

L'information suivante est destinée à l'usage des membres de la Corporation Canadienne de Compensation de Produits Dérivés (« la CDCC ») et des participants agréés de Bourse de Montréal Inc. (la « Bourse »). Ce document est un sommaire officieux des conditions du rajustement. La CDCC et la Bourse n'assument aucune responsabilité quant à l'exactitude de ce sommaire. Les membres de la CDCC et les participants agréés de la Bourse doivent s'assurer d'avoir pris connaissance de la documentation publiée par les émetteurs concernés par cette transaction.



AVIS AUX MEMBRES

No. 2023 – 026

Le 17 février 2023

RAJUSTEMENT DE CONTRAT FINAL FNB BetaPro Gaz Naturel Haussier Quotidien Avec Effet De Levier (HNU) Regroupement d'actions

La Bourse et la CDCC désirent vous informer que « FNB BetaPro Gaz Naturel Haussier Quotidien Avec Effet De Levier » (TSX: « HNU ») va consolider ses actions ordinaires en circulation.

Le regroupement d'actions sur un ratio de un pour quinze sera effectif à l'ouverture des marchés le 21 février 2023.

À l'ouverture des marchés le 21 février 2023, la société va transiger sous le nouveau CUSIP.

CDCC - Détails du rajustement:

Conformément aux modalités de rajustements énoncées à l'article A-902 des règles de CDCC, toutes les options sur HNU seront rajustées comme suit:

- **DATE PRÉVUE D'ENTRÉE EN VIGUEUR :** 21 février 2023
- **SYMBOLES DES OPTIONS:** HNU deviendra HNU1
- **NOMBRE DE CONTRATS :** Inchangé
- **MULTIPLICATEUR :** 100
- **NOUVEAU LIVRABLE PAR CONTRAT:** 6 actions ordinaires de FNB BetaPro Gaz Naturel Haussier Quotidien Avec Effet De Levier (HNU) et une considération en espèces équivalente à 0.6666 (100 x 0.006666) d'un action de HNU. Le montant sera confirmé dans le cadre d'une nouvelle circulaire.

- **PRIX DE LEVÉE :** Inchangé
- **NOUVEAU CUSIP :** 086637 20 4
- **LIMITES DE POSITION ET DE LEVÉE POUR HNU1:** Les limites de position et de levée resteront inchangés à 250,000 contrats

La CDCC n'effectuera pas de rajustement sur les récépissés d'entiercement en dépôt.

La Bourse - Détails du rajustement:

Il est important de noter qu'à la date d'entrée en vigueur mentionnée ci-dessus, les ordres ouverts pour cette classe d'options **ne seront pas modifiés automatiquement** pour refléter le regroupement d'action et devront donc **être réenregistrés** dans le Système Automatisé de Montréal (SAM) par les participants agréés.

Les séries existantes de la classe d'options HNU seront transférées à la classe d'options HNU1 qui constitue le nouveau livrable.

Symbole de la classe actuel	Nouveau symbole de la classe
HNU	HNU1

Veuillez prendre note que seulement les transactions de clôture seront permises sur la classe d'options ajustée. Les séries qui n'ont pas d'intérêt en cours ne seront pas ajustées.

Exemple Numérique - HNU (HNU1)

Pour un membre détenant une position longue sur un put dont le prix de levée est 3,00\$ et considérant que le prix de fermeture de HNU du 16 février 2023 est de 1,81\$, la valeur intrinsèque de cette option avant

l'ajustement sera :

$$\text{Valeur Intrinsèque} = 3,00\$ \times 100 - 1,81\$ \times 100$$

$$= 119,00\$$$

Après l'ajustement, la valeur intrinsèque de cette option sera:

$$\text{Valeur Intrinsèque} = \text{Prix de levée} \times \text{Multiplicateur} - \text{Nouveau prix du sous-jacent} \times \text{Nouveau livrable}$$

$$= 3,00\$ \times 100 - 27,15\$ \times (100/15)$$

$$= 119,00\$$$



VEUILLEZ VOUS ASSURER QUE TOUS LES CLIENTS QUI SONT EN POSITION ACHETEUR OU EN POSITION VENDEUR DANS CETTE CLASSE D'OPTIONS SOIENT INFORMÉS DU PRÉSENT AVIS.

Pour de plus amples informations, veuillez communiquer avec le département des opérations de marché au 514 871-7877. Les membres de la CDCC peuvent communiquer avec la division des opérations intégrées de la CDCC.

Anna Linardakis
Directrice, Activités commerciales
CDCC