

Avis technique 21-008

Modification de la date d'échéance des contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada échéant en septembre 2021

Prenant effet le mardi 3 août 2021 et conformément à la [circulaire 131-21](#) et à l'[avis d'information A21-009](#), tous les contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada échéant en septembre 2021 (U21) auront désormais comme dernier jour de négociation et date d'échéance le lundi 20 septembre 2021. L'heure de la dernière négociation demeure inchangée à 13 h 0 min 0 s.

La modification s'appliquera également à toutes les stratégies comprenant une jambe de composante des contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada échéant en septembre 2021.

Les modifications susmentionnées n'auront aucune incidence sur les dates d'échéance des options sur contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada respectives.

Les dates d'échéance de tous les contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada échéant en septembre 2021 doivent être modifiées pour se conformer à la Journée nationale de la vérité et de la réconciliation qui sera observée le 30 septembre 2021, puisque les dates d'échéance des contrats à terme sur obligations sont liées au dernier jour ouvrable du mois de livraison.

Résumé des modifications en date du 3 août 2021

Stratégie ou contrat à terme sur obligations	Code de stratégie	Jour et heure de la dernière négociation	Date d'échéance
CGZU21		Lundi 20 septembre 2021 à 13 h 0 min 0 s (HE)	Lundi 20 septembre 2021
CGFU21			
CGBU21			

LGBU21			
CGZU21CGZZ21	Écart sur report de positions sur taux de contrats à terme		
CGFU21CGFZ21	Écart sur report de positions sur taux de contrats à terme		
CGBU21CGBZ21	Écart sur report de positions sur taux de contrats à terme		
LGBU21LGBZ21	Écart sur report de positions sur taux de contrats à terme		
3CGZU1-1CGFU1	Opération sur courbe de contrats à terme sur obligations		
6CGZU1-1CGBU1	Opération sur courbe de contrats à terme sur obligations		
2CGFU1-1CGBU1	Opération sur courbe de contrats à terme sur obligations		
6CGZU1-4CGFU1 + 1CGBU1	Papillon sur contrats à terme sur obligations		

Les flux de données touchés par les modifications sont indiqués dans le tableau ci-dessous.

Flux	Champ
HSVF	Expiry Day and ExpiryDate
OBF (ITCH)	Expiration

Les rapports touchés par les modifications sont indiqués dans le tableau ci-dessous.

Rapport	Champ
InstrumentPreview_<DATE>.csv	ExpiryDate
Instruments_<DATE>.csv.gz	ExpiryDate

Les participants sont priés de communiquer avec le Centre d'assistance technique pour toute question, tout commentaire ou toute demande de renseignements supplémentaires.

Cordialement,

Centre d'assistance technique

Numéro sans frais : 1 877 588-8489

Téléphone : 514 871-7872

Courriel : MarketOps@tmx.com