

## Modèle de l'ANNEXE A des DIRECTIVES À LA CDS RELATIVEMENT AU TAUX DE RECHANGE POUR LES TITRES FONDÉS SUR LE TAUX CDOR

Veillez remplir, selon le cas, le modèle qui suit en y inscrivant les renseignements pertinents portant sur vos clauses de repli pour le remplacement du taux CDOR. Seuls les renseignements applicables devraient être indiqués dans l'annexe A de l'appendice A. Veillez remplir une annexe A distincte pour chaque titre touché.

Élément de données	Définition du champ	Quelles données sont nécessaires?	Explication
<b>Renseignements propres à l'entreprise</b>			
<b>Nom de l'entreprise</b>	Le nom de l'émetteur des titres visés par présent bulletin de la CDS.	Inscrire le nom de l'entreprise	
<b>Adresse de courriel du requérant</b>	L'adresse de courriel de la personne-ressource de l'entreprise qui demande le bulletin de la CDS, de préférence une adresse de courriel de groupe du service pertinent au sein de l'entreprise.	Inscrire une adresse de courriel de groupe	Il pourrait être nécessaire de communiquer avec l'émetteur afin de préciser certains points si des renseignements supplémentaires sont requis.
<b>Renseignements propres au titre applicable</b>			
<b>Numéro(s) ISIN applicable(s)</b>	Le numéro international d'identification des valeurs mobilières (ISIN) pour le titre visé par le présent bulletin de la CDS.	ID de sécurité alphanumérique à douze chiffres	
<b>Application des clauses de repli recommandées par le Groupe de travail sur le TARCOM</b>	Est-ce que les clauses de repli applicables sont fondées sur les clauses de repli <a href="#">recommandées</a> par le Groupe de travail sur le TARCOM? Le taux de rechange recommandé par le Groupe de travail sur le TARCOM est le	Oui ou non	Tiré des clauses de repli recommandées par le Groupe de travail sur le TARCOM : « taux de rechange (CORRA) ( <i>Fallback Rate</i> (CORRA)) » Taux CORRA ajusté (composé à terme échu) majoré de l'écart par rapport au taux

	taux de rechange (taux CORRA).		CDOR dans chaque cas, pour [la période de calcul des intérêts pertinente] fourni par Bloomberg Index Services Limited (ou un successeur à titre de fournisseur approuvé ou nommé par l'ISDA), en tant que de fournisseur du taux CORRA ajusté (composé à terme échu) et de l'écart correspondant, ceux-ci étant publiés sur l'écran du taux de rechange (CORRA) (ou par d'autres moyens) ou fournis à des distributeurs autorisés, et publiés par ceux-ci;
--	--------------------------------	--	--

**Si les clauses de repli sont fondées sur les clauses de repli pour les obligations à taux variable recommandées par le Groupe de travail sur le TARCOT, veuillez remplir la section suivante**

<b>Source du taux de rechange</b>	Est-ce que le taux de rechange au taux CDOR utilisé à l'égard du titre dont l'ISIN est indiqué correspond au taux de rechange publié par Bloomberg sur sa page FBAK? Ce taux est celui déterminé et utilisé par l'ISDA pour les produits dérivés.	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Oui ou non. Si non, veuillez décrire la façon dont le taux de rechange est obtenu ainsi que sa source</li> <li>• Si vous indiquez un symbole de Bloomberg en particulier (p.ex. VCDOR03M pour le taux CDOR à 3 mois), veuillez également inscrire le symbole</li> </ul>	Tiré des clauses de repli recommandées par le Groupe de travail sur le TARCOT : « écran du taux de rechange (CORRA) ( <i>Fallback Rate</i> (CORRA) Screen) » Écran Bloomberg correspondant au symbole Bloomberg pour le taux de rechange au taux CDOR pour [la période de calcul des intérêts pertinente] accessible sur la page de l'écran Bloomberg (ou, s'il y a lieu, consulté au moyen
-----------------------------------	---	--	--

			de l'écran Bloomberg) ou toute autre source publiée désignée par Bloomberg Index Services Limited (ou un successeur à titre de fournisseur approuvé ou nommé par l'ISDA);
<b>Ajustement de l'écart (pdb)</b>	Est-ce que l'ajustement de l'écart de rechange indiqué dans le numéro ISIN indiqué utilise celui publié par Bloomberg pour calculer le taux de rechange de l'ISDA (affiché sur la page FBAK de Bloomberg)?	<ul style="list-style-type: none"> <li>Oui ou non. Si non, veuillez décrire la façon dont l'ajustement de l'écart est obtenu ainsi que sa source, et la façon dont il est utilisé pour effectuer le calcul</li> </ul>	Le taux de rechange que Bloomberg publie pour le taux CDOR sur la page FBAK comprend déjà l'ajustement de l'écart de l'ISDA. Il s'établit à 32,138 pdb pour la durée de 3 mois.
<b>Convention quant au nombre de jours :</b>	Est-ce que la convention quant au nombre de jours rattachée au titre indiqué est modifiée en raison des clauses de repli?	<ul style="list-style-type: none"> <li>Oui ou non. Si oui, veuillez décrire les modifications.</li> </ul>	
<b>Méthode de calcul de l'intérêt</b>	Est-ce que la méthode de calcul de l'intérêt est la même que celle utilisée dans la méthode de rechange de l'ISDA calculée et publiée par Bloomberg?	Oui ou non. Si non, veuillez décrire la façon dont l'intérêt couru est calculé	

**Si les clauses de repli ne sont PAS fondées sur les clauses de repli recommandées par le Groupe de travail sur le TARCOT, veuillez décrire en détails ci-dessous la méthode de rechange, y compris les particularités du recours à la capitalisation, les rétrospectives, les changements aux observations, les retards de paiement, les instructions relatives à l'arrondissement, les conventions quant au nombre de jours et tout autre volet ayant une incidence sur le calcul.**

Cliquez ou appuyez ici pour entrer du texte.