



AVIS OPÉRATIONNEL

N^o 2010 – M73

Le 17 août 2010

RÉVISÉ FIFO CONTRAT À TERME SUR OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA – 2 ANS (CGZ)

Les membres sont priés de noter que la négociation du contrat à terme de **septembre 2010** sur obligations du gouvernement du Canada prendra fin à **13 h 00 (HE) le mardi 21 septembre 2010**.

L'horaire suivant s'appliquera durant la période de livraison:

Déclaration à la CDCC des positions à la fermeture du marché, par ordre chronologique (FIFO).	Jusqu'à 17 h 30 (HE) chaque jour ouvrable, à compter du 24 août 2010 et jusqu'au 28 septembre 2010 inclusivement.
Soumission des avis de livraison	Jusqu'à 17 h 30 (HE) chaque jour ouvrable, à compter du 30 août 2010 et jusqu'au 28 septembre 2010 inclusivement.
Disponibilité des les rapports des Membres (FIFO)	Les rapports sont disponibles chaque jour ouvrable, à compter du 25 août 2010 et jusqu'au 30 septembre 2010 inclusivement.
Jour de livraison	Le 2^e jour ouvrable suivant la soumission d'un avis de livraison. Chaque Membre de la Société qui doit effectuer une livraison ou prendre livraison doit confirmer à la Corporation de la livraison avant 14 h 45 (HE) selon les règles de la CDCC C-16, section C-1604 (1).

Cet avis contient un résumé de la Règle C-16 des Règles de la CDCC et de la Section 6 de son Manuel d'opération. La CDCC s'attend à ce que les firmes compensatrices respectent leurs obligations relativement aux contrats à terme.

VEUILLEZ VOUS ASSURER QUE TOUS LES CLIENTS, TOUT LE PERSONNEL DES OPÉRATIONS ET TOUT LE PERSONNEL DES SALLES DE MARCHÉ ET DE SUIVI DE MARCHÉ CONCERNÉS SONT INFORMÉS DU CONTENU DE CET AVIS.

Roger Warner
Directeur, Services aux membres

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés
The Exchange Tower
130, rue King Ouest, 5^{ème} étage
Toronto, Ontario
M5X 1J2
Tél. : 416-367-2470
Télec. : 416-350-2780

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

www.cdcc.ca



**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(au 9 août 2010)**

ANNEXE I

CONTRATS À TERME SUR OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA - 2 ANS - CGZ

Obligations du gouvernement du Canada		ISIN *	Montant en cours	Septembre 2010	Décembre 2010	Mars 2011	Juin 2011
Coupon	Échéance		(millions \$ CAN)				
1½ %	1 ^{er} mars 2012	CA135087ZB34	9 000	0,9640	S/O	S/O	S/O
1½ %	1 ^{er} juin 2012	CA135087ZE72	9 000	0,9581	0,9640	S/O	S/O
3¾ %	1 ^{er} juin 2012	CA135087YG30	6 799	0,9958	0,9964	S/O	S/O
5¼ %	1 ^{er} juin 2012	CA135087XH22	10 356	1,0209	1,0180	S/O	S/O
1¾ %	1 ^{er} mars 2013	CA135087ZD99	9 600	0,9470	0,9520	0,9572	0,9623
3½ %	1 ^{er} juin 2013	CA135087YN80	15 063	S/O	0,9882	0,9893	0,9905
5¼ %	1 ^{er} juin 2013	CA135087XM17	8 996	S/O	1,0295	1,0266	1,0238
2½ %	1 ^{er} septembre 2013	CA135087ZG21	6 000	S/O	S/O	0,9646	0,9680
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)				44 755	59 814	39 659	39 659

Facteurs de conversion calculés sur la base d'un rendement de 4 %

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés
 The Exchange Tower
 130, rue King Ouest, 5^{ème} étage
 Toronto, Ontario
 M5X 1J2
 Tél. : 416-367-2470
 Téléc. : 416-350-2780

800, square Victoria
 3^{ème} étage
 Montréal (Québec)
 H4Z 1A9
 Tél. : 514-871-3545
 Téléc. : 514-871-3530

www.cdcc.ca



* Ces renseignements sont fournis à titre informatif seulement. Même si tous les efforts nécessaires ont été déployés pour s'assurer de l'exactitude de ces renseignements, nous ne pouvons pas être tenus responsables de la présence de toute erreur ou omission.

Note : Cette liste est produite conformément aux Règles de Bourse de Montréal Inc. et de la Corporation canadienne de compensation de produits dérivés (CDCC).

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés

The Exchange Tower	800, square Victoria
130, rue King Ouest, 5 ^{ème} étage	3 ^{ème} étage
Toronto, Ontario	Montréal (Québec)
M5X 1J2	H4Z 1A9
Tél. : 416-367-2470	Tél. : 514-871-3545
Télec. : 416-350-2780	Télec. : 514-871-3530

www.cdcc.ca