

Contrat à terme 30 jours sur le taux «repo» à un jour

Caractéristiques

Unité de négociation	Chaque contrat correspond à une valeur nominale de 5 000 000 \$ CA.
Mois d'échéance	Les quatre mois de calendrier les plus rapprochés.
Cotation des prix	Indice : 100 moins la moyenne mensuelle du taux « repo » à un jour pour le mois d'échéance.
Dernier jour de négociation	Dernier jour ouvrable du mois d'échéance.
Type de contrat	Règlement en numéraire.
Unité de fluctuation minimale des prix	0,005 = 20,55 \$ CA (un demi de 1/100 de un pour cent de 5 000 000 \$ CA sur une base de 30 jours).
Seuil de déclaration	300 contrats.
Limites de position	Les renseignements sur les limites de position sont disponibles à la Bourse, étant donné qu'elles sont sujettes à des changements périodiques.
Prix de règlement final	Le contrat est réglé en numéraire basé sur la moyenne mensuelle du taux «repo» quotidien à un jour pour le mois d'échéance. Le taux «repo» à un jour (CORRA) est calculé et rapporté par la Banque du Canada. La moyenne mensuelle est une moyenne arithmétique simple correspondant à la somme des taux quotidiens « repo » à un jour divisée par le nombre de jours du calendrier du mois. Le taux correspondant aux jours de fin de semaine et aux jours fériés est celui du jour ouvrable précédent. Par exemple, le taux du vendredi est utilisé comme taux du samedi et du dimanche. Le prix de règlement final est déterminé le premier jour ouvrable suivant le dernier jour de négociation.
Marges minimales requises	Les renseignements sur les marges minimales requises sont disponibles à la Bourse, étant donné qu'elles sont sujettes à des changements périodiques.
Limite quotidienne de variation des cours	Aucune.
Heures de négociation	8 h à 15 h (HNE/HAE).
Chambre de compensation	Corporation canadienne de compensation de produits dérivés (CCCPD).
Symbole au téléscripteur	ONX.

Contrat à terme sur acceptations bancaires canadiennes de trois mois

Caractéristiques

Unité de négociation	1 000 000 \$ CA de valeur nominale d'acceptations bancaires canadiennes de trois mois.
Mois d'échéance	Trimestriellement : mars, juin, septembre et décembre. Échéance rapprochée : deux (2) mois les plus près non trimestriels.
Cotation des prix	Indice : 100 moins le taux de rendement annualisé d'une acceptation bancaire canadienne de trois mois.
Dernier jour de négociation	La négociation se termine à 10 h (HE) le 2 ^e jour ouvrable bancaire de Londres (Grande-Bretagne), précédant le 3 ^e mercredi du mois d'échéance. Si le jour fixé est un jour férié pour la Bourse ou pour les banques à Montréal ou à Toronto, la négociation se terminera le jour ouvrable bancaire précédent.
Type de contrat	Règlement en numéraire.
Unité de fluctuation minimale des prix	0,005 = 12.50 \$ CA par contrat pour le mois d'échéance immédiat. La négociation à un demi-point de base est en vigueur pour le mois d'échéance immédiat dès que le contrat du mois précédent vient à échéance. 0.01 = 25 \$ CA par contrat pour tout autre mois d'échéance.
Seuil de déclaration	300 contrats.
Limites de position	Les renseignements sur les limites de position sont disponibles à la Bourse, étant donné qu'elles sont sujettes à des changements périodiques.
Prix de règlement final	Basé sur la moyenne des taux offerts pour les acceptations bancaires de trois mois, tels que disponibles au dernier jour de négociation à 10 h 15 (HE) sur la page CDOR du Service Monitor de Reuters, excluant la cotation extrême de chaque côté.
Marges minimales requises	Les renseignements sur la marge minimale par contrat sont disponibles à la Bourse, étant donné qu'elle est sujette à des changements périodiques.
Limite quotidienne de variation des cours	De 2 h à 7 h 30 : 36 points par contrat à la hausse ou à la baisse par rapport au prix de règlement de la journée précédente. Le calcul est basé sur un pourcentage du risque établi par la chambre de compensation et sur la marge requise, lesquels peuvent être sujets à des changements périodiques. De 8 h à 15 h : aucune.
Heures de négociation	2 h à 7 h 30 (HNE) et 8 h à 15 h. (HNE).
Chambre de compensation	Corporation canadienne de compensation de produits dérivés (CCCPD).
Symbole au téléscripteur	BAX

Option sur contrat à terme sur acceptations bancaires canadiennes de trois mois

Caractéristiques

Unité de négociation	Un contrat à terme sur acceptations bancaires canadiennes de trois mois (BAX).
Mois d'échéance	Quatre (4) mois les plus rapprochés dans le cycle trimestriel du BAX (mars, juin, septembre et décembre).
Cotation des prix	Cotés en point où chaque 0,01 point (1 point de base) représente 25 \$ CA. Par exemple, un prix coté de 0,465 représente une prime d'option totale de 1 162,50 \$ CA (c.-à-d. 46,5 points de base × 25 \$ CA).
Dernier jour de négociation	La négociation se termine à 10 h (HE) le 2 ^e jour ouvrable bancaire de Londres (Grande-Bretagne), précédant le 3 ^e mercredi du mois d'échéance. Si le jour fixé est un jour férié pour la Bourse ou pour les banques à Montréal ou à Toronto, la négociation se terminera le jour ouvrable bancaire précédent.
Type de contrat	Style américain.
Unité de fluctuation minimale de la prime	0,005 = 12,50 \$ CA par contrat.
Seuil de déclaration	300 contrats d'options ou le nombre équivalent en contrats à terme. Aux fins du calcul de ce seuil, les positions d'options sont combinées avec les positions portant sur le contrat à terme sous-jacent. À cette fin, un contrat d'option «en dedans» équivaut à un contrat à terme et un contrat d'option «au milieu» ou «en dehors» équivaut à un demi-contrat à terme.
Limites de position	Les renseignements sur les limites de position sont disponibles à la Bourse, étant donné qu'elles sont sujettes à des changements périodiques.
Prix de levée	Intervalle minimal de 0,125 point.
Marges minimales par contrat	Les renseignements sur les marges minimales requises sont disponibles à la Bourse, étant donné qu'elles sont sujettes à des changements périodiques.
Limite quotidienne de variation des cours	Aucune.
Heures de négociation	8 h à 15 h (HNE/HAE).
Chambre de compensation	Corporation canadienne de compensation de produits dérivés (CCCPD).
Symbole au téléscripteur	OBX.

2002.10.15

