

Avis technique 18-005

Rapport d'incident de 27 avril 2018

Date de l'incident : 27 avril 2018

Résumé de l'incident :

À 13 h 37, une alerte interne a été lancée signalant que l'accès en ligne à certaines composantes des opérations boursières n'était plus disponible.

À 13 h 40, nous avons reçu plusieurs appels de participants externes signalant qu'ils ne recevaient plus de confirmations d'ordres.

À 13 h 41, nous avons reçu plusieurs appels de fournisseurs d'accès signalant qu'ils avaient perdu la connexion à la saisie des ordres.

La gestion interne de l'incident a été initiée et une communication externe a été diffusée.

Durant cette période, les participants externes n'avaient aucun accès à la saisie d'ordres pour tous les produits dérivés de la MX. De plus, aucune donnée de marché n'était diffusée.

Une enquête exhaustive a permis de déterminer la source du problème. Le processus de reprise et de réouverture aurait entraîné un délai dépassant l'heure normale de fermeture des marchés. À 14 h 50, une décision a été prise de ne pas redémarrer les systèmes et de maintenir fermées les activités de négociation pour le reste de la journée. Cette décision a fait l'objet d'un communiqué à l'intention de nos participants au marché.

À 16 h 55, nous avons diffusé un avis précisant nos critères pour l'établissement des prix de

règlement.

Tous les ordres ouverts (à l'exception des ordres d'un jour ou VDD expirés) demeureront dans le registre central des ordres à cours limité (RCOCL).

Services touchés :

Saisie d'ordres FIX et SAIL pour tous les produits dérivés

HSVF et OBF (fil de données du registre des ordres)

LOPR

TMS

API de compensation

Analyse du problème :

Un appareil de stockage central a subi une défaillance matérielle liée à l'une de ses composantes de gestion des communications. Cet appareil comporte un dispositif de redondance intégré; cependant, au moment de la défaillance matérielle, le module redondant de gestion des communications n'a pas été en mesure de prendre en charge le rôle de système primaire, empêchant ainsi l'initiation de la procédure de basculement. Par conséquent, l'accès en ligne à l'ensemble des systèmes de stockage a été coupé pour toutes les applications de négociation qui dépendent de l'appareil de stockage central.

Nous confirmons que cet incident n'est pas le résultat d'une cyberattaque ni de tout autre incident lié à un changement technologique.

Solutions :

1. Le module de stockage de la gestion des communications a été remplacé et l'état normal de l'ensemble des systèmes de stockage centralisés a été confirmé.
2. L'accès en ligne a été rétabli pour toutes les applications qui dépendent de l'appareil de stockage central.
3. Les vérifications relatives à l'intégrité des données ont été effectuées.
4. La validation du démarrage de toute l'entreprise de négociation a été effectuée le samedi 28 avril et aucun problème n'a été signalé.
5. Les systèmes sont prêts pour l'ouverture des marchés le lundi 30 avril. Tous les instruments dérivés seront disponibles pour les activités de négociation aux heures normales d'ouverture des marchés.

6. **En ce qui concerne la résolution permanente du problème touchant la procédure de basculement, notre fournisseur d'appareils de stockage a identifié la cause fondamentale de l'incident et nous fournira un correctif au cours des prochains jours.**
7. **Entre-temps, nous avons pris les mesures nécessaires pour s'assurer du bon fonctionnement de nos marchés.**

Le personnel du Service des opérations de marché sera sur place à 5 h 30 le lundi 30 avril 2018 pour aider les participants agréés (PA) relativement à la gestion des ordres et à l'exécution des opérations. Pour obtenir de l'aide sur les points susmentionnés, veuillez communiquer avec le Service des opérations de marché au 514-871-7871.

Le personnel Centre d'assistance technique sera également présent à 5 h 30 le lundi 30 avril 2018. Les participants agréés qui ont besoin d'aide technique peuvent communiquer avec le Centre d'assistance technique au 514-871-7872.

Passerelles :

Horaire des passerelles pour le lundi 30 avril :

Passerelle pour la saisie d'ordres (SAIL et FIX) : 04:30

TMS et TMS Historique : 02:00

API de compensation : 02:05

LOPR : 01:00

SAIL Drop Copy : 04:30

HSVF et OBF 01:10

ATR 02:00

Ordres en cours :

Tous les ordres valables jusqu'à révocation (VAR) et les Ordres valables jusqu'à une date donnée (VDD) admissibles inscrits au registre des ordres le vendredi 27 avril 2018 seront disponibles le lundi 30 avril 2018.

LOPR

Tous les participants agréés peuvent soumettre leurs positions le lundi 30 avril 2018 jusqu'à 9 h.

CDCC

Les services de la CDCC ne sont pas touchés par cet incident. Les processus de compensation de fin de journée et le traitement des échéances de vendredi ont été effectués. Les prix de règlement ont été déterminés comme suit :

Contrats à terme :

La Bourse de Montréal (MX) a établi des prix de règlement pour tous les contrats à terme utilisant l'heure de référence de 13 h 30.

Dans le cas des contrats à terme BAX, l'algorithme de règlement automatisé a utilisé l'heure de référence de 13 h 30, par conséquent, a utilisé toutes les données disponibles sur les opérations et les ordres trois (3) minutes avant 13 h 30 afin d'établir le prix de règlement relativement à chaque échéance du BAX.

Pour tous les autres contrats à terme, un cours moyen pondéré a été calculé en fonction des données sur les opérations disponibles une (1) minute avant l'heure de référence de 13 h 30.

Pour toutes les options de contrat à terme, les prix de règlement des contrats à terme BAX ont servi au calcul d'une valeur théorique d'après un modèle d'établissement des prix des options.

Options :

La Bourse de Montréal (MX) a établi des cours de référence de fin de journée pour tous les contrats d'options sur actions, FNB et indice utilisant les cours de référence de fin de journée du jour précédent les (26 avril 2018).

Les cours sous-jacents pour les contrats d'options venant à échéance ont été établis en fonction des cours de clôture du marché de la TSX.

Pour toute question ou toute demande de renseignement, veuillez communiquer avec le Centre d'assistance technique.

Cordialement,

Centre d'assistance technique

Numéro sans frais : 1 877 588-8489

Téléphone : 514 871-7872

Courriel : samsupport@tmx.com