

AVIS AUX MEMBRES

No. 2021 – 034

Le 25 février 2021

Modification de l'application de l'exigence de marge supplémentaire pour le risque de liquidité Méthode double temporaire d'établissement de la taille du fonds de compensation

Comme suite à l'avis [2020-088](#) daté du 26 juin 2020 (l'« avis »), la Corporation canadienne de compensation de produits dérivés (la « CDCC ») souhaite aviser les membres compensateurs qu'elle changera, à compter du **1er mars 2021**, la méthode d'application de l'exigence supplémentaire relative au fonds de compensation mise en œuvre le **2 Juillet 2020**. Elle appliquera cette exigence au prorata des positions exposées au risque de liquidité non couvertes moyennes de chaque membre compensateur.

Cette modification améliorera l'application de l'exigence supplémentaire relative au fonds de compensation, puisqu'elle sera fondée sur le profil de risque de liquidité de chaque membre compensateur.

Pour clarification, il convient de noter que la méthode d'établissement de la taille de l'exigence supplémentaire relative au fonds de compensation ne change pas. Le montant requis par la CDCC figurant sur les relevés de dépôt au fonds de compensation des membres compensateurs englobe toujours toute exigence de fonds de compensation supplémentaire.

Pour obtenir de plus amples renseignements, veuillez communiquer avec le Service de gestion des risques au 514 871-3505.

Anne Fiddes
Vice-présidente, Opérations intégrées de la CDCC