

RÈGLEMENT MODIFIANT LE RÈGLEMENT 94-101 SUR LA COMPENSATION OBLIGATOIRE DES DÉRIVÉS PAR CONTREPARTIE CENTRALE

Loi sur les instruments dérivés
(chapitre I-14.01, a. 175, 1^{er} al., par. 11°)

1. L'annexe A du Règlement 94-101 sur la compensation obligatoire des dérivés par contrepartie centrale (chapitre I-14.01, r. 0.01) est remplacée par la suivante :

**« ANNEXE A
DÉRIVÉS OBLIGATOIREMENT COMPENSABLES
(paragraphe 1 de l'article 1)**

Swaps de taux d'intérêt

Swaps fixes-variables					
Taux variable de référence	Monnaie de règlement	Échéance	Type de monnaie de règlement	Optionalité	Type de notionnel
EURIBOR	EUR	28 jours à 50 ans	Mono-monnaie	Non	Constant ou variable
BBSW	AUD	28 jours à 30 ans	Mono-monnaie	Non	Constant ou variable

Swaps variables-variables					
Taux variable de référence	Monnaie de règlement	Échéance	Type de monnaie de règlement	Optionalité	Type de notionnel
EURIBOR	EUR	28 jours à 50 ans	Mono-monnaie	Non	Constant ou variable

Swaps indexés sur le taux à un jour					
Taux variable de référence	Monnaie de règlement	Échéance	Type de monnaie de règlement	Optionalité	Type de notionnel
CORRA	CAD	7 jours à 30 ans	Mono-monnaie	Non	Constant
FedFunds	USD	7 jours à 3 ans	Mono-monnaie	Non	Constant
SOFR	USD	7 jours à 50 ans	Mono-monnaie	Non	Constant
€STR	EUR	7 jours à 3 ans	Mono-monnaie	Non	Constant
SONIA	GBP	7 jours à 50 ans	Mono-monnaie	Non	Constant

Contrats de garantie de taux

Taux variable de référence	Monnaie de règlement	Échéance	Type de monnaie de règlement	Optionalité	Type de notionnel
EURIBOR	EUR	3 jours à 3 ans	Mono-monnaie	Non	Constant

Swaps sur défaillance

Indice	Région	Échéance	Séries visées	Tranches
CDX.NA.IG	Amérique du Nord	5 et 10 ans	Série 46 et subséquentes	Non
CDX.NA.HY	Amérique du Nord	5 ans	Série 46 et subséquentes	Non
iTraxx Europe	Europe	5 ans	Série 45 et subséquentes	Non

».

2. Ce règlement est modifié par le remplacement, partout où ceci se trouve dans les articles 1, 3 et 7, de « opération » par « transaction » et de « opérations » par « transactions », compte tenu des adaptations grammaticales nécessaires.

3. Le présent règlement entre en vigueur le (*indiquer ici la date d'entrée en vigueur du présent règlement*).