



AVIS AUX MEMBRES

N° 2018 - 030

Le 6 avril 2018

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.

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

100, rue Adelaide ouest

3^e étage,

Toronto (Ontario)

M5H 1S3

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% | 3.00% | 2.50% |
| | 1 à 3 ans | Marchande | 1.50% | 2.50% | 3.50% | 3.50% |
| | 3 à 5 ans | Marchande | 2.00% | 2.50% | 4.50% | 4.50% |
| | 5 à 10 ans | Marchande | 2.50% | 3.00% | 6.50% | 6.50% |
| | 10 à 20 ans | Marchande | 3.50% | 3.50% | 9.00% | 10.00% |
| | 20 ans et plus | Marchande | 4.50% | 5.00% | 9.00% | 10.00% |

| 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 | 3.00% | 2.50% | 3.00% | 3.00% |
| | 1 à 3 ans | Marchande | 3.00% | 2.50% | 3.00% | 3.00% |
| | 3 à 5 ans | Marchande | 3.00% | 2.50% | 3.00% | 3.00% |
| | 5 à 10 ans | Marchande | 4.00% | 5.00% | 3.50% | 4.00% |
| | 10 à 20 ans | Marchande | 6.00% | 5.50% | 4.00% | 4.50% |
| | 20 ans et plus | Marchande | 8.50% | 6.00% | 6.00% | 6.00% |

| 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 | | |
| | 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 | 3.00% |
| | 10 à 20 ans | Marchande | 4.50% |
| | 20 ans et plus | Marchande | 8.50% |

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés

100, rue Adelaide ouest
3^e étage,
Toronto (Ontario)
M5H 1S3
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