

AVIS AUX MEMBRES

No. 2023 – 112

Le 28 septembre 2023

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 29 Septembre 2023. 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

100, rue Adelaïde ouest 1700-1190 avenue des Canadiens-de-Montréal
 3^e étage C.P. 37
 Toronto ON M5H 1S3 Montréal QC H3B 0G7
 416-367-2470 514-871-3545
www.cdcc.ca