



AVIS AUX MEMBRES

N° 2012 - 198

Le 23 octobre 2012

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 24 octobre 2012.

Les documents concernant les intervalles de garantie sont présentement disponibles sur le site web de la CDCC : www.cdcc.ca - 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