

AVIS AUX MEMBRES

No. 2021 – 118

le 27 juillet 2021

MISE-À-JOUR DE LA LISTE DES FICHIERS DE SOURCE DE DONNÉES IMPACTÉES PAR LA 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

Suite à la publication des avis aux membres [101-21](#) et [112-21](#), et plus particulièrement en ce qui concerne les impacts spécifiques liées aux divers fichiers de source de données de La Corporation canadienne de compensation de produits dérivés (la « CDCC »), la CDCC souhaite informer les membres compensateurs des modifications suivantes:

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

Suite à une revue plus approfondie des impacts, le bloc *Instrmt* (étiquette 200) NE SERA PAS impacté par les ajustements effectués sur la date d'expiration. Le fil de données FIXML utilise la valeur du champ 'DateForSymbol' et non la valeur 'ExpiryDate' pour l'instrument. Ainsi, le champ MMY conservera sa même valeur, et ce, même après les changements annoncés.

Incidence sur le fichier de service de date :

L'avis aux membres [112-21](#) mentionne que le fichier de service de date serait impacté dans la mesure où nous observerons des changements aux dates d'échéance des instruments de contrats à terme. Suite à d'autres essais, nous avons remarqué le contraire - qu'il n'y aura aucune incidence sur le fichier de service de date, puisque nos recherches ont démontré que les dates d'expiration contenues dans les définitions des instruments de contrats à termes contiennent seulement l'année et le mois. Ainsi, aucun impact sur les fichiers de service de dates.

Tel que confirmé dans l'avis [112-21](#), les changements affecteront toujours les fichiers suivantes:

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 (effectif le 3 août, 2021). 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).

Des exemples de fichiers test reflétant les résultats de ces changements sont disponibles sur demande pour les membres compensateurs (ou leurs fournisseurs) afin de tester leurs systèmes avant l'implémentation de ces changements, prévue pour le vendredi, 30 juillet 2021.

Si vous souhaitez obtenir une copie du fichier test pour les Tag Log de fin de journée, ou bien une copie du fichier test de la grille de risque, veuillez SVP envoyer une demande par courriel au cdcc-cs@tmx.com.

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 de la CDCC