

AVIS AUX MEMBRES

N° 2021– 112

Le 19 juillet 2021

MODIFICATION DE LA DATE D'ÉCHÉANCE, DU DERNIER JOUR DE NÉGOCIATION, DU DERNIER JOUR DE DÉCLARATION ET DU DERNIER JOUR DE SOUMISSION DES CONTRATS À TERME SUR OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA À LA CDCC

La Corporation canadienne de compensation de produits dérivés (la « CDCC ») souhaite informer les membres compensateurs que, par suite de la publication de l'[Avis aux membres 101-21](#) concernant la fermeture du marché des dérivés sur taux d'intérêt le 30 septembre 2021, elle procédera à la modification **du dernier jour de négociation, de la date d'échéance, de la dernière date de soumission et de la dernière date de déclaration** pour l'ensemble des **contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada**. Les modifications des dates importantes pour le mois de livraison de septembre 2021 des contrats à terme sur obligations de 2 ans (CGZ), 5 ans (CGF), 10 ans (CGB) et 30 ans (LGB) sont indiquées dans le tableau ci-dessous. Les modifications prendront effet à la fin de la journée le 3 août.

	Dates actuelles pour la livraison de septembre 2021 (annoncées avant la déclaration du jour férié)	Nouvelles dates pour le mois de livraison de septembre 2021 (engendrées par le nouveau jour férié)
Date d'échéance	28 septembre	27 septembre
Date indiquée dans le symbole	21 septembre	21 septembre
Dernier jour de négociation	21 septembre	20 septembre

Premier jour de soumission	30 août	30 août
Dernier jour de soumission	28 septembre	27 septembre
Premier jour de déclaration	23 août	23 août
Dernier jour de déclaration	28 septembre	27 septembre

Incidence sur le fil de données FIXML et le fichier de fin de journée FIXML :

Le bloc *Instrmt* (étiquette 200) pour le champ MMY comportera une valeur mise à jour après la modification pour les opérations du jour suivant.

Incidence sur les fichiers Tag Log de fin de journée :

Les fichiers tlg globaux comprenant la définition de tous les instruments (EodFilesGlobal.tlg) seront mis à jour pour faire état des modifications des dates le jour suivant la mise à jour des contrats. Les champs suivants sont inclus (numéro d'étiquette) : LastDeclarationDate (1534), LastTenderDate (1535), LastTradeDate (1082) et DerivativeExpiryDate (433)

Incidence sur la grille de risque :

Les documents de type B sont mis à jour pour faire état des nouvelles dates d'échéance pour les champs « Expiration Date » (fourchette de 92 à 99) et « Time to Expiration » (fourchette de 73 à 99).

Incidence sur le fichier de service de date :

La date d'échéance des instruments de contrats à terme touchés sera rajustée en raison de cette modification.

Incidence sur la marge :

Marge supplémentaire pour le risque relatif au jour férié bancaire

Par suite de l'[Avis aux membres 101-21](#), la CDCC souhaite informer les membres compensateurs que le nouveau jour férié fédéral, soit la Journée nationale de la vérité et de la réconciliation (observée le 30 septembre de chaque année), est un congé bancaire.



Conformément aux Règles de la CDCC, les membres compensateurs seront tenus de verser un montant de marge supplémentaire pour couvrir le risque lié au congé bancaire.

Les renseignements concernant l'activation de la marge supplémentaire liée au congé bancaire seront communiqués dans une annonce envoyée à l'approche de la date en question.

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, CDCC