

CIRCULAIRE 206-18
28 décembre 2018

RETRAITEMENT DE L'INTÉRÊT EN COURS DU CONTRAT À TERME SUR OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA DE CINQ ANS (CGF)

Bourse de Montréal Inc. (la « Bourse ») désire par la présente informer ses participants que les statistiques sur l'intérêt en cours publiées par la Corporation canadienne de compensation de produits dérivés (la « CDCC ») concernant le contrat à terme sur obligations du gouvernement du Canada de cinq ans (« CGF ») feront l'objet d'une correction. Les statistiques actuelles sur l'intérêt en cours sont inexactes, puisqu'elles sont tirées de données comportant certaines erreurs dans les opérations enregistrées, ce qui a mené à une surévaluation de l'intérêt en cours du CGF.

Par conséquent, les statistiques sur l'intérêt en cours publiées le **lundi 31 décembre** seront réduites, témoignant des positions en cours en fin de journée du **vendredi 28 décembre**. De plus, il y aura retraitement des statistiques sur l'intérêt en cours concernant certains jours de négociation de décembre 2018. La CDCC et la Bourse publieront les statistiques corrigées dans une circulaire ultérieure.

Pour obtenir de plus amples renseignements, veuillez communiquer avec Robert Tasca par téléphone au 1 514 871-3501 ou par courriel à robert.tasca@tmx.com.

Robert Tasca
Directeur, Groupe des produits dérivés sur taux d'intérêt et des solutions clients