

# AVIS AUX MEMBRES



CANADIAN DERIVATIVES  
CLEARING CORPORATION

CORPORATION CANADIENNE DE  
COMPENSATION DE PRODUITS DÉRIVÉS

AVIS AUX MEMBRES

No. 2002 - 033

Le 12 avril 2002

## DÉPÔTS DES COUVERTURE ACCEPTABLE POUR DES POSITIONS VENDEUR D'OPTIONS D'ACHAT

### Options sur obligations du gouvernement du Canada

Vous trouverez ci-dessous une liste des obligations du gouvernement du Canada qui sont acceptables comme dépôt de sous-jacent pour la couverture des positions vendeuses d'options d'achat sur obligations.

La Règle A-708 (1) (b) se lit en partie comme suit :

«Les obligations du gouvernement du Canada qui :

- (i) soit constituent l' obligation sous-jacente;
- (ii) soit sont jugées acceptables par la Société.»

Les obligations qui:

- (i) comportent un coupon ayant un taux plus élevé;
- (ii) ont une valeur nominale à l'échéance d'au moins 1,000,000,000\$;
- (iii) se négocient à une prime de 5\$ supérieure à celle des obligations sous-jacentes;
- (iv) arrivent à échéance au plus tôt 2 ans avant les obligations sous-jacentes.

### Obligations sous options

### Couverture acceptable

#### OBK-Gouvernement

<b>du Canada</b> 9 %, 1er mars 2011	9 ¼%	1er juin 2022
	9 ¾%	1er juin 2021
	10 ¼%	15 mars 2014
	10 ½%	15 mars 2021
	11 ¼%	1er juin 2015

#### OBV-Gouvernement

<b>du Canada</b> 9 ¾%, 1er juin 2021	10 ½%	15 mars 2021
--------------------------------------	-------	--------------

#### OBZ-Gouvernement

<b>du Canada</b> 8%, 1er juin 2023	9%	1er juin 2025
	9 ¼%	1er juin 2022
	9 ¾%	1er juin 2021

## Options sur contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada (OGB)

Vous trouverez ci-dessous une liste des obligations du gouvernement du Canada qui sont acceptables comme dépôts de sous-jacent pour la couverture des positions vendeuses d'options d'achat sur contrats à terme (OGB).

La Règle A-708 (1) (f) se lit en partie comme suit :

«Les obligations du gouvernement du Canada qui :

- i) soit constituent l'obligation sous-jacente ;
- ii) soit sont réputées acceptables par la Société.»

	<b>Contrat sous-jacent</b>		<b>Couverture acceptable</b>
<b>CGB</b>	Juin 2002	5 ½%	1er juin 2010
		6%	1er juin 2011
		5 ¼%	1er juin 2012
<b>CGB</b>	Septembre 2002	6 %	1er juin 2011
		5 ¼%	1er juin 2012
<b>CGB</b>	Décembre 2002	6%	1er juin 2011
		5 ¼%	1er juin 2012
<b>CGB</b>	Mars 2003	6%	1er juin 2011
		5 ¼%	1er juin 2012

Michel Favreau  
Premier vice-président  
et chef de la compensation