

AVIS AUX MEMBRES

No. 2023 – 127

Le 26 octobre 2023

Congé bancaire du 13 novembre 2023

Nous désirons rappeler aux membres qu'en raison du congé bancaire, le lundi 13 novembre 2023, aucun règlement ne pourra être effectué à la CDCC.

Étant donné le congé férié pour les banques, les montants des règlements dus à la CDCC devront être versés en dehors des jours habituels. L'article A-802 (1) des règles de la CDCC indique que :

« 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 séparés pour les négociations qui auront lieu le vendredi 10 novembre 2023 et le lundi 13 novembre 2023 devront être réglés avant 7h45 (heure de l'Est) le mardi 14 novembre 2023.

Dû au congé bancaire les dates de règlement seront les suivantes :

Date de levée	Date de règlement
Novembre 9, 2023	Novembre 14, 2023
Novembre 10, 2023	Novembre 15, 2023
Novembre 13, 2023	Novembre 15, 2023
Novembre 14, 2023	Novembre 16, 2023
	J+1
November 10, 2023	November 14, 2023
November 13, 2023	November 14, 2023

Marge supplémentaire pour le risque relatif au jour férié bancaire :

Le vendredi 10 Novembre 2023, conformément aux règles de la CDCC, CDCC demandera une marge supplémentaire pour le risque relatif au jour férié bancaire. Cette marge, qui varie entre 24% et 35% de la plus récente marge initiale de base pour Futures et Options excluant les produits sur taux d'intérêts, apparaîtra dans le rapport MS06 disponible le vendredi 10 Novembre 2023 après le 2ème calcul de marge intra journalier (10:30 HE). Conformément à la procédure

habituelle, CDCC OPS enverra une notification pour le déficit et le montant devra être payé au complet une heure après la réception de la notification.

Le lundi 13 Novembre 2023 avant le calcul de marge de fin de journée, la marge supplémentaire pour le risque relatif au jour férié bancaire sera remise à zéro et le montant au complet sera disponible pour le retrait le mardi 14 novembre 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 10 novembre et du lundi 13 novembre 2023.

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.

Anna Linardakis
Directrice, Activités commerciales
CDCC