



## AVIS AUX MEMBRES

N° 2012 - 232

Le 4 décembre 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 5 décembre 2012.

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**

Exchange Tower	Tour de la Bourse
130 rue King Ouest, 5ième étage	800, Square Victoria, 3ième étage
Toronto, Ontario	Montréal, Québec
M5X 1J2	H4Z 1A9
Tél. : 416-367-2463	Tél. : 514-871-3545
Télec. : 416-367-2473	Télec. : 514-871-3530

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