



Transition du LIBOR : Résumé des nouvelles capacités

FÉVRIER 2021

Avec l'introduction de nouveaux produits de taux de référence complémentaires (ARR), tous les systèmes et modèles touchés au sein de Comptabilité de fonds, Comptabilité institutionnelle et Produits dérivés ont été améliorés avec les nouvelles capacités requises pour soutenir les titres cotés et les produits dérivés impactés. Nous avons produit un sommaire des nouvelles capacités de transition du LIBOR qui détaille les domaines spécifiques de changement, y compris les nouveaux calculs, ainsi que la capture et le traitement de nouvelles données de référence de sécurité. Cette initiative permettra une transition harmonieuse du LIBOR aux nouveaux taux de référence complémentaires.

Saisie de données	Capacité d'obtenir et de stocker de nouveaux tarifs et de l'information pertinente à partir de systèmes en amont	<ul style="list-style-type: none"> Fournir des champs supplémentaires pour l'approvisionnement de données Sourcer et saisir les champs des systèmes en amont Afficher l'information saisie dans les interfaces utilisateur Saisir les renseignements sur le taux sur une base T+1
	Capacité de saisir des transactions à l'aide de nouveaux taux	<ul style="list-style-type: none"> Afficher les nouveaux tarifs dans les champs existants, les listes déroulantes et les autres interfaces utilisateur (IU) Fournir des champs supplémentaires pour la saisie des transactions dans les IU et le magasin de données Saisir de nouveaux champs par le biais de plusieurs canaux Mettre à jour les flux de travail pour inclure la validation des nouveaux champs, le cas échéant
Calculs	Capacité de calculer de nouveaux taux de capitalisation	<ul style="list-style-type: none"> Calculer à l'avance un taux moyen ou de capitalisation simple Calculer un taux moyen ou de capitalisation simple en arriérés Calculer les taux en utilisant une période de verrouillage Calculer les tarifs à l'aide d'une période rétroactive
	Capacité d'effectuer des calculs à l'aide de nouvelles capitalisations dans les taux d'avance	<ul style="list-style-type: none"> Utiliser les taux nouvellement calculés dans les autres calculs
	Capacité d'effectuer des calculs à l'aide de nouvelles capitalisations dans les taux d'arriérés	<ul style="list-style-type: none"> Effectuer des calculs lorsque le taux n'est pas connu avant la fin de la période Créer ou modifier les flux de trésorerie prévus à la fin de la période de régularisation ou d'intérêt
	Capacité de valoriser les produits/ fournir des prix/calculer la valeur liquidative en utilisant des taux de référence alternatifs	<ul style="list-style-type: none"> Effectuer des calculs lorsque le taux n'est pas connu avant la fin de la période Créer ou modifier les flux de trésorerie prévus à la fin de la période de régularisation ou d'intérêt
Distribution des données	Capacité de transmettre de nouveaux tarifs et de l'information pertinente en aval	<ul style="list-style-type: none"> Fournir les champs supplémentaires pour les systèmes en aval et/ou les outils de production de rapports
	Capacité de créer des rapports mis à jour	<ul style="list-style-type: none"> Produire des rapports pour les transactions qui peuvent utiliser plusieurs taux au cours d'une seule période d'intérêt Produire des rapports analogues aux rapports existants pour les transactions utilisant des taux de référence alternatifs
Modifications apportées aux dossiers existants	Capacité de soutenir un changement de tarif pour une transaction, une entente ou un contrat existant	<ul style="list-style-type: none"> Permettre à un utilisateur de sélectionner un nouveau tarif pour une transaction existante, y compris tout champ supplémentaire associé au nouveau tarif
	Possibilité de recalculer les cumuls pour un produit dont le taux a changé	<ul style="list-style-type: none"> Traiter les changements de taux pour les transactions existantes et, au besoin, réexécuter les calculs (p. ex., régularisations)

Pour plus d'information

Veillez communiquer avec un membre de l'équipe du développement des affaires de CIBC Mellon ou avec votre directeur ou gestionnaire des relations au 416 643-5000, ou visitez le site www.cibcmellon.com.

CIBC MELLON

➤ UNE COENTREPRISE DE BNY MELLON ET CIBCSM

www.cibcmellon.com

© 2021 CIBC Mellon. CIBC Mellon est un utilisateur autorisé de la marque de commerce CIBC et de certaines marques de commerce de BNY Mellon. CIBC Mellon est la marque d'entreprise de la Compagnie Trust CIBC Mellon et de la société de services de titres mondiaux CIBC Mellon, et peut être utilisée comme terme générique pour désigner l'une de ces sociétés ou ces deux sociétés.

 **BNY MELLON**

www.bnymellon.com

©2021 The Bank of New York Mellon Corporation. Tous droits réservés.

BNY Mellon est la marque d'entreprise de The Bank of New York Mellon Corporation et peut être utilisée comme terme générique pour faire référence à l'entreprise dans son ensemble ou à ses diverses filiales en général. Les produits et services peuvent être offerts sous diverses marques et dans différents pays par des filiales, des sociétés affiliées et des coentreprises dûment autorisées et réglementées de The Bank of New York Mellon Corporation. Les produits et services ne sont pas tous offerts dans tous les pays.

BNY Mellon ne sera pas responsable de la mise à jour des renseignements contenus dans ce document, et les opinions et renseignements contenus dans le présent document peuvent être modifiés sans préavis.

BNY Mellon n'assume aucune responsabilité (directe ou indirecte) pour toute erreur dans ce document ou toute utilisation de celui-ci. Ce matériel ne peut être reproduit ou diffusé sous quelque forme que ce soit sans l'autorisation écrite expresse de BNY Mellon.



www.cibc.com/fr/personal-banking.html

Le logo CIBC est une marque de commerce de CIBC, utilisée sous licence. Toutes les autres marques de commerce appartiennent à leurs propriétaires respectifs.

000 - T009 - 12 - 20