



AVIS AUX MEMBRES

N° 2015 – 043

Le 1 avril 2015

MODIFICATION DU MODE DE CALCUL DE LA MARGE DU CONTRAT À TERME SUR ACCEPTATIONS BANCAIRES CANADIENNES DE TROIS MOIS (BAX)

LANCEMENT : le 28 septembre 2015

Le 31 juillet 2014, la Corporation canadienne de compensation de produits dérivés (« CDCC ») a annoncé l'autocertification de ses règles à l'égard d'une modification du mode de calcul de la marge des contrats à terme sur acceptations bancaires canadiennes de trois mois (BAX) afin de permettre de nouveaux taux de marge pour les positions simples et les stratégies de positions mixtes sur ce contrat. Cette annonce a été faite dans l'avis aux membres 2014-166.

Le 22 septembre 2014, comme l'indiquait l'avis aux membres 2014-187, le lancement a été reporté dans l'intérêt de tous les participants au marché.

La CDCC est heureuse d'annoncer que le lancement est maintenant prévu pour le lundi 28 septembre 2015, avec l'application du calcul des marges de fin de journée.

Si vous avez des questions ou des préoccupations, veuillez communiquer avec la Division des opérations intégrées de la CDCC ou envoyer un courriel à cdcc-ops@cdcc.ca.

Glenn Goucher
Président et chef de la compensation