



AVIS AUX MEMBRES

N° 2014 –171

Le 06 août 2014

PARAMÈTRES DE COUVERTURE FINANCIÈRE POUR LES INSTRUMENTS DÉRIVÉS DE LA BOURSE DE MONTRÉAL ET LES INSTRUMENTS DÉRIVÉS DU MARCHÉ HORS COTE

CDCC effectue sur une base hebdomadaire une mise à jour de ses paramètres de couverture financière :

- Imputations pour positions mixtes intra-marchandises (intermensuelles) (plus communément appelées « Spreads ») pour les contrats à terme ;
- Imputations pour positions mixtes intra-marchandises de type « Butterfly » consécutif et non consécutif pour le contrat BAX;
- Imputations (réductions de marge) pour positions mixtes 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 mercredi lors du traitement informatique de FIN DE JOURNÉE. Les documents concernant les intervalles de garantie seront disponibles chaque lundi sur le site web de la CDCC http://cdcc.ca/miFiles_fr.

À partir du 6 août 2014, la CDCC effectuera quotidiennement la mise à jour de ses Intervalles de marge. Les paramètres mis à jour entreront en vigueur lors du traitement informatique de DÉBUT DE JOURNÉE. Les documents concernant les intervalles de garantie seront disponibles chaque jour sur le site web de la CDCC 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