

AVIS AUX MEMBRES

No. 2019 – 141

Le 31 Décembre 2019

MISE À JOUR DU PARAMÈTRE DE RISQUE VALEUR MINIMALE DE LA POSITION VENDEUR SUR OPTIONS

La CDCC effectue une révision annuelle de son paramètre de risque valeur minimale de la position vendeur sur options applicable sur les positions de vente sur options.

Suite à cette révision, la CDCC a déterminé que la valeur de ce paramètre restera la même pour les différents groupes d'options.

Pour toute information supplémentaire, veuillez contacter le service de la gestion des risques au (514) 871-3505.

Anne Fiddes
Vice-présidente, Opérations intégrées de la CDCC

Valeur Minimale de la Position Vendeur sur Options (PVMO):

| | Options sur Contrats à Terme sur Acceptations Bancaires canadiennes de Trois Mois | Options sur Actions | Options sur Contrats à Terme sur Obligations du Gouvernement du Canada de Dix Ans | Options sur le Dollar US | Options sur Indices |
|-------------|---|---------------------|---|--------------------------|---------------------|
| PVMO | 5% | 6% | 6% | 6% | 6% |