



AVIS AUX MEMBRES

N° 2010 - 090

Le 5 octobre 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 6 octobre 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

130 King Street West
P.O. Box 450, 5th Floor
Toronto, Ontario
M5X 1J2
Tel : 416-350-2775
Fax : 416-367-2473

800, square Victoria
3^{ième} étage
Montréal (Québec)
H4Z 1A9
Tél. : 514-871-3545
Télec. : 514-871-3530

www.cdcc.ca

Intervalles de garantie

Symbole sous-jacent	Nom	Intervalles de garantie ACTUELS	Intervalles de garantie MIS À JOUR
AAV	Advantage Oil & Gas Ltd.	10,72%	10,34%
ABX	Société aurifère Barrick	9,26%	8,85%
ACM.A	Astral Media Inc. Classe A	5,50%	4,98%
AEM	Mines Agnico-Eagle Limitée	10,12%	9,45%
AER	Groupe Aeroplan Inc.	9,63%	7,25%
AET.UN	ARC Energy Trust	7,68%	7,24%
AGF.B	La Société de Gestion AGF Limitée Classe B	7,43%	7,19%
AGI	Alamos Gold Inc.	11,99%	11,93%
AGU	Agrium Inc.	9,05%	9,14%
ALA	AltaGas Ltd.	4,93%	4,59%
ANO	Anatolia Minerals Development Limited	14,22%	15,97%
ANV	Allied Nevada Gold Corp.	8,73%	13,50%
ARE	Groupe Aecon Inc.	8,73%	7,20%
ARZ	Mines Aurizon Ltée	13,28%	12,31%
ATA	ATS Automation Tooling Systems Inc.	10,56%	10,71%
ATD.B	Alimentation Couche-Tard Inc. Classe B	10,99%	8,23%
ATH	Athabasca Oil Sands Corp.	12,65%	11,99%
ATP	Atlantic Power Corporation	6,80%	7,06%
BAM.A	Brookfield Asset Management Inc. Classe A	7,40%	7,10%
BAX	Contrats à terme sur acceptations bancaires canadiennes de trois mois	0,14%	0,19%
BBD.B	Bombardier Inc. Classe B	10,27%	10,00%
BCB	Cott Corporation	11,13%	10,84%
BCE	BCE Inc.	4,45%	4,31%
BIN	IESI-BFC Ltd.	8,71%	7,47%
BIR	Birchcliff Energy Ltd.	8,39%	8,95%
BLD	Ballard Power Systems Inc.	16,93%	21,51%
BMO	Banque de Montréal	7,53%	5,98%
BNK	Bankers Petroleum Ltd.	16,26%	13,51%
BNS	La Banque de Nouvelle-Écosse	5,79%	5,36%
BPO	Brookfield Properties Corporation	7,52%	7,83%
CAE	CAE Inc.	6,88%	6,33%
CAR.UN	Cdn Apartment Properties Real Estate Invest Tr.	5,66%	5,71%
CAS	Cascades Inc.	10,88%	9,30%
CCA	Cogeco Câble Inc.	5,30%	6,44%
CCO	Cameco Corporation	7,55%	7,50%
CDH	Corridor Resources Inc.	14,71%	16,43%
CDM	Cœur d'Alene Mines Corporation	11,79%	12,69%
CFP	Canfor Corporation	9,70%	9,73%
CG	Centerra Gold Inc.	11,29%	13,07%

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés

130 King Street West	800, square Victoria
P.O. Box 450, 5 th Floor	3 ^{ème} étage
Toronto, Ontario	Montréal (Québec)
M5X 1J2	H4Z 1A9
Tel. : 416-350-2775	Tél. : 514-871-3545
Fax : 416-367-2473	Téloc. : 514-871-3530

Symbole sous-jacent	Nom	Intervalles de garantie ACTUELS	Intervalles de garantie MIS À JOUR
CGB	Contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada de dix ans	1,66%	1,71%
CGF	Contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada de cinq ans	1,41%	1,66%
CGG	China Gold International Resources Corp. Ltd.	23,17%	19,92%
CGL	Claymore Gold Bullion ETF	4,16%	4,32%
CGZ	Contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada de deux ans	0,76%	0,74%
CIX	CI Financial Corp.	6,45%	5,82%
CJR.B	Corus Entertainment Inc. Classe B	7,03%	7,29%
CLM	Consolidated Thompson Iron Mines limitée	13,10%	11,75%
CLS	Celestica Inc.	8,55%	9,15%
CLT	Celtic Exploration Ltd.	12,32%	11,17%
CM	Banque Canadienne Impériale de Commerce	7,33%	6,21%
CNL	Continental Gold Limited	17,79%	17,74%
CNQ	Canadian Natural Resources Limited	8,21%	8,01%
CNR	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	6,48%	5,69%
COM	Cardiome Pharma Corp.	19,62%	13,42%
COS.UN	Canadian Oil Sands Trust Units	7,70%	7,76%
COW	Claymore Global Agriculture	6,30%	4,85%
CP	Chemin de fer Canadien Pacifique Limitée	7,27%	6,44%
CPG	Crescent Point Energy Corp.	6,14%	5,15%
CPX	Capital Power Corporation	3,63%	3,91%
CR	Crew Energy Inc.	10,61%	10,14%
CSH.UN	Chartwell Seniors Housing Real Estate Investment Trust	6,87%	6,81%
CSI	Colossus Minerals Inc.	12,38%	15,51%
CTC.A	Société Canadian Tire Limitée Classe A	6,81%	5,63%
CU	Canadian Utilities Limited	5,55%	5,05%
CVE	Cenovus Energy Inc.	9,00%	8,42%
CWB	Canadian Western Bank	7,56%	7,46%
CWT.UN	Calloway Real Estate Investment Trust	4,88%	5,88%
DAY	Daylight Energy Ltd.	8,13%	7,39%
DC.A	Dundee Corporation	8,62%	8,99%
DGC	Detour Gold Corporation	11,53%	16,17%
DOL	Dollarama Inc.	5,04%	6,41%
DPM	Dundee Precious Metals Inc. (Converge)	25,28%	21,32%
DWI	DragonWave Inc	19,60%	17,94%
ECA	EnCana Corporation	7,48%	7,31%
EDR	Endeavour Silver Corp. (Converge)	65,82%	26,67%
EGU	European Goldfields Limited	15,21%	14,44%
ELD	Eldorado Gold Corporation	9,97%	10,47%
EMA	Emera Inc.	4,56%	4,82%
ENB	Enbridge Inc.	4,62%	4,38%
EQN	Equinox Minerals Limited	14,40%	13,49%
ERF.UN	Enerplus Resources Fund Units	6,07%	5,38%

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés

130 King Street West	800, square Victoria
P.O. Box 450, 5 th Floor	3 ^{ème} étage
Toronto, Ontario	Montréal (Québec)
M5X 1J2	H4Z 1A9
Tel. : 416-350-2775	Tél. : 514-871-3545
Fax : 416-367-2473	Télex. : 514-871-3530

Symbole sous-jacent	Nom	Intervalles de garantie ACTUELS	Intervalles de garantie MIS À JOUR
ESI	Ensign Energy Services Inc.	5,96%	6,83%
EXE.UN	Extencicare Real Estate Investment Trust	8,37%	7,86%
FCR	First Capital Realty Inc.	4,73%	4,56%
FEL	Fairborne Energy Ltd.	11,09%	10,52%
FM	First Quantum Minerals Ltd.	15,72%	14,91%
FNV	Franco-Nevada Corporation	7,28%	8,73%
FR	First Majestic Silver Corp.	13,24%	15,19%
FRG	Fronteer Development Group Inc.	19,19%	13,87%
FTS	Fortis Inc.	5,62%	5,39%
FTT	Finning International Inc.	8,85%	8,54%
G	Goldcorp Inc.	8,54%	9,07%
G	Goldcorp Inc. (Converge)	14,07%	14,89%
GAM	Gammon Gold Inc.	13,86%	13,53%
GAS	Claymore Natural Gas Commodity ETF	10,81%	11,37%
GBU	Gabriel Resources Ltd.	12,50%	20,49%
GC	Great Canadian Gaming Corporation	9,79%	9,58%
GCE	Grande Cache Coal Corporation	21,65%	18,36%
GIB.A	Groupe CGI Inc. Classe A	6,83%	7,10%
GIL	Les Vêtements de Sport Gildan Inc.	7,67%	7,94%
GMP	GMP Capital Inc.	9,04%	8,87%
GNA1	Gerdau Ameristeel Corporation (ajusté)	23,97%	23,22%
GO	Galleon Energy Inc.	11,91%	12,13%
GSC	Golden Star Resources Ltd.	11,91%	13,48%
GSL	Greystar Resources Ltd.	32,48%	24,80%
GTE	Gran Tierra Energy Inc.	10,65%	10,55%
GUY	Guyana Goldfields Inc.	9,93%	9,81%
GW	Corporation de Sécurité Garda World	14,53%	14,12%
GWO	Great-West Lifeco Inc.	5,80%	5,55%
HBM	HudBay Minerals Inc.	14,05%	14,70%
HED	FNB Horizons BetaPro S&P/TSX plafonné énergie Baissier Plus	12,25%	11,02%
HEU	FNB Horizons BetaPro S&P/TSX plafonné énergie Haussier Plus	12,04%	10,87%
HFD	FNB Horizons BetaPro S&P/TSX plafonné finance Baissier Plus	11,41%	9,17%
HFU	FNB Horizons BetaPro S&P/TSX plafonné finance Haussier Plus	11,42%	9,25%
HGD	FNB Horizons BetaPro S&P/TSX aurifère mondial Baissier Plus	13,78%	15,49%
HGU	FNB Horizons BetaPro S&P/TSX aurifère mondial Haussier Plus	13,71%	15,39%
HIX	Horizons BetaPro S&P/TSX 60 Inverse ETF	4,35%	3,90%
HND	FNB Horizons BetaPro NYMEX Gaz naturel Baissier Plus	21,44%	23,24%
HNU	FNB Horizons BetaPro NYMEX Gaz naturel Haussier Plus	21,66%	23,16%
HOD	FNB Horizons BetaPro NYMEX Pétrole brut Baissier Plus	17,82%	16,24%
HOU	FNB Horizons BetaPro NYMEX Pétrole brut Haussier Plus	17,76%	16,17%
HR.UN	H&R Real Estate Investment Trust	5,82%	6,25%

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés

130 King Street West	800, square Victoria
P.O. Box 450, 5 th Floor	3 ^{ème} étage
Toronto, Ontario	Montréal (Québec)
M5X 1J2	H4Z 1A9
Tel. : 416-350-2775	Tél. : 514-871-3545
Fax : 416-367-2473	Télex. : 514-871-3530

Symbole sous-jacent	Nom	Intervalles de garantie ACTUELS	Intervalles de garantie MIS À JOUR
HSE	Husky Energy Inc.	6,35%	5,88%
HW	Harry Winston Diamond Corporation	11,12%	22,11%
HXD	FNB Horizons BetaPro S&P/TSX 60 Baissier Plus	8,75%	7,81%
HXU	FNB Horizons BetaPro S&P/TSX 60 Haussier Plus	8,72%	7,78%
IAG	Industrielle Alliance, Assurance et services financiers Inc.	5,80%	7,33%
IFC	Intact Corporation Financière	5,44%	5,26%
IGM	Société Financière IGM Inc.	5,83%	5,29%
IMG	IAMGOLD Corporation	11,52%	13,07%
IMN	Inmet Mining Corporation	12,84%	12,46%
IMO	Compagnie Pétrolière Impériale Ltée	5,57%	5,24%
IMX	IMAX Corp.	13,04%	12,87%
ITH	International Tower Hill Mines Ltd.	12,05%	13,06%
IVN	Ivanhoe Mines Ltd.	14,01%	13,26%
JAG	Jaguar Mining Inc.	22,65%	15,49%
K	Kinross Gold Corporation	9,29%	9,60%
K1	Red Back Mining Inc. (ajusté)	12,55%	12,45%
KGI	Kirkland Lake Gold Inc.	11,92%	11,76%
KGN	Keegan Resources Inc.	11,87%	13,61%
L	Les Compagnies Loblaw Limitée	5,07%	4,84%
LEG	Legacy Oil and Gas Inc.	10,50%	9,48%
LGB	Contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada de 30 ans	2,15%	2,15%
LLL	lululemon athletica inc.	13,62%	14,70%
LUN	Lundin Mining Corporation	15,70%	14,77%
MBT	Manitoba Telecom Services Inc.	9,47%	5,62%
MCX	Contrat à terme sur unités d'équivalent en dioxyde de carbone (CO2e) du Canada	99,99%	99,99%
MDS	MDS Inc.	7,35%	8,18%
MFC	Société Financière Manuvie	13,06%	10,85%
MFL	Minefinders Corporation Ltd.	8,92%	14,54%
MG	Magna International Inc.	12,05%	9,94%
MGO	Migao Corporation	9,20%	7,52%
MIC	Genworth MI Canada Inc.	7,49%	6,79%
ML	Mercator Minerals Ltd. (Converge)	82,80%	30,72%
MRU.A	Métro Inc. Classe A	6,16%	5,82%
MTL	Mullen Group Ltd.	7,55%	6,98%
MX	Methanex Corporation	9,68%	9,56%
NA	Banque Nationale du Canada	7,46%	5,38%
NAE.UN	NAL Oil & Gas Trust	7,88%	7,25%
NG	NovaGold Resources Inc.	16,99%	15,33%
NGD	New Gold Inc.	16,07%	15,74%
NGL	Angle Energy Inc.	10,46%	10,01%
NKO	Niko Resources Ltd.	8,59%	8,14%

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés

130 King Street West	800, square Victoria
P.O. Box 450, 5 th Floor	3 ^{ème} étage
Toronto, Ontario	Montréal (Québec)
M5X 1J2	H4Z 1A9
Tel. : 416-350-2775	Tél. : 514-871-3545
Fax : 416-367-2473	Télex : 514-871-3530

Symbole sous-jacent	Nom	Intervalles de garantie ACTUELS	Intervalles de garantie MIS À JOUR
NSU	Nevsun Resources Ltd.	16,85%	16,38%
NT	Corporation Nortel Networks	55,39%	55,39%
NVA	NuVista Energy Ltd.	10,22%	9,70%
NXY	Nexen Inc.	7,84%	7,62%
OCX	Onex Corporation	8,16%	6,74%
ONX	Contrat à terme 30 jours sur le taux Repo à un jour	0,15%	0,21%
OPC	OPTI Canada Inc.	24,30%	16,26%
OSK	Osisko Mining Corporation	11,18%	10,74%
OTC	Open Text Corporation	17,38%	10,11%
PAA	Pan American Silver Corp.	10,12%	9,51%
PBG	Petrobank Energy & Resources Ltd.	10,07%	9,50%
PBN	PetroBakken Energy Ltd.	8,56%	8,40%
PCX	Petro Canada (ajusté)	8,97%	7,78%
PD	Precision Drilling Corp.	11,04%	10,77%
PDN	Paladin Resources Ltd.	11,89%	11,34%
PG	Premier Gold Mines Limited	11,44%	11,42%
PGF.UN	Pengrowth Energy Trust Units	7,27%	6,96%
PJC.A	Le Groupe Jean Coutu (PJC) inc. Classe A	5,36%	5,13%
PMG	Petrominerals Ltd.	13,71%	13,19%
PMZ.UN	Primaris Retail Real Estate Investment Trust	6,14%	6,20%
POT	Potash Corporation of Saskatchewan Inc.	24,65%	13,78%
POU	Paramount Resources Ltd.	11,20%	10,63%
POW	Power Corporation du Canada	6,57%	6,39%
PRE	Pacific Rubiales Energy Corp	9,70%	9,25%
PRQ	Progress Energy Resources Corp.	9,28%	8,78%
PWF	Corporation Financière Power	5,89%	5,61%
PWT.UN	Penn West Energy Trust Units	7,00%	6,93%
QEC	Questerre Energy Corporation	20,75%	20,01%
QLT	QLT Inc.	10,13%	10,13%
QUX	Quadra FNX Mining Ltd.	17,61%	15,82%
QUX1	FNX Mining Compnay Inc. (ajusté)	16,97%	15,78%
RBA	Ritchie Bros	7,92%	7,85%
RCLB	Rogers Communications Inc. Classe B	5,98%	5,94%
REI.UN	RioCan Real Estate Investment Trust	5,65%	5,42%
RGL	Royal Gold Inc.	9,29%	8,65%
RIM	Research In Motion Limited	11,43%	11,70%
RMX	Rubicon Minerals Corporation	13,45%	11,87%
RON	Rona Inc.	6,97%	6,07%
RUS	Métaux Russel Inc.	8,24%	7,76%
RVX	Resverlogix Corp.	24,20%	37,40%
RY	Banque Royale du Canada	6,63%	5,84%

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés

130 King Street West	800, square Victoria
P.O. Box 450, 5 th Floor	3 ^{ème} étage
Toronto, Ontario	Montréal (Québec)
M5X 1J2	H4Z 1A9
Tel. : 416-350-2775	Tél. : 514-871-3545
Fax : 416-367-2473	Télc. : 514-871-3530

Symbole sous-jacent	Nom	Intervalles de garantie ACTUELS	Intervalles de garantie MIS À JOUR
S	Sherritt International Corporation	10,52%	10,36%
SAP	Saputo Inc.	6,04%	5,68%
SC	Shoppers Drug Mart Corporation	5,59%	5,36%
SCF	S&P/TSX Composite Index Mini Futures	4,50%	4,14%
SEA	Seabridge Gold Inc.	15,29%	14,07%
SJR.B	Shaw Communications Inc. Classe B	5,03%	4,44%
SLF	Financière Sun Life	8,12%	7,82%
SLW	Silver Wheaton Corp.	11,27%	10,74%
SMF	SEMAFO INC.	15,00%	14,46%
SNC	Groupe SNC-Lavalin Inc.	6,54%	6,50%
SPB	Superior Plus Corp.	11,07%	6,61%
SSO	Les Ressources Silver Standard Inc.	11,40%	10,87%
SU	Suncor Energie Inc.	7,77%	7,60%
SVM	Silvercorp Metals Inc.	15,30%	13,99%
SW	Sierra Wireless, Inc.	15,22%	14,30%
SXA	Contrats à terme sur indice aurifère global S&P/TSX	8,81%	8,36%
SXB	Contrats à terme sur indice plafonné de la finance S&P/TSX	5,56%	4,55%
SXC	SXC Health Solutions Corp.	10,87%	10,88%
SXF	Contrats à terme sur indice composé S&P/TSX	4,67%	4,23%
SXH	Contrats à terme sur indice plafonné des technologies de l'information S&P/TSX	5,65%	5,60%
SXO	Options sur indice S&P/TSX	4,42%	3,99%
SXY	Contrats à terme sur indice plafonné de l'énergie S&P/TSX	6,20%	5,63%
T	TELUS Corporation	4,91%	4,71%
TA	TransAlta Corporation	5,57%	5,15%
TCK.B	Teck Resources Limited Classe B	14,32%	12,67%
TCL.A	Transcontinental Inc.	10,05%	8,75%
TCM	Thompson Creek Metals Company Inc.	13,73%	13,41%
TCW	Trican Well Service Ltd.	10,53%	9,34%
TD	La Banque Toronto-Dominion	5,64%	5,04%
TDG	Trinidad Drilling Ltd.	11,51%	10,91%
TET	Trilogy Energy Corp.	7,70%	7,78%
TFI	TransForce Inc.	8,92%	8,45%
TGL	TransGlobe Energy Corporation	10,23%	11,76%
TH	Theratechnologies inc.	42,96%	42,82%
THI	Tim Hortons Inc.	6,40%	4,68%
TIH	Toromont Industries Ltd.	7,76%	7,30%
TKO	Taseko Mines Limited	17,22%	16,47%
TLM	Talisman Energy Inc.	7,36%	7,10%
TNX	Tanzanian Royalty Exploration Corporation	12,58%	13,98%
TRE	Sino-Forest Corporation	11,39%	11,00%
TRI	Thomson Reuters Corporation	5,35%	4,75%

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés

130 King Street West	800, square Victoria
P.O. Box 450, 5 th Floor	3 ^{ème} étage
Toronto, Ontario	Montréal (Québec)
M5X 1J2	H4Z 1A9
Tel. : 416-350-2775	Tél. : 514-871-3545
Fax : 416-367-2473	Télé. : 514-871-3530

Symbole sous-jacent	Nom	Intervalles de garantie ACTUELS	Intervalles de garantie MIS À JOUR
TRP	TransCanada Corporation	4,39%	3,78%
U	Uranium Participation Corporation	6,96%	6,46%
UFS	Domtar Corporation	15,23%	13,17%
USX	Dollar US	3,79%	3,28%
UUU	Uranium One Inc.	14,38%	13,41%
VEN	Ventana Gold Corp.	16,79%	16,77%
VRO	Vero Energy Inc.	14,39%	13,62%
VRX	Valeant Pharmaceuticals International Inc.(ajusté)	10,91%	11,87%
VT	Viterra Inc.	12,42%	9,24%
WCH	Contrat à terme sur le différentiel de prix du pétrole brut lourd canadien	3,35%	2,70%
WJA	WestJet Airlines Ltd.	8,52%	7,33%
WN	George Weston limitée	6,28%	6,23%
WPT	Westport Innovations Inc.	17,01%	15,74%
WTN	Western Coal Corp	18,71%	17,82%
X	Groupe TMX Inc.	5,77%	5,53%
XCB	iShares CDN DEX - Corporate Bond Index Fund	1,40%	1,41%
XDV	iShares CDN Dow Jones Canada Select Dividend Index Fund	8,25%	7,76%
XEG	iShares CDN Energy Sector Index Fund	6,10%	5,49%
XFN	iShares CDN S&P/TSX Capped Financial Index Fund	5,76%	4,60%
XGD	iShares CDN S&P/TSX Global Gold Index Fund	8,25%	7,76%
XIC	iShares CDN S&P/TSX Capped Composite Index Fund	4,40%	4,04%
XIN	iShares CDN MSCI EAFE 100% Hedged to CAD Dollars Index Fund	7,32%	6,08%
XIT	iShares CDN S&P/TSX Capped Information Technology Index Fund	5,18%	4,94%
XIU	iShares CDN S&P/TSX 60 Index Fund	4,44%	3,96%
XMA	iShares CDN S&P/TSX Capped Materials Index Fund	7,22%	6,94%
XRC	Exeter Resources	20,79%	20,10%
XRE	iShares CDN S&P/TSX Capped REIT Index Fund	3,96%	3,78%
XSB	iShares CDN DEX Short Term Bond Index Fund	0,89%	0,87%
XSP	iShares CDN S&P 500 Hedged to Canadian Dollars Index Fund	6,52%	5,58%
YLO.UN	Fonds de revenu Pages Jaunes Units	6,77%	6,74%
YRI	Yamana Gold Inc.	10,82%	10,18%
ZCN	BMO Dow Jones Canada Titans 60 Index ETF	4,14%	3,98%

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés

130 King Street West
P.O. Box 450, 5th Floor
Toronto, Ontario
M5X 1J2
Tel. : 416-350-2775
Fax : 416-367-2473

800, square Victoria
3^{ème} étage
Montréal (Québec)
H4Z 1A9
Tél. : 514-871-3545
Téléc. : 514-871-3530

Marges sur transactions appariées (« Spreads »)

Symbole des contrats	Marges requises sur transactions appariées (« spreads ») ACTUELLES	Marges requises sur transactions appariées (« spreads ») MISES À JOUR
BAX	187\$	155\$
CGB	200\$	200\$
CGF	200\$	200\$
CGZ	200\$	200\$
LGB	200\$	200\$
ONX	132\$	132\$
SCF	200\$	200\$
SXA	100\$	100\$
SXB	100\$	100\$
SXF	350\$	350\$
SXH	100\$	100\$
SXY	100\$	100\$
WCH	2800\$	2700\$
MCX	200\$	200\$

Marges sur transactions « Butterfly »

Symbole des contrats	Marge requise sur transactions « Butterfly » consécutives ACTUELLE	Marge requise sur transactions « Butterfly » consécutives MISE À JOUR
BAX	140\$	109\$

Symbole des contrats	Marge requise sur transactions « Butterfly » non consécutives ACTUELLE	Marge requise sur transactions « Butterfly » non consécutives MISE À JOUR
BAX	232\$	207\$

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

Symbole des contrats	Taux de réduction de la marge requisse sur transactions appariées entre groupes combinés ACTUEL	Taux de réduction de la marge requisse sur transactions appariées entre groupes combinés MIS À JOUR
CGB – CGZ	50%	70%
CGB – LGB	70%	65%
CGB – BAX	70%	70%
CGF – BAX	50%	50%
CGF – CGZ	35%	35%
CGF – CGB	30%	30%
SXF – SCF	90%	90%

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés

130 King Street West
P.O. Box 450, 5th Floor
Toronto, Ontario
M5X 1J2
Tel. : 416-350-2775
Fax : 416-367-2473

800, square Victoria
3^{ème} étage
Montréal (Québec)
H4Z 1A9
Tél. : 514-871-3545
Télééc. : 514-871-3530