



AVIS AUX MEMBRES

N° 2003-004

20 janvier 2003

OBLIGATIONS ADMISES EN DEPOTS DE COUVERTURE DES VENTES D'OPTIONS D'ACHAT

Options sur Obligations du Gouvernement du Canada

Vous trouverez ci-dessous la liste des Obligations du Gouvernement du Canada admissibles en dépôt de couverture des ventes d'options d'achat sur obligations.

La Règle A-708 (1) (b) s'interprète en partie comme suit:

"Les Obligations du Gouvernement du Canada qui:

- (i) constituent l'obligation sous-jacente; ou
- (ii) ont été jugées acceptables par la Corporation."(CDCC)

Ce sont les Obligations qui:

- (i) ont des coupons dont le taux est 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 l'obligation sous-jacente, et
- (iv) arrivent à échéance au plus tôt 2 ans avant l'obligation sous-jacente.

| <u>Obligations sous-jacentes</u> | <u>Obligations admises en couverture</u> |
|------------------------------------|--|
| OBK- Gouvernement du Canada | |
| 9% 1 Mars 2011 | 11,25% 1 juin 2015 |
| | 10,50% 15 mars 2021 |
| | 10,25% 15 mars 2014 |
| | 9,75% 1 juin 2021 |
| | 9,25% 1 juin 2022 |
| OBZ- Gouvernement du Canada | |
| 8% 1 Juin 2023 | 9,75% 1 juin 2021 |
| | 9,25% 1 juin 2022 |
| | 9% 1 juin 2025 |

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés

65, rue Queen Ouest
Bureau 700
Toronto, Ontario
M5H 2M5
Tél. : 416-367-2463
Télec. : 416-367-2473

800, square Victoria
3ième étage
Montréal (Québec)
H4Z 1A9
Tél. : 514-871-3545
Télec. : 514-871-3530

www.cdcc.ca



Options sur les contrats à terme sur Obligations du Gouvernement du Canada (OGB)

Vous trouverez ci-dessous la liste des Obligations du Gouvernement du Canada admises en dépôt de couverture des ventes d'options d'achat sur contrats à terme (OGB).

La Règle A-708 (1) (b) s'interprète en partie comme suit :

"Les Obligations du Gouvernement du Canada qui:

- (i) constituent l'obligation sous-jacente; ou
- (ii) ont été jugées acceptables par la Corporation."(CDCC)

| <u>Contrat sous-jacent</u> | <u>Obligations admises en couverture</u> |
|----------------------------|--|
| CGB Mars 2003 | 6% 1 juin 2011 5,25% 1 juin 2012 |
| CGB Juin 2003 | 6% 1 juin 2011 5,25% 1 juin 2012 |
| CGB Septembre 2003 | 6% 1 juin 2011 5,25% 1 juin 2012 |
| CGB Decembre 2003 | 6% 1 juin 2011 5,25% 1 juin 2012 |

Lara Krivokucha
Directeur Gestion des Risques

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés

65, rue Queen Ouest
Bureau 700
Toronto, Ontario
M5H 2M5
Tél. : 416-367-2463
Télec. : 416-367-2473

800, square Victoria
3ième étage
Montréal (Québec)
H4Z 1A9
Tél. : 514-871-3545
Télec. : 514-871-3530

www.cdcc.ca