



AVIS AUX MEMBRES

N° 2006 – 084

Le 28 juin 2006

Appels de marges intra-journalières

La Corporation canadienne de compensation de produits dérivés (CDCC) désire informer ses membres qu'elle implantera à compter du 10 juillet 2006 des modifications à son processus d'appel de marges intra-journalières, tel que défini à la règle A-705 de CDCC.

Selon le nouveau processus, les exigences de marges intra-journalières des membres seront calculées sur la base des positions existantes et des cours du moment lors de l'exécution du processus. Le système de marge SPAN® est utilisé dans le calcul des exigences de marges.

Le processus d'appel de marges intra-journalières sera exécuté deux fois en cours de journée, à 11 heures 00 et à 13 heures 30, heure normale de l'Est et les membres auront accès en ligne aux résultats de chaque calcul.

Pour de plus amples renseignements, veuillez vous adresser à Samira Mensah, du service de Gestion du risque, au (514) 871-4949, poste 476.

Michel Favreau
Premier vice-président et chef de la compensation

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés

65, rue Queen Ouest
Bureau 700
Toronto, Ontario
M5H 2M5
Tél. : 416-367-2463
Télec. : 416-367-2473

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

www.cdcc.ca