

AVIS AUX MEMBRES

No. 2021 – 157

Le 28 octobre 2021

Congé bancaire du 11 novembre 2021

Nous désirons rappeler aux membres qu'en raison du congé bancaire, le jeudi 11 novembre 2021, 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 mercredi 10 novembre 2021 et le jeudi 11 novembre 2021 devront être réglés avant 7h45 (heure de l'Est) le vendredi 12 novembre 2021.

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

Date de levée	Date de règlement
	J+2
November 9, 2021	November 12, 2021
November 10, 2021	November 15, 2021
November 11, 2021	November 15, 2021
November 12, 2021	November 16, 2021
	J+1
November 10, 2021	November 12, 2021
November 11, 2021	November 12, 2021

Marge supplémentaire pour le risque relatif au jour férié bancaire:

Le Mercredi 10 Novembre 2021, conformément aux règles de la CDCC, CDCC demandera 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 Futures et Options excluant les produits sur taux d'intérêts, apparaîtra dans le rapport MS06 disponible le Mercredi 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 Jeudi 11 Novembre 2021 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 Vendredi 12 Novembre 2021.

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.

Anne Fiddes
Vice-présidente, Opérations intégrées de la CDCC