

AVIS AUX MEMBRES

No. 2023 – 011

Le 19 janvier 2023

Rappel – Inscription à la cote du contrat à terme d'un mois sur le taux CORRA

Faisant suite à l'avis informationnel A23-001, Bourse de Montréal inc. (la « Bourse ») et la Corporation canadienne de compensation de produits dérivés (la « CDCC ») désirent rappeler aux membres compensateurs l'inscription à la cote du nouveau contrat à terme d'un mois sur le taux CORRA (« COA ») le lundi 23 janvier 2023.

La Bourse inscrira les quatre mois d'échéance les plus rapprochés, de même que les stratégies intragroupes (écarts, strips, etc.) et intergroupes visant le contrat à terme de trois mois sur le taux CORRA (« CRA »). L'heure d'ouverture pour le contrat COA et les stratégies de négociation connexes sera fixée à 2 h (HE), comme pour les autres contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme de la Bourse (BAX et CRA). Des précisions complémentaires figurent dans l'avis informationnel A23-001.

Veuillez trouver ci-dessous l'intervalle de marge pour les quatre mois d'échéance les plus rapprochés.

Intervalle de marge	
Niveau 1 – COA	1,00 %

Pour obtenir de plus amples renseignements, les membres compensateurs sont priés de communiquer avec la Division des opérations intégrées de la CDCC ou d'écrire directement à cdcc-ops@tmx.com

Anna Linardakis
Directrice, Activités commerciales
CDCC