

## AVIS AUX MEMBRES

No. 2023 – 109

Le 15 septembre 2023

### Journée nationale de la vérité et de la réconciliation – le 2 octobre 2023

Nous désirons rappeler aux membres compensateurs qu'en raison de la Journée nationale de la vérité et de la réconciliation, le lundi 2 octobre 2023, aucun règlement ne pourra être effectué à la CDCC ce jour-là.

Par conséquent, les montants des règlements dus à la CDCC devront être versés en dehors des jours habituels. Le paragraphe A-802 1) des règles de la CDCC indique ce qui suit :

« Au plus tard à l'heure de règlement du jour ouvrable que la Banque du Canada a déterminé être un jour de règlement, chaque membre compensateur est tenu de verser à la Société, par transfert irrévocable de fonds ou tout autre mode approuvé par la Société à l'occasion, le montant en espèces de tout règlement quotidien net payable à la Société, tel que l'indique le sommaire quotidien des règlements (malgré toute erreur figurant au relevé). »

Des montants distincts pour les opérations qui auront lieu le vendredi 29 septembre 2023 et le lundi 2 octobre 2023 devront être réglés avant 8 h 15 (heure de l'Est) le mardi 3 octobre 2023.

En raison du congé bancaire, les dates de règlement seront les suivantes :

Date de levée	Date de règlement
28 septembre 2023	3 octobre 2023
29 septembre 2023	4 octobre 2023
2 octobre 2023	4 octobre 2023
3 octobre 2023	5 octobre 2023

### **Marge supplémentaire pour le risque relatif à la Journée nationale de la vérité et de la réconciliation**

Conformément aux règles de la CDCC, la CDCC demandera, le vendredi 29 septembre 2023, une marge supplémentaire pour le risque relatif au jour férié bancaire. Cette marge, qui varie entre 23 % et 35 % de la plus récente marge initiale de base pour les options et les contrats à terme, figurera dans le rapport MS06 qui sera disponible le vendredi 29 septembre, après le premier traitement de lot intrajournalier (10 h 30, heure de l'Est). Conformément à la procédure habituelle, l'équipe des Activités d'exploitation de la CDCC enverra une notification à propos du déficit. Le montant devra être payé au complet une heure après ladite notification.

Avant la fin de la journée du mardi 3 octobre, cette exigence sera remise à zéro et l'intégralité du montant sera disponible aux fins de retrait le mercredi 4 octobre.

### **Redimensionnement du fonds de compensation**

Rappel : La CDCC effectuera le redimensionnement de la taille du fonds de compensation le lundi 2 octobre 2023, et tout déficit devra être couvert avant 10 h (heure de l'Est) le mardi 3 octobre 2023.

### **Fichier de déclaration des MBC**

Rappel : Les membres compensateurs qui prennent part aux marges brutes des clients (« MBC ») sont tenus de déposer leur fichier de déclaration des MBC à la fin des deux jours ouvrables du vendredi 29 septembre et du lundi 2 octobre 2023.

### **Échéance des contrats à terme sur le taux CORRA de septembre**

Les membres compensateurs sont priés de noter que les contrats à terme sur le taux CORRA de septembre (COA23P01) expireront le mardi 3 octobre au lieu du lundi 2 octobre.

Si vous avez des questions ou des commentaires au sujet de cet avis, n'hésitez pas à appeler la Division des opérations commerciales de la CDCC ou à envoyer un courriel à [cdcc-ops@tmx.com](mailto:cdcc-ops@tmx.com).

Anna Linardakis  
Directrice des activités d'exploitation  
CDCC