



## AVIS AUX MEMBRES

N° 2010 - 014

Le 2 mars 2010

### **PARAMÈTRES DE COUVERTURE FINANCIÈRE POUR LES INSTRUMENTS DÉRIVÉS DE LA BOURSE DE MONTRÉAL ET LES INSTRUMENTS DÉRIVÉS DU MARCHÉ HORS COTE**

Conformément à la Règle A-7, la CDCC effectue régulièrement une mise à jour de ses paramètres de couverture financière :

- intervalles de garantie ;
- marge sur opérations appariées (plus communément appelées « Spreads ») pour les contrats à terme ;
- marge sur opérations de type « Butterfly » consécutif et non consécutif pour le contrat BAX;
- réduction de marge sur opérations appariées entre groupes combinés (plus communément appelées « Inter-commodity Spreads ») pour les contrats à terme CGB – CGZ, CGB – LGB, CGF – BAX, CGF – CGZ, CGF – CGB, CGB – BAX et SXF – SCF

Les paramètres mis à jour entreront en vigueur lors du traitement informatique de FIN DE JOURNÉE le 5 mars 2010.

Pour toute information complémentaire, veuillez communiquer avec le Département de Gestion des Risques au (514) 871-4949 poste 505.

Glenn Goucher  
Premier vice-président et chef de la Compensation

---

**Corporation canadienne de compensation de produits dérivés**

The Exchange Tower	800, square Victoria
130, rue King ouest, 5 <sup>ème</sup> étage	3 <sup>ème</sup> étage
Toronto, Ontario	Montréal (Québec)
M5X 1J2	H4Z 1A9
Tél. : 416-367-2463	Tél. : 514-871-3545
Télec. : 416-367-2473	Télec. : 514-871-3530

[www.cdcc.ca](http://www.cdcc.ca)

## Intervalles de garantie

Symbole sous- jacent	Nom	Intervalles de garantie	Intervalles de garantie
		ACTUELS	MIS À JOUR
AAV	Advantage Oil & Gas Ltd.	18,68%	<b>18,52%</b>
ABX	Société aurifère Barrick	12,55%	<b>12,06%</b>
ACM.A	Astral Media Inc. Classe A	7,77%	<b>7,37%</b>
AEM	Mines Agnico-Eagle Limitée	13,64%	<b>14,44%</b>
AER	Groupe Aeroplan Inc.	13,62%	<b>12,66%</b>
AETu	ARC Energy Trust	12,57%	<b>12,24%</b>
AGF.B	La Société de Gestion AGF Limitée Classe B	13,77%	<b>13,53%</b>
AGI	Alamos Gold Inc.	14,58%	<b>18,75%</b>
AGI	Alamos Gold Inc. (Converge)	24,67%	<b>32,06%</b>
AGU	Agrium Inc.	12,74%	<b>12,35%</b>
ANV	Allied Nevada Gold Corp.	15,10%	<b>17,21%</b>
API	Athabasca Potash Inc.	24,23%	<b>20,84%</b>
ARE	Groupe Aecon Inc.	9,46%	<b>9,22%</b>
ARZ	Mines Aurizon Ltée	17,85%	<b>16,97%</b>
ATA	ATS Automation Tooling Systems Inc.	15,67%	<b>15,26%</b>
ATD.B	Alimentation Couche-Tard Inc. Classe B	8,71%	<b>8,21%</b>
BAM.A	Brookfield Asset Management Inc. Classe A	10,56%	<b>10,17%</b>
BAX	Contrats à terme sur acceptations bancaires canadiennes de trois mois	0,07%	<b>0,06%</b>
BBD.B	Bombardier Inc. Classe B	15,89%	<b>14,84%</b>
BCB	Cott Corporation	29,24%	<b>27,64%</b>
BCE	BCE Inc.	5,41%	<b>5,42%</b>
BIN	IESI-BFC Ltd.	9,30%	<b>7,87%</b>
BIR	Birchcliff Energy Ltd.	15,67%	<b>15,37%</b>
BLD	Ballard Power Systems Inc.	32,68%	<b>25,38%</b>
BMO	Banque de Montréal	10,06%	<b>9,53%</b>
BNK	Bankers Petroleum Ltd.	20,92%	<b>19,45%</b>
BNS	La Banque de Nouvelle-Écosse	10,16%	<b>9,59%</b>
BPO	Brookfield Properties Corporation	17,68%	<b>15,47%</b>
BVF	Biovail Corporation	10,19%	<b>9,79%</b>
CAE	CAE Inc.	8,96%	<b>8,86%</b>
CAS	Cascades Inc.	17,57%	<b>17,11%</b>
CCA	Cogeco Câble Inc.	8,07%	<b>7,47%</b>
CCO	Cameco Corporation	11,35%	<b>11,09%</b>
CDM	Cœur d'Alene Mines Corporation	19,77%	<b>19,47%</b>
CFP	Canfor Corporation	15,56%	<b>15,41%</b>
CG	Centerra Gold Inc.	17,04%	<b>15,88%</b>
CGB	Contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada de dix ans	1,75%	<b>1,69%</b>

### Corporation canadienne de compensation de produits dérivés

The Exchange Tower	800, square Victoria
130, rue King ouest, 5ième étage	3ième étage
Toronto, Ontario	Montréal (Québec)
M5X 1J2	H4Z 1A9
Tél. : 416-367-2463	Tél. : 514-871-3545
Télc. : 416-367-2473	Télc. : 514-871-3530



Symbole sous- jacent	Nom	Intervalles de garantie ACTUELS	Intervalles de garantie MIS À JOUR
CGF	Contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada de cinq ans	0,78%	<b>0,76%</b>
CGL	Claymore Gold Bullion ETF	4,81%	<b>5,84%</b>
CGZ	Contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada de deux ans	0,41%	<b>0,35%</b>
CIX	CI Financial Corp.	9,96%	<b>9,77%</b>
CJR.B	Corus Entertainment Inc. Classe B	9,48%	<b>9,23%</b>
CLM	Consolidated Thompson Iron Mines limitée	21,09%	<b>19,41%</b>
CLS	Celestica Inc.	15,13%	<b>14,99%</b>
CLT	Celtic Exploration Ltd.	9,47%	<b>9,37%</b>
CM	Banque Canadienne Impériale de Commerce	10,43%	<b>9,73%</b>
CNQ	Canadian Natural Resources Limited	12,39%	<b>11,68%</b>
CNR	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	8,99%	<b>8,46%</b>
COSu	Canadian Oil Sands Trust Units	14,21%	<b>13,27%</b>
COW	Claymore Global Agriculture	7,03%	<b>6,73%</b>
CP	Chemin de fer Canadien Pacifique Limitée	11,10%	<b>10,53%</b>
CPG	Crescent Point Energy Corp.	8,47%	<b>8,02%</b>
CPX	Capital Power Corporation	4,62%	<b>4,58%</b>
CR	Crew Energy Inc.	18,18%	<b>17,62%</b>
CSHu	Chartwell Seniors Housing Real Estate Investment Trust	11,52%	<b>10,95%</b>
CSI	Colossus Minerals Inc.	24,94%	<b>21,44%</b>
CTC.A	Société Canadian Tire Limitée Classe A	8,48%	<b>8,07%</b>
CTQ	Corriente Resources Inc.	13,85%	<b>13,23%</b>
CU	Canadian Utilities Limited	5,10%	<b>5,24%</b>
CVE	Cenovus Energy Inc.	8,23%	<b>10,63%</b>
CWB	Canadian Western Bank	12,49%	<b>11,77%</b>
CWTu	Calloway Real Estate Investment Trust	8,30%	<b>7,78%</b>
DGC	Detour Gold Corporation	16,61%	<b>16,94%</b>
ECA	EnCana Corporation	10,26%	<b>9,83%</b>
ECQ	EnCana Corporation (ajusté)	10,16%	<b>9,58%</b>
EGU	European Goldfields Limited	18,49%	<b>18,01%</b>
ELD	Eldorado Gold Corporation	15,43%	<b>15,09%</b>
EMA	Emera Inc.	4,88%	<b>5,26%</b>
ENB	Enbridge Inc.	5,42%	<b>5,35%</b>
EQN	Equinox Minerals Limited	20,85%	<b>20,23%</b>
ERFu	Enerplus Resources Fund Units	10,79%	<b>10,44%</b>
ESI	Ensign Energy Services Inc.	12,30%	<b>11,87%</b>
FEL	Fairborne Energy Ltd.	18,60%	<b>18,03%</b>
FM	First Quantum Minerals Ltd.	18,50%	<b>17,62%</b>
FNV	Franco-Nevada Corporation	11,64%	<b>10,58%</b>
FNX	FNX Mining Company Inc.	20,13%	<b>19,50%</b>

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés

The Exchange Tower	800, square Victoria
130, rue King ouest, 5 <sup>ème</sup> étage	3 <sup>ème</sup> étage
Toronto, Ontario	Montréal (Québec)
M5X 1J2	H4Z 1A9
Tél. : 416-367-2463	Tél. : 514-871-3545
Télex : 416-367-2473	Télex : 514-871-3530

www.cdcc.ca



Symbole sous- jacent	Nom	Intervalles de garantie ACTUELS	Intervalles de garantie MIS À JOUR
<b>FRG</b>	Fronteer Development Group Inc.	19,46%	<b>17,20%</b>
<b>FTS</b>	Fortis Inc.	5,54%	<b>5,67%</b>
<b>FTT</b>	Finning International Inc.	11,18%	<b>10,72%</b>
<b>G</b>	Goldcorp Inc.	12,73%	<b>12,44%</b>
<b>G</b>	Goldcorp Inc. (Converge)	20,96%	<b>20,61%</b>
<b>GAM</b>	Gammon Gold Inc.	16,37%	<b>15,97%</b>
<b>GAS</b>	Claymore Natural Gas Commodity ETF	16,32%	<b>16,18%</b>
<b>GIB.A</b>	Groupe CGI Inc. Classe A	8,40%	<b>7,76%</b>
<b>GIL</b>	Les Vêtements de Sport Gildan Inc.	17,51%	<b>15,80%</b>
<b>GNA</b>	Gerdau Ameristeel Corporation	17,18%	<b>16,40%</b>
<b>GO</b>	Galleon Energy Inc.	18,21%	<b>18,19%</b>
<b>GTE</b>	Gran Tierra Energy Inc.	14,81%	<b>14,00%</b>
<b>GW</b>	Corporation de Sécurité Garda World	22,43%	<b>21,98%</b>
<b>GWO</b>	Great-West Lifeco Inc.	13,58%	<b>13,17%</b>
<b>HBM</b>	HudBay Minerals Inc.	18,38%	<b>16,23%</b>
<b>HED</b>	FNB Horizons BetaPro S&P/TSX plafonné énergie Baissier Plus	19,49%	<b>18,59%</b>
<b>HEU</b>	FNB Horizons BetaPro S&P/TSX plafonné énergie Haussier Plus	19,38%	<b>18,54%</b>
<b>HFD</b>	FNB Horizons BetaPro S&P/TSX plafonné finance Baissier Plus	19,20%	<b>17,90%</b>
<b>HFU</b>	FNB Horizons BetaPro S&P/TSX plafonné finance Haussier Plus	19,17%	<b>17,92%</b>
<b>HGD</b>	FNB Horizons BetaPro S&P/TSX aurifère mondial Baissier Plus	22,25%	<b>21,71%</b>
<b>HGU</b>	FNB Horizons BetaPro S&P/TSX aurifère mondial Haussier Plus	22,35%	<b>21,76%</b>
<b>HND</b>	FNB Horizons BetaPro NYMEX Gaz naturel Baissier Plus	32,30%	<b>32,08%</b>
<b>HNU</b>	FNB Horizons BetaPro NYMEX Gaz naturel Haussier Plus	31,97%	<b>31,72%</b>
<b>HOD</b>	FNB Horizons BetaPro NYMEX Pétrole brut Baissier Plus	24,07%	<b>23,02%</b>
<b>HOU</b>	FNB Horizons BetaPro NYMEX Pétrole brut Haussier Plus	24,00%	<b>22,86%</b>
<b>HPQ</b>	Highpine Oil & Gas Limited	14,71%	<b>13,90%</b>
<b>HRu</b>	H&R Real Estate Investment Trust	11,57%	<b>10,96%</b>
<b>HSE</b>	Husky Energy Inc.	10,01%	<b>9,52%</b>
<b>HW</b>	Harry Winston Diamond Corporation	22,85%	<b>22,71%</b>
<b>HXD</b>	FNB Horizons BetaPro S&P/TSX 60 Baissier Plus	13,74%	<b>13,08%</b>
<b>HXU</b>	FNB Horizons BetaPro S&P/TSX 60 Haussier Plus	13,77%	<b>13,09%</b>
<b>IAG</b>	Industrielle Alliance, Assurance et services financiers Inc.	11,51%	<b>11,15%</b>
<b>IFC</b>	Intact Corporation Financière	8,58%	<b>7,46%</b>
<b>IGM</b>	Société Financière IGM Inc.	10,18%	<b>9,76%</b>
<b>IMG</b>	IAMGOLD Corporation	16,86%	<b>16,90%</b>
<b>IMN</b>	Inmet Mining Corporation	17,42%	<b>16,71%</b>
<b>IMO</b>	Compagnie Pétrolière Impériale Ltée	8,13%	<b>8,03%</b>
<b>IVN</b>	Ivanhoe Mines Ltd.	21,32%	<b>19,60%</b>
<b>JAG</b>	Jaguar Mining Inc.	16,15%	<b>15,93%</b>

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés

The Exchange Tower	800, square Victoria
130, rue King ouest, 5 <sup>ème</sup> étage	3 <sup>ème</sup> étage
Toronto, Ontario	Montréal (Québec)
M5X 1J2	H4Z 1A9
Tél. : 416-367-2463	Tél. : 514-871-3545
Télé. : 416-367-2473	Télé. : 514-871-3530

www.cdcc.ca



Symbole sous-jacent	Nom	Intervalles de garantie ACTUELS	Intervalles de garantie MIS À JOUR
<b>K</b>	Kinross Gold Corporation	13,85%	<b>13,45%</b>
<b>KFS</b>	Kingsway Financial Services Inc.	34,15%	<b>31,98%</b>
<b>L</b>	Les Compagnies Loblaw Limitée	6,18%	<b>5,90%</b>
<b>LGB</b>	Contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada de 30 ans	3,62%	<b>3,27%</b>
<b>LLL</b>	lululemon athletica inc.	17,74%	<b>17,39%</b>
<b>LUN</b>	Lundin Mining Corporation	21,34%	<b>19,94%</b>
<b>MBT</b>	Manitoba Telecom Services Inc.	5,09%	<b>5,08%</b>
<b>MCX</b>	Contrat à terme sur unités d'équivalent en dioxyde de carbone (CO <sub>2</sub> e) du Canada	99,99%	<b>99,99%</b>
<b>MDS</b>	MDS Inc.	14,58%	<b>13,90%</b>
<b>MFC</b>	Société Financière Manuvie	16,97%	<b>15,94%</b>
<b>MFL</b>	Minefinders Corporation Ltd.	15,57%	<b>17,77%</b>
<b>MG.A</b>	Magna International Inc. Classe A	13,90%	<b>13,56%</b>
<b>MGO</b>	Migao Corporation	11,89%	<b>11,38%</b>
<b>MRU.A</b>	Métro Inc. Classe A	6,78%	<b>6,72%</b>
<b>MTL</b>	Mullen Group Ltd.	11,31%	<b>11,11%</b>
<b>MX</b>	Methanex Corporation	15,37%	<b>13,24%</b>
<b>NA</b>	Banque Nationale du Canada	9,68%	<b>9,06%</b>
<b>NG</b>	NovaGold Resources Inc.	21,94%	<b>20,34%</b>
<b>NGD</b>	New Gold Inc.	22,39%	<b>21,24%</b>
<b>NKO</b>	Niko Resources Ltd.	10,53%	<b>9,57%</b>
<b>NT</b>	Corporation Nortel Networks	55,39%	<b>55,39%</b>
<b>NVA</b>	NuVista Energy Ltd.	14,26%	<b>13,94%</b>
<b>NXY</b>	Nexen Inc.	12,84%	<b>12,46%</b>
<b>OCX</b>	Onex Corporation	11,79%	<b>11,47%</b>
<b>ONX</b>	Contrat à terme 30 jours sur le taux Repo à un jour	0,16%	<b>0,16%</b>
<b>OPC</b>	OPTI Canada Inc.	31,05%	<b>30,29%</b>
<b>OSK</b>	Osisko Mining Corporation	15,23%	<b>13,29%</b>
<b>OTC</b>	Open Text Corporation	7,51%	<b>11,21%</b>
<b>PAA</b>	Pan American Silver Corp.	14,09%	<b>13,72%</b>
<b>PBG</b>	Petrobank Energy & Resources Ltd.	12,74%	<b>12,34%</b>
<b>PBN</b>	PetroBakken Energy Ltd.	7,24%	<b>7,34%</b>
<b>PCX</b>	Péto-Canada	13,20%	<b>12,83%</b>
<b>PD u</b>	Precision Drilling Trust Units	19,11%	<b>17,95%</b>
<b>PDN</b>	Paladin Resources Ltd.	16,08%	<b>15,49%</b>
<b>PGFu</b>	Pengrowth Energy Trust Units	13,13%	<b>12,76%</b>
<b>PJC.A</b>	Le Groupe Jean Coutu (PJC) inc. Classe A	8,43%	<b>8,17%</b>
<b>PMG</b>	Petrominerals Ltd.	18,04%	<b>17,54%</b>
<b>POT</b>	Potash Corporation of Saskatchewan Inc.	12,65%	<b>12,37%</b>
<b>POU</b>	Paramount Resources Ltd.	15,33%	<b>14,79%</b>

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés

The Exchange Tower	800, square Victoria
130, rue King ouest, 5 <sup>ème</sup> étage	3 <sup>ème</sup> étage
Toronto, Ontario	Montréal (Québec)
M5X 1J2	H4Z 1A9
Tél. : 416-367-2463	Tél. : 514-871-3545
Télé. : 416-367-2473	Télé. : 514-871-3530

www.cdcc.ca

Symbole sous- jacent	Nom	Intervalles de garantie ACTUELS	Intervalles de garantie MIS À JOUR
POW	Power Corporation du Canada	12,39%	<b>11,82%</b>
PRE	Pacific Rubiales Energy Corp	19,29%	<b>16,62%</b>
PRQ	Progress Energy Resources Corp.	13,53%	<b>13,22%</b>
PWF	Corporation Financière Power	12,34%	<b>12,02%</b>
PWTu	Penn West Energy Trust Units	13,06%	<b>12,62%</b>
QLT	QLT Inc.	16,90%	<b>16,54%</b>
QUA	Quadra Mining Ltd.	19,82%	<b>19,02%</b>
RBI	Red Back Mining Inc.	16,25%	<b>16,28%</b>
RCLB	Rogers Communications Inc. Classe B	8,00%	<b>7,88%</b>
REIu	RioCan Real Estate Investment Trust	7,56%	<b>7,36%</b>
RIM	Research In Motion Limited	14,39%	<b>13,47%</b>
RMX	Rubicon Minerals Corporation	15,57%	<b>16,43%</b>
RON	Rona Inc.	8,21%	<b>8,20%</b>
RUS	Métaux Russel Inc.	13,09%	<b>13,00%</b>
RY	Banque Royale du Canada	10,16%	<b>9,32%</b>
S	Sherritt International Corporation	19,85%	<b>18,76%</b>
SAP	Saputo Inc.	9,00%	<b>8,14%</b>
SC	Shoppers Drug Mart Corporation	4,76%	<b>4,35%</b>
SCF	S&P/TSX Composite Index Mini Futures	6,63%	<b>6,05%</b>
SJR.B	Shaw Communications Inc. Classe B	6,60%	<b>6,59%</b>
SLF	Financière Sun Life	15,13%	<b>14,16%</b>
SLW	Silver Wheaton Corp	15,14%	<b>14,91%</b>
SLW	Silver Wheaton Corp (Converge)	25,34%	<b>24,79%</b>
SNC	Groupe SNC-Lavalin Inc.	10,00%	<b>9,76%</b>
SPB	Superior Plus Corp.	8,06%	<b>7,77%</b>
SSO	Les Ressources Silver Standard Inc.	16,35%	<b>16,01%</b>
SU	Suncor Energie Inc.	14,45%	<b>13,18%</b>
SVM	Silvercorp Metals Inc.	19,17%	<b>18,53%</b>
SW	Sierra Wireless, Inc.	15,78%	<b>21,39%</b>
SXA	Contrats à terme sur indice aurifère global S&P/TSX	11,70%	<b>11,38%</b>
SXB	Contrats à terme sur indice plafonné de la finance S&P/TSX	9,94%	<b>9,03%</b>
SXC	SXC Health Solutions Corp.	15,62%	<b>13,93%</b>
SXF	Contrats à terme sur indice composé S&P/TSX	7,27%	<b>6,85%</b>
SXH	Contrats à terme sur indice plafonné des technologies de l'information S&P/TSX	7,32%	<b>6,97%</b>
SXO	Options sur indice S&P/TSX	6,96%	<b>6,68%</b>
SXY	Contrats à terme sur indice plafonné de l'énergie S&P/TSX	10,05%	<b>9,31%</b>
T	TELUS Corporation	7,56%	<b>7,12%</b>
TA	TransAlta Corporation	7,73%	<b>7,54%</b>
TCK.B	Teck Resources Limited Classe B	22,46%	<b>21,76%</b>

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés

The Exchange Tower	800, square Victoria
130, rue King ouest, 5 <sup>ème</sup> étage	3 <sup>ème</sup> étage
Toronto, Ontario	Montréal (Québec)
M5X 1J2	H4Z 1A9
Tél. : 416-367-2463	Tél. : 514-871-3545
Télex. : 416-367-2473	Télex. : 514-871-3530



Symbole sous- jacent	Nom	Intervalles de garantie ACTUELS	Intervalles de garantie MIS À JOUR
TCM	Thompson Creek Metals Company Inc.	18,12%	17,51%
TCW	Trican Well Service Ltd.	14,11%	13,94%
TD	La Banque Toronto-Dominion	9,79%	8,99%
TDG	Trinidad Drilling Ltd.	19,71%	18,62%
TFI	TransForce Inc.	14,79%	14,60%
THI	Tim Hortons Inc.	6,13%	5,98%
TLM	Talisman Energy Inc.	11,76%	11,24%
TRE	Sino-Forest Corporation	16,35%	15,82%
TRI	Thomson Reuters Corporation	8,04%	7,75%
TRP	TransCanada Corporation	5,32%	5,06%
U	Uranium Participation Corporation	10,45%	9,65%
UFS	Domtar Corporation	22,92%	21,53%
USX	Dollar US	3,67%	3,55%
UUU	Uranium One Inc.	22,44%	21,60%
VEN	Ventana Gold Corp.	34,04%	27,97%
VT	Viterra Inc.	10,02%	8,95%
WJA	WestJet Airlines Ltd.	10,44%	10,09%
WN	George Weston limitée	6,37%	6,07%
X	Groupe TMX Inc.	9,06%	8,79%
XCB	iShares CDN DEX - Corporate Bond Index Fund	1,59%	1,82%
XDV	iShares CDN Dow Jones Canada Select Dividend Index Fund	11,13%	10,83%
XEG	iShares CDN Energy Sector Index Fund	9,59%	9,13%
XFN	iShares CDN S&P/TSX Capped Financial Index Fund	9,53%	8,90%
XGD	iShares CDN S&P/TSX Global Gold Index Fund	11,13%	10,83%
XIC	iShares CDN S&P/TSX Capped Composite Index Fund	6,69%	6,44%
XIN	iShares CDN MSCI EAFE 100% Hedged to CAD Dollars Index Fund	6,97%	6,52%
XIT	iShares CDN S&P/TSX Capped Information Technology Index Fund	7,08%	6,60%
XIU	iShares CDN S&P/TSX 60 Index Fund	6,82%	6,44%
XMA	iShares CDN S&P/TSX Capped Materials Index Fund	9,37%	9,99%
XRE	iShares CDN S&P/TSX Capped REIT Index Fund	5,79%	5,55%
XSB	iShares CDN DEX Short Term Bond Index Fund	0,91%	0,77%
XSP	iShares CDN S&P 500 Hedged to Canadian Dollars Index Fund	6,91%	6,42%
YLOu	Fonds de revenu Pages Jaunes Units	9,43%	8,70%
YRI	Yamana Gold Inc.	14,61%	14,15%

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés

The Exchange Tower	800, square Victoria
130, rue King ouest, 5 <sup>ème</sup> étage	3 <sup>ème</sup> étage
Toronto, Ontario	Montréal (Québec)
M5X 1J2	H4Z 1A9
Tél. : 416-367-2463	Tél. : 514-871-3545
Télé. : 416-367-2473	Télé. : 514-871-3530

www.cdcc.ca

---

**Marges sur transactions appariées (« Spreads »)**


---

<b>Symbole des contrats</b>	<b>Marges requises sur transactions appariées (« spreads ») ACTUELLES</b>	<b>Marges requises sur transactions appariées (« spreads ») MISES À JOUR</b>
<b>BAX</b>	235\$	<b>234\$</b>
<b>CGB</b>	200\$	<b>200\$</b>
<b>CGF</b>	200\$	<b>200\$</b>
<b>CGZ</b>	200\$	<b>200\$</b>
<b>LGB</b>	200\$	<b>200\$</b>
<b>ONX</b>	132\$	<b>132\$</b>
<b>SXA</b>	100\$	<b>100\$</b>
<b>SXB</b>	100\$	<b>100\$</b>
<b>SXF</b>	350\$	<b>350\$</b>
<b>SXH</b>	100\$	<b>100\$</b>
<b>SXY</b>	100\$	<b>100\$</b>
<b>MCX</b>	200\$	<b>200\$</b>

---



---

**Marges sur transactions « Butterfly »**


---

<b>Symbole des contrats</b>	<b>Marge requise sur transactions « Butterfly » consécutives ACTUELLE</b>	<b>Marge requise sur transactions « Butterfly » consécutives MISE À JOUR</b>
<b>BAX</b>	166\$	<b>168\$</b>

---

<b>Symbole des contrats</b>	<b>Marge requise sur transactions « Butterfly » non consécutives ACTUELLE</b>	<b>Marge requise sur transactions « Butterfly » non consécutives MISE À JOUR</b>
<b>BAX</b>	261\$	<b>266\$</b>

---



---

**Marges sur transactions appariées entre groupes combinés (« Inter-commodity Spreads »)**

---

<b>Symbole des contrats</b>	<b>Taux de réduction de la marge requise sur transactions appariées entre groupes combinés ACTUEL</b>	<b>Taux de réduction de la marge requise sur transactions appariées entre groupes combinés MIS À JOUR</b>
<b>CGB – CGZ</b>	40%	<b>40%</b>
<b>CGB – LGB</b>	35%	<b>35%</b>
<b>CGB – BAX</b>	70%	<b>70%</b>
<b>CGF – BAX</b>	50%	<b>50%</b>
<b>CGF – CGZ</b>	35%	<b>35%</b>
<b>CGF – CGB</b>	30%	<b>30%</b>
<b>SXF – SCF</b>	85%	<b>85%</b>

---