



AVIS AUX MEMBRES

N° 2012 – 026

Le 22 février 2012

PARAMÈTRES DE COUVERTURE FINANCIÈRE POUR LES TITRES À REVENU FIXE

CDCC effectue sur une base hebdomadaire une mise à jour de ses paramètres de couverture financière :

- Intervalle de marge
- Imputation pour position mixte intra-marchandises (intermensuelle);
- Imputation pour position mixte inter-marchandises.

Les paramètres mis à jour entreront en vigueur lors du traitement informatique de FIN DE JOURNÉE le 22 février 2012 et publiés dans le fichier ci-joint en annexe.

Il est à noter qu'à partir du lundi 27 février, seuls les titres suivants seront éligibles pour la négociation des titres à revenu fixe :

ISIN	Bac
CA135087ZT42	1-2 ans
CA135087ZW70	1-2 ans

Si vous avez des questions ou des commentaires au sujet de cet avis, n'hésitez pas à appeler les services aux membres de la CDCC ou à envoyer un courriel à cdccops@cdcc.ca.

Glenn Goucher
Président et chef de la compensation

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés

The Exchange Tower	800, square Victoria
130, rue King ouest, 5 ^{ème} étage	3 ^{ème} 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

www.cdcc.ca



INTERVALLES DE MARGE (au 22 Février, 2012)

NUMÉRO DU BAC	PLAGE	INTERVALLE DE MARGE PRÉCÉDENT	INTERVALLE DE MARGE MIS À JOUR
1	0- 3 mois	0.18%	0.18%
2	3-6 mois	0.13%	0.13%
3	6 mois-1 an	0.13%	0.13%
4	1-2 ans	0.20%	0.20%
5	2-3 ans	0.22%	0.22%
6	3-5 ans	0.26%	0.26%
7	5-7 ans	0.24%	0.24%
8	7-10 ans	0.23%	0.23%
9	10-15 ans	0.23%	0.23%
10	15-20 ans	0.20%	0.19%
11	20-30 ans	0.20%	0.19%

CONTRAT À TERME VIRTUEL	INTERVALLE DE MARGE PRÉCÉDENT	INTERVALLE DE MARGE MIS À JOUR
CTV	0.037%	0.037%

**IMPUTATIONS POUR POSITION MIXTE INTRA-MARCHANDISES INTERMENSUELLE (au 22 Février, 2012)**

NUMÉRO DU BAC	PLAGE	IMPUTATION PRECEDENTE (\$CAN)	IMPUTATION MISE À JOUR (\$CAN)
1	0- 3 mois	460	400
2	3-6 mois	750	750
3	6 mois-1 an	1180	1160
4	1-2 ans	1870	1850
5	2-3 ans	2270	2230
6	3-5 ans	4880	4830
7	5-7 ans	4380	4290
8	7-10 ans	13960	13940
9	10-15 ans	22060	21850
10	15-20 ans	22970	22800
11	20-30 ans	33220	32930

