

AVIS AUX MEMBRES

No 2022 – 034

Le 14 mars 2022

MODIFICATIONS DES RAPPORTS pour les contrats à terme sur indice

La CDCC souhaite informer ses membres compensateurs de modifications apportées au rapport MT99 – Detailed Fut Consolidated Activity Report (rapport d'activité consolidé détaillé sur les contrats à terme) et au rapport MT66 – Futures Sub-Account Consolidated Activity Report (rapport d'activité consolidé sur les contrats à terme des comptes auxiliaires). À compter du **vendredi 18 mars 2022**, à l'échéance, les contrats à terme sur indice feront l'objet de rapports similaires aux rapports sur d'autres produits dont le règlement est effectué en espèces.

Relevé des livraisons et assignations

Pour les contrats à terme sur indice, les rapports ne comprendront plus une section « *Future Final Settlement* » (*règlement final des contrats*).

Par conséquent, le calcul de l'évaluation à la valeur de marché sera inclus dans Gain/Loss/Premium (gain/perte/prime). Ce calcul utilisera le prix de clôture de la veille, qui s'affiche sous le *PRV/TRD Price*, contre le Final Opening Level Price (prix du niveau d'ouverture final), qui s'affiche sous le *Settlement Price* (*prix de règlement*).

Opération manquée ou transfert de position

Le PRV/TRD Price continuera d'afficher le prix saisi par le membre compensateur.

Le calcul de gain/perte/prime utilisera le Final Opening Level Price, qui s'affiche sous le *Settlement Price*, au lieu du prix de clôture de la veille.

Il n'y a aucune incidence sur les valeurs de gain/perte/prime affichées dans les rapports.

Veuillez vous reporter à l'exemplaire actuel et à l'exemplaire révisé du rapport d'activité consolidé détaillé sur les contrats à terme. Si vous avez des questions ou des commentaires, veuillez communiquer avec la Division des opérations intégrées de la CDCC ou écrire à cdcc-ops@tmx.com.

Anne Fiddes
Vice-présidente, Opérations intégrées

Version actuelle du rapport

Firm:		Detailed Fut. Consolidated Activity Rpt. RP-MT99										21:59:58 Page	
Acct:		Canadian Derivatives Clearing											
Currency: CANADIAN DOLLARS		Trade Date:											
Last	Open Position				Opp		Prv/Trd	Settlement		Gain/Loss/Premium	Trader/	Seq #	
Activity	Long	Short	Mkt	O/C	Mbr	Contract	Price	Price		Debit	Credit	REC #	Time Seq
SXF	21DC17												
	16DEC21	23					1,261.100	1,261.100					
	Future Final Settlement						1,261.100	1,244.680		75532.00			
	AUTO-EX									75532.00*			

Version révisée du rapport

Firm:		Detailed Fut. Consolidated Activity Rpt. RP-MT99										4 MAR 22 15:04:59 Page	
Acct:		Canadian Derivatives Clearing											
Currency: CANADIAN DOLLARS		Trade Date: 18 MAR 22											
Last	Open Position				Opp		Prv/Trd	Settlement		Gain/Loss/Premium	Trader/	Seq #	
Activity	Long	Short	Mkt	O/C	Mbr	Contract	Price	Price		Debit	Credit	REC #	Time Seq
SXF	22MR18												
	17MAR22	12					1,200.000	1,195.000		12000.00			
	AUTO-EX									12000.00*			