

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 officiel 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.



CIRCULAIRE 088-22

Le 29 juillet, 2022

RAJUSTEMENT DE CONTRAT FINAL
FNB BetaPro Pétrole brut Baissier quotidien inverse avec effet de levier (HOD)
Regroupement d'actions

La Bourse et la CDCC désirent vous informer que « FNB BetaPro Pétrole brut Baissier quotidien inverse avec effet de levier » (TSX: « HOD ») va consolider ses actions ordinaires en circulation.

Le regroupement d'actions sur un ratio d'un pour quatre sera effectif à l'ouverture des marchés le 2 août 2022.

À l'ouverture des marchés le 2 août 2022, 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 HOD seront rajustées comme suit:

- **DATE PRÉVUE D'ENTRÉE EN VIGUEUR :** 2 août 2022
- **SYMBOLES DES OPTIONS:** HOD deviendra HOD1
- **NOMBRE DE CONTRATS :** Inchangé
- **MULTIPLICATEUR :** 25
- **NOUVEAU LIVRABLE PAR CONTRAT:** 25 actions ordinaires de FNB BetaPro Pétrole brut Baissier quotidien inverse avec effet de levier (HOD)
- **PRIX DE LEVÉE :** Les prix de levée seront multipliés par quatre
- **NOUVEAU CUSIP :** 08664K 30 3
- **LIMITES DE POSITION ET DE LEVÉE :** 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 HOD seront transférées à la classe d'options HOD1 qui constitue le nouveau livrable.

FNB BetaPro pétrole brut baissier quotidien inverse avec effet de levier		
Symbole	Prix de levée actuels	Nouveaux prix de levée
HOD1	0,50 \$	2,00 \$
HOD1	1,00 \$	4,00 \$
HOD1	1,25 \$	5,00 \$
HOD1	1,50 \$	6,00 \$
HOD1	1,75 \$	7,00 \$
HOD1	2,00 \$	8,00 \$
HOD1	2,25 \$	9,00 \$
HOD1	2,50 \$	10,00 \$
HOD1	2,75 \$	11,00 \$
HOD1	3,00 \$	12,00 \$
HOD1	3,25 \$	13,00 \$
HOD1	3,50 \$	14,00 \$
HOD1	3,75 \$	15,00 \$
HOD1	4,00 \$	16,00 \$
HOD1	4,25 \$	17,00 \$
HOD1	4,50 \$	18,00 \$
HOD1	4,75 \$	19,00 \$
HOD1	5,00 \$	20,00 \$
HOD1	5,25 \$	21,00 \$
HOD1	5,50 \$	22,00 \$
HOD1	5,75 \$	23,00 \$
HOD1	6,00 \$	24,00 \$
HOD1	6,50 \$	26,00 \$
HOD1	7,00 \$	28,00 \$
HOD1	7,50 \$	30,00 \$
HOD1	8,00 \$	32,00 \$
HOD1	8,50 \$	34,00 \$
HOD1	9,00 \$	36,00 \$
HOD1	9,50 \$	38,00 \$
HOD1	10,00 \$	40,00 \$
HOD1	11,00 \$	44,00 \$
HOD1	12,00 \$	48,00 \$
HOD1	13,00 \$	52,00 \$
HOD1	14,00 \$	56,00 \$

Veillez 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.

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.

Antonio Discenza
Directeur, opérations de négociation des produits dérivés