

AVIS AUX MEMBRES



CANADIAN DERIVATIVES
CLEARING CORPORATION

CORPORATION CANADIENNE DE
COMPENSATION DE PRODUITS DÉRIVÉS

AVIS AUX MEMBRES
No. 2002 - 071
Le 10 juillet 2002

DÉPÔTS DE COUVERTURE ACCEPTABLES POUR DES POSITIONS VENDEUSES 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 au titre de la couverture des positions vendeurs 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

du Canada 9 %, 1^{er} mars 2011

9 ¼%	1 ^{er} juin 2022
9 ¾%	1 ^{er} juin 2021
10 ¼%	15 mars 2014
10 ½%	15 mars 2021
11 ¼%	1 ^{er} juin 2015

OBV-Gouvernement

du Canada 9 ¾%, 1^{er} juin 2021

10 ½%	15 mars 2021
-------	--------------

OBZ-Gouvernement

du Canada 8%, 1^{er} juin 2023

9%	1 ^{er} juin 2025
9 ¼%	1 ^{er} juin 2022
9 ¾%	1 ^{er} 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 au titre de la couverture des positions vendeurs 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.»

	Contrat sous-jacent		Couverture acceptable
CGB	Septembre 2002	6 % 5 ¼%	1 ^{er} juin 2011 1 ^{er} juin 2012
CGB	Décembre 2002	6% 5 ¼%	1 ^{er} juin 2011 1 ^{er} juin 2012
CGB	Mars 2003	6% 5 ¼%	1 ^{er} juin 2011 1 ^{er} juin 2012
CGB	Juin 2003	6% 5 ¼%	1 ^{er} juin 2011 1 ^{er} juin 2012

Michel Favreau
Premier vice-président
et chef de la compensation