

AVIS AUX MEMBRES

No. 2022 – 152

Le 1 décembre 2022

Modification du dernier jour de négociation des contrats à terme sur acceptations bancaires canadiennes de trois mois (BAX)

En application de la circulaire [A22-017](#), Bourse de Montréal Inc. (la « Bourse ») et la Corporation canadienne de compensation de produits dérivés (la « CDCC ») souhaitent informer les membres compensateurs que la modification du dernier jour de négociation des contrats à terme sur acceptations bancaires canadiennes de trois mois (BAX) qui arriveront à échéance après juin 2024 prendra effet le 19 décembre 2022 après la clôture des marchés.

L'échéance des contrats BAX venant à échéance après juin 2024 passera du troisième lundi au troisième mercredi du mois d'échéance du contrat, rajustement qui permettra d'harmoniser leur période d'exposition avec celle des contrats à terme de trois mois sur le taux CORRA (« CRA ») équivalents.

Le tableau ci-dessous résume le rajustement de l'échéance des contrats BAX, qui prendra effet à la date susmentionnée (pour les contrats actuellement inscrits).

Contrats visés (actuellement inscrits)	Échéance actuelle (dernier jour de négociation)	Nouvelle échéance (dernier jour de négociation)	Symbole à la CDCC
BAXU24	16 septembre 2024	18 septembre 2024	BAX24SP16
BAXZ24	16 décembre 2024	18 décembre 2024	BAX24DC16
BAXH25	17 mars 2025	19 mars 2025	BAX25MR17
BAXM25	16 juin 2025	18 juin 2025	BAX25JN16
BAXU25	15 septembre 2025	17 septembre 2025	BAX25SP15

Les membres sont priés de noter que la date d'échéance change, mais pas les symboles à la CDCC correspondants. Par conséquent, ils doivent s'assurer que leurs systèmes se comportent toujours comme prévu.

Pour tout renseignement additionnel, 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