



AVIS AUX MEMBRES

N° 2014 – 028

Le 4 février 2014

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 :

- Intervalle de marge ;
- Imputation pour position mixte intra-marchandises (intermensuelle) (plus communément appelées « Spreads ») pour les contrats à terme ;
- Imputation pour position mixte intra-marchandises de type « Butterfly » consécutif et non consécutif pour le contrat BAX;
- Imputation (réduction de marge) pour position mixte inter-marchandises (plus communément appelées « Inter-commodity Spreads ») pour les contrats à terme CGB – CGZ, CGB – LGB, CGF – CGZ, CGF – CGB, SXF – SCF, SXF – SCM et SXM – SCF.

Les paramètres mis à jour entreront en vigueur lors du traitement informatique de FIN DE JOURNÉE le 4 février 2014.

Les documents concernant les intervalles de garantie sont présentement disponibles sur le site web de la CDCC : www.cdcc.ca - http://cdcc.ca/miFiles_fr

Pour toute information complémentaire, veuillez communiquer avec le département de Gestion des risques au (514) 871-3505.

Glenn Goucher
Président et chef de la compensation