



AVIS AUX MEMBRES

N° 2015 - 128

Le 2 novembre 2015

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

LANCEMENT – 30 novembre 2015

Le 31 juillet 2014, la CDCC a annoncé l'autocertification de ses règles à l'égard d'une modification du mode de calcul de la marge du contrat à terme sur acceptations bancaires canadiennes de trois mois (BAX) afin de lui permettre d'introduire de nouveaux taux de marges 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, la mise en œuvre du nouveau mode de calcul a été reportée dans l'intérêt de tous les participants au marché. Le 1^{er} avril 2015, la CDCC a publié l'avis aux membres 2015-043 pour annoncer l'introduction du nouveau mode de calcul de la marge, avec l'application du calcul des marges de fin de journée le lundi 28 septembre 2015.

Le 22 septembre 2015, en raison d'une situation imprévue, la CDCC a dû à nouveau reporter cette mise en œuvre (avis aux membres 2015-116). La situation est maintenant rétablie. La CDCC est heureuse d'annoncer que le lancement est désormais prévu pour le lundi 30 novembre 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

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés

The Exchange Tower
130, rue King Ouest, 5^e étage
Toronto (Ontario)
M5X 1J2
Tél. : 416 367-2470

Tour de la Bourse
800, square Victoria, 3^e étage
Montréal (Québec)
H4Z 1A9
Tél. : 514 871-3545