



## AVIS AUX MEMBRES

N° 2014 – 149

Le 15 juin 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 15 juillet 2014.

Les documents concernant les intervalles de garantie sont présentement disponibles sur le site web de la CDCC : [www.cdcc.ca](http://www.cdcc.ca) - [http://cdcc.ca/miFiles\\_fr](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

---

**Corporation canadienne de compensation de produits dérivés**

The Exchange Tower	Tour de la Bourse
130, rue King ouest, 5 <sup>e</sup> étage	800, square Victoria, 3 <sup>e</sup> étage
Toronto (Ontario)	Montréal (Québec)
M5X 1J2	H4Z 1A9
Tél. : 416-367-2470	Tél. : 514-871-3545

[www.cdcc.ca](http://www.cdcc.ca)