



AVIS AUX MEMBRES

N^o 2008 – 019

Le 11 février 2008

ERRATUM

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

La Bourse et la CDCC, désirent clarifier et corriger l'avis aux membres de CDCC #2008-018 relativement aux paramètres de couverture financière, publié le 5 février 2008.

Veillez noter que les marges actuelles sur transactions appariées (« Spreads ») et transactions « Butterfly » pour les contrats à terme BAX et la réduction de marge sur transactions appariées entre groupes combinés (« Inter-commodity Spreads ») pour les contrats à terme CGB et CGZ sont comme suit :

Marges sur transactions appariées (« Spreads »)

Symbole des contrats	Marges requises sur transactions appariées (« spreads ») ACTUELLES	Marges requises sur transactions appariées (« spreads ») MISES À JOUR
BAX	145\$	145\$

Marges sur transactions « Butterfly »

Symbole des contrats	Marge requise sur transactions « Butterfly » consécutives ACTUELLE	Marge requise sur transactions « Butterfly » consécutives MISE À JOUR
BAX	150\$	150\$

Symbole des contrats	Marge requise sur transactions « Butterfly » non consécutives ACTUELLE	Marge requise sur transactions « Butterfly » non consécutives MISE À JOUR
BAX	187\$	187\$

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés

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

800, square Victoria
3^{ème} étage
Montréal (Québec)
H4Z 1A9
Tél. : 514-871-3545
Télé. : 514-871-3530

www.cdcc.ca



Marges sur transactions appariées entre groupes combinés (« Inter-commodity Spreads »)

Symbole des contrats	Taux de réduction de la marge requise sur transactions appariées entre groupes combinés ACTUEL	Taux de réduction de la marge requise sur transactions appariées entre groupes combinés MIS À JOUR
CGB - CGZ	35%	35%

Pour toute information complémentaire, veuillez communiquer avec le Département de Gestion des Risques au (514) 871-4949 poste 505.

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