%	9.00%	9.00%	9.00%

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		
	3 mois ou moins	Marchande	1.50%
	3 mois à 1 an	Marchande	1.75%
	1 à 3 ans	Marchande	2.50%
	3 à 5 ans	Marchande	3.00%
	5 à 10 ans	Marchande	3.50%
	10 à 20 ans	Marchande	5.00%
	20 à 35 ans	Marchande	8.50%
	35 ans et plus	Marchande	9.00%

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés

EY Tower	1700-1190 av des Canadiens-de-Montréal
300-100 rue Adelaide Ouest	C.P. 37
Toronto, Ontario	Montréal, Québec
M5H 1S3	H3B 0G7
Tél. : 416-367-2470	Tél. : 514-871-3545
www.cdcc.ca	