

AVIS AUX MEMBRES

No. 2018 – 063

Le 5 juin 2018

RAJUSTEMENT DE CONTRAT FINAL FNB BetaPro contrats à court terme S&P 500 VIX Haussier quotidien 2x (HVU) Retrait de la cote

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 LE OU LES ÉMETTEURS CONCERNÉ(S) PAR CETTE TRANSACTION.

La Bourse et la CDCC désirent apporter une mise-à-jour à propos de la Circulaire 086-18 et de l'Avis aux Membres No. 2018 – 062. Suite au retrait de la cote de FNB BetaPro contrats à court terme S&P 500 VIX Haussier quotidien 2x (HVU) à la fermeture de marché le 6 juin 2018, le nouveau livrable par contrat sera une considération en espèces équivalente à 100 actions de HVU (basé sur le prix de clôture de HVU du mercredi 6 juin 2018). La date d'entrée en vigueur sera le 7 juin 2018. Le montant sera confirmé sur une nouvelle circulaire.

FNB BetaPro contrats à court terme S&P 500 VIX Haussier quotidien 2x (HVU)

CDCC - Détails du rajustement :

Conformément aux modalités de rajustement énoncées à l'article A-902 des Règles de la CDCC, toutes les options sur actions de FNB BetaPro contrats à court terme S&P 500 VIX Haussier quotidien 2x seront rajustées comme suit :

- **DATE D'ENTRÉE EN VIGUEUR :** Le 7 juin 2018
- **SYMBOLE DES OPTIONS :** HVU3
- **NOMBRE DE CONTRATS :** Inchangé
- **MULTIPLICATEUR :** 100
- **NOUVEAU LIVRABLE PAR CONTRAT :** Une considération en espèces équivalente à 100 actions de HVU (basé sur le prix de clôture de HVU du

mercredi 6 juin 2018). Le montant sera confirmé sur une nouvelle circulaire.

- **PRIX DE LEVÉE :** Inchangés
- **LIMITES DE POSITION ET DE LEVÉE :** Les limites de position et de levée resteront inchangées à 250 000 contrats
- **CUSIP :** NOTACUSIP

La CDCC n'acceptera pas le dépôt de récépissés d'entiercement pour les séries ajustées.

Bourse de Montréal Inc. - 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 plan d'arrangement et devront donc **être réenregistrés** dans le Système Automatisé de Montréal (SAM) par les participants agréés.

Les séries existantes de la classe d'options FNB BetaPro contrats à court terme S&P 500 VIX Haussier quotidien 2x (HVU) seront négociées sous le nouveau symbole HVU3 pour représenter le nouveau livrable. Veillez prendre note que seulement les transactions de clôture seront permises sur la classe d'options. Les séries qui n'ont pas d'intérêt en cours seront retirées de la liste de négociation.

| FNB BetaPro contrats à court terme S&P 500 VIX Haussier quotidien 2x | | |
|---|-----------------------------|------------------------------|
| Prix de levée actuels | Symbole de la classe actuel | Nouveau symbole de la classe |
| 13,00 \$ | HVU | HVU3 |
| 14,00 \$ | HVU | HVU3 |
| 15,00 \$ | HVU | HVU3 |
| 16,00 \$ | HVU | HVU3 |
| 17,00 \$ | HVU | HVU3 |
| 18,00 \$ | HVU | HVU3 |
| 19,00 \$ | HVU | HVU3 |
| 20,00 \$ | HVU | HVU3 |
| 21,00 \$ | HVU | HVU3 |
| 22,00 \$ | HVU | HVU3 |

| FNB BetaPro contrats à court terme S&P 500 VIX Haussier quotidien 2x | | |
|---|-----------------------------------|------------------------------------|
| Prix de levée actuels | Symbole de la classe actuel | Nouveau symbole de la classe |
| 23,00 \$ | HVU | HVU3 |
| 24,00 \$ | HVU | HVU3 |
| 25,00 \$ | HVU | HVU3 |
| 26,00 \$ | HVU | HVU3 |
| 27,00 \$ | HVU | HVU3 |
| 28,00 \$ | HVU | HVU3 |
| 29,00 \$ | HVU | HVU3 |
| 30,00 \$ | HVU | HVU3 |
| 32,00 \$ | HVU | HVU3 |
| 34,00 \$ | HVU | HVU3 |
| 36,00 \$ | HVU | HVU3 |
| 38,00 \$ | HVU | HVU3 |
| 40,00 \$ | HVU | HVU3 |
| 42,00 \$ | HVU | HVU3 |
| 44,00 \$ | HVU | HVU3 |
| 46,00 \$ | HVU | HVU3 |

VEUILLEZ VOUS ASSURER QUE TOUS LES CLIENTS QUI SONT EN POSITION ACHETEUR OU EN POSITION VENDEUR DANS CES CLASSES 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.

Glenn Goucher
Président et chef de la compensation
CDCC