



AVIS AUX MEMBRES

N° 2012 -226

Le 26 novembre 2012

RAJUSTEMENT DE CONTRAT ANTICIPÉ - SUIVI iShares Natural Gas Commodity Index Fund (GAS) Fusion

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 OFFICIEUX 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.

La Bourse et la CDCC désirent vous informer que les unités de iShares Natural Gas Commodity Index Fund (« GAS ») seront retirées de la cote à la Bourse de Toronto à la fermeture des marchés le 27 novembre 2012. Le retrait est en lien avec la fusion avec iShares Broad Commodity Index Fund (« CBR »).

Toutes les négociations des séries d'options de GAS seront interrompues le mercredi 28 novembre 2012 à l'ouverture des marchés, jusqu'à ce que le nouveau livrable soit connu. Ce dernier sera composé des unités de CBR qui auront une valeur liquidative totale égalant la valeur du portefeuille d'actifs de GAS et la valeur des autres actifs que CBR acquerra. Les unités des CBR seront émises à la valeur liquidative par unité applicable à la fermeture des marchés le jour précédent la date effective. La date effective est le 30 novembre 2012.

Un rajustement de contrat final sera émis avec les nouveaux détails lorsque la valeur liquidative applicable aux unités de CBR qui seront émises sera disponible.

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 Louise Leclair, Analyste, systèmes de négociation, Opérations de marché, Bourse de Montréal Inc. au 514 871-3526. Les membres de la CDCC peuvent communiquer avec le service aux membres de la CDCC.

Glenn Goucher
Président et chef de la compensation