

AVIS AUX MEMBRES

No. 2022 – 132

Le 28 octobre 2022

Congé bancaire du 11 novembre 2022

Nous désirons rappeler aux membres qu'en raison du congé bancaire, le vendredi 11 novembre 2022, 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 jeudi 10 novembre 2022 et le vendredi 11 novembre 2022 devront être réglés avant 7h45 (heure de l'Est) le lundi 14 novembre 2022.

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

Date de levée	Date de règlement
	J+2
November 9, 2022	November 14, 2022
November 10, 2022	November 15, 2022
November 11, 2022	November 15, 2022
November 14, 2022	November 16, 2022
	J+1
November 10, 2022	November 14, 2022
November 11, 2022	November 14, 2022

Marge supplémentaire pour le risque relatif au jour férié bancaire:

Le Jeudi 10 Novembre 2022, 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 Jeudi 10 Novembre 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 Vendredi 11 Novembre 2022 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 Lundi 14 Novembre 2022.

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

Anna Linardakis
Directrice, Activités commerciales
CDCC