

OIS – CONTRATS À TERME SUR SWAP INDEXÉ À UN JOUR

Caractéristiques

Unité de négociation	Chaque contrat correspond à une valeur nominale de 5 000 000 \$ CAN.
Sous-jacent	Swap de taux d'intérêt fixe contre variable dans lequel un taux fixe est échangé contre un taux variable. Le taux variable est le taux repo à un jour composé quotidiennement (CORRA) sur la durée du mois d'échéance.
Mois d'échéance	Les mois d'échéance seront indiqués pour correspondre aux dates fixes prévues pour les annonces publiées par la Banque du Canada.
Cotation des prix	<p>Indice : 100 moins le taux repo à un jour composé quotidiennement (CORRA) pour le mois d'échéance Indice : 100 – R</p> <p>R = le taux repo à un jour composé quotidiennement (CORRA) pour le mois d'échéance. Il est calculé conformément à la formule suivante :</p> $R = \left[\prod_{i=1}^{j_0} \left(1 + \frac{TRJ_i \times n_i}{365} \right) - 1 \right] \times \frac{365}{j} \times 100$ <p>où:</p> <p>« j_0 », est le nombre de jours ouvrables dans la période de calcul;</p> <p>« i » est une série de nombres entiers de un à j_0, représentant chacun le jour ouvrable pertinent dans l'ordre chronologique à compter du premier jour ouvrable inclusivement de la période de calcul pertinente;</p> <p>TRJ_i = taux repo à un jour (CORRA) le $i^{\text{ème}}$ jour de la période de calcul (si le $i^{\text{ème}}$ jour n'est pas un jour ouvrable, le taux CORRA à un jour antérieur disponible est utilisé);</p> <p>« n_i » est le nombre de jours civils de la période de calcul pertinente durant lesquels le taux est TRJ_i;</p> <p>« j » est le nombre de jours civils de la période de calcul pertinente.</p>
Dernier jour de négociation	Le jour d'une date fixe pour les annonces de la Banque du Canada.
Type de contrat	Règlement en espèces.
Unité minimale de fluctuation des prix	<p>0,005 = 31,25 \$ CAN (un demi de 1/100 de un pour cent de 5 000 000 \$ CAN sur une base de 45,625/365 jours).</p> <p>0,001 = 6,25 \$ CAN (un dixième de 1/100 d'un pour cent de 5 000 000 \$ CAN sur une base de 45,625/365 jours)</p>

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. L'information sur les limites de position peut être obtenue de la Bourse puisque ces limites font l'objet de changements périodiques.
Prix de règlement final	<p>Le prix de règlement final est de 100 moins le taux repo à un jour composé quotidiennement (CORRA) sur la durée du mois d'échéance qui commence le jour qui suit la dernière date fixe prévue pour les annonces de la Banque du Canada jusqu'au jour de la prochaine date fixe pour les annonces de la Banque du Canada. Les taux des week-ends et jours fériés sont considérés être le taux applicable le jour ouvrable précédent à l'égard duquel un taux a été rapporté. Par exemple, le taux du vendredi est utilisé pour les taux des samedi et dimanche.</p> <p>Le taux repo à un jour quotidien (CORRA) est calculé et rapporté par la Banque du Canada.</p> <p>Le prix de règlement final est arrondi au 1/10 le plus proche d'un point de base (0,001). Dans le cas d'une fraction décimale qui se termine par 0,0005 ou plus, le prix de règlement final est arrondi au nombre supérieur.</p> <p>Le prix de règlement final est établi le premier jour ouvrable qui suit le dernier jour de négociation.</p>
Marge minimale par contrat requise	Les renseignements sur la marge minimale par contrat sont disponibles à la Bourse, étant donné qu'elle est sujette à des changements périodiques. L'information sur les marges minimales requises peut être obtenue de la Bourse puisque ces exigences font l'objet de changements périodiques.
Limite quotidienne de variation des cours	Aucune
Heures de négociation (Heure de Montréal)	<p>Session régulière : 6 h à 16 h</p> <p>Note : Lors des jours de fermeture hâtive, la session régulière se termine à 13 h 30.</p>
Chambre de compensation	Corporation canadienne de compensation de produits dérivés (CDCC).
Symbole boursier	OIS

OIS – CONTRATS À TERME SUR SWAP INDEXÉ À UN JOUR

Unité de négociation	Chaque contrat correspond à une valeur nominale de 5 000 000 \$ CAN.
Sous-jacent	Swap de taux d'intérêt fixe contre variable dans lequel un taux fixe est échangé contre un taux variable. Le taux variable est le taux repo à un jour composé quotidiennement (CORRA) sur la durée du mois d'échéance.
Mois d'échéance	Les mois d'échéance seront indiqués pour correspondre aux dates fixes prévues pour les annonces publiées par la Banque du Canada.
Cotation des prix	<p>Indice : 100 – R</p> <p>R = le taux repo à un jour composé quotidiennement (CORRA) pour le mois d'échéance. Il est calculé conformément à la formule suivante :</p> $R = \left[\prod_{i=1}^{j_0} \left(1 + \frac{TRJ_i \times n_i}{365} \right) - 1 \right] \times \frac{365}{j} \times 100$ <p>où:</p> <p>« j_0 », est le nombre de jours ouvrables dans la période de calcul;</p> <p>« i » est une série de nombres entiers de un à j_0, représentant chacun le jour ouvrable pertinent dans l'ordre chronologique à compter du premier jour ouvrable inclusivement de la période de calcul pertinente;</p> <p>TRJ_i = taux repo à un jour (CORRA) le $i^{\text{ème}}$ jour de la période de calcul (si le $i^{\text{ème}}$ jour n'est pas un jour ouvrable, le taux CORRA à un jour antérieur disponible est utilisé);</p> <p>« n_i » est le nombre de jours civils de la période de calcul pertinente durant lesquels le taux est TRJ_i;</p> <p>« j » est le nombre de jours civils de la période de calcul pertinente.</p>
Dernier jour de négociation	Le jour d'une date fixe pour les annonces de la Banque du Canada.
Type de contrat	Règlement en espèces.
Unité minimale de fluctuation des prix	0,005 = 31,25 \$ CAN (un demi de 1/100 de un pour cent de 5 000 000 \$ CAN sur une base de 45,625/365 jours).
Seuil de déclaration	300 contrats.

Limite 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	<p>Le prix de règlement final est de 100 moins le taux repo à un jour composé quotidiennement (CORRA) sur la durée du mois d'échéance qui commence le jour qui suit la dernière date fixe prévue pour les annonces de la Banque du Canada jusqu'au jour de la prochaine date fixe pour les annonces de la Banque du Canada. Les taux des week-ends et jours fériés sont considérés être le taux applicable le jour ouvrable précédent à l'égard duquel un taux a été rapporté. Par exemple, le taux du vendredi est utilisé pour les taux des samedi et dimanche.</p> <p>Le taux repo à un jour quotidien (CORRA) est calculé et rapporté par la Banque du Canada.</p> <p>Le prix de règlement final est arrondi au 1/10 le plus proche d'un point de base (0,001). Dans le cas d'une fraction décimale qui se termine par 0,0005 ou plus, le prix de règlement final est arrondi au nombre supérieur.</p> <p>Le prix de règlement final est établi le premier jour ouvrable qui suit le dernier jour de négociation.</p>
Marge minimale par contrat	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	Aucune
Heures de négociation (Heure de Montréal)	<p>Session régulière : 6 h à 16 h</p> <p>Note : Lors des jours de fermeture hâtive, la session régulière se termine à 13 h 30.</p>
Chambre de compensation	Corporation canadienne de compensation de produits dérivés (CDCC).
Symbole boursier	OIS