

AVIS AUX MEMBRES

No. 2021 – 062

Le 22 avril 2021

VALEURS DES SEUILS ET DES SUPPLÉMENTS POUR LA MARGE SUPPLÉMENTAIRE POUR LE RISQUE DE LIQUIDITÉ DU CONTRAT À TERME DE CONTRATS A TERME SUR L'INDICE COMPOSÉ S&P/TSX ESG (SCG)

La marge supplémentaire pour le risque de liquidité couvre le risque de liquidité qui survient lorsque la CDCC doit dénouer des positions à un prix différent du cours du marché.

On peut décomposer le risque de liquidité en deux composantes : le risque de liquidité intrinsèque, qui est essentiellement associé à l'écart acheteur-vendeur, et le risque de liquidité additionnel, qui est attribuable aux positions concentrées qui ne peuvent être dénouées à l'intérieur de l'écart acheteur-vendeur.

La méthode de calcul de la marge supplémentaire pour le risque de liquidité suppose un supplément absolu ou relatif à l'égard des positions dépassant des seuils établis au préalable.

La valeur des seuils et des suppléments du contrat à terme sur le contrat à terme sur l'indice composé S&P/TSX ESG (SCG) seront applicables à partir du **Lundi 26 Avril 2021**. Les détails à propos de ces valeurs sont disponibles ci-dessous :

SCG			
	BORNE INFÉRIEURE	BORNE SUPÉRIEURE	MLR PAR CONTRAT (\$Valeur)
1	0	2900	3.13
2	2900	3045	10.09
3	3045	3190	37.64
4	3190	3335	74.10
5	3335	3480	115.69
6	3480	3625	160.53
7	3625	3770	207.47
8	3770	3915	255.75
9	3915	4060	304.85
10	4060	4205	354.39
11	4205	4350	404.10
12	4350	4495	453.78
13	4495	4640	503.27

SCG			
	BORNE INFÉRIEURE	BORNE SUPÉRIEURE	MLR PAR CONTRAT (\$Valeur)
14	4640	4785	552.46
15	4785	4930	601.28
16	4930	5075	649.66
17	5075	5220	697.55
18	5220	5365	744.93
19	5365	5510	791.77
20	5510	5655	838.06
21	5655	5800	883.79
22	5800	5945	928.96
23	5945	6090	973.56
24	6090	6235	1017.60
25	6235	6380	1061.09
26	6380	6525	1104.02
27	6525	6670	1146.41
28	6670	6815	1188.27
29	6815	6960	1229.61
30	6960	7105	1270.43
31	7105	7250	1310.75
32	7250	7395	1350.58
33	7395	7540	1389.93
34	7540	7685	1428.81
35	7685	7830	1467.22
36	7830	7975	1505.19
37	7975	8120	1542.72
38	8120	8265	1579.82
39	8265	8410	1616.50
40	8410	8555	1652.78
41	8555	8700	1688.65
42	8700	8845	1724.14
43	8845	8990	1759.24
44	8990	9135	1793.98
45	9135	9280	1828.35
46	9280	9425	1862.37
47	9425	9570	1896.05
48	9570	9715	1929.38

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés

100, rue Adelaide ouest 1700-1190 avenue des Canadiens-de-Montréal
3^e étage C.P. 37
Toronto ON M5H 1S3 Montréal QC H3B 0G7
416-367-2470 514-871-3545
www.cdcc.ca

SCG			
	BORNE INFÉRIEURE	BORNE SUPÉRIEURE	MLR PAR CONTRAT (\$Valeur)
49	9715	9860	1962.39
50	9860	10005	1995.08
51	10005	10150	2027.45

Pour toute information supplémentaire, veuillez contacter le service de la gestion des risques au (514) 871-3505.

Anne Fiddes
Vice-présidente, Opérations intégrées de la CDCC