

| | | | |
|-------------------------------------|--|--------------------------|-----------------------|
| <input checked="" type="checkbox"/> | Négociation - Dérivés sur taux d'intérêt | <input type="checkbox"/> | Back-office - Options |
| <input type="checkbox"/> | Négociation - Dérivés sur actions et indices | <input type="checkbox"/> | Technologie |
| <input checked="" type="checkbox"/> | Back-office - Contrats à terme | <input type="checkbox"/> | Réglementation |

CIRCULAIRE
Le 11 juillet 2011

**LISTE DES ÉMISSIONS D'OBLIGATIONS LIVRABLES DU
GOUVERNEMENT DU CANADA POUR LES
CONTRATS À TERME LGB, CGB, CGF ET CGZ**

Veillez trouver ci-joint, à titre d'information, la liste des émissions d'obligations livrables du gouvernement du Canada aux différents mois de livraison des contrats à terme LGB, CGB, CGF et CGZ. Cette liste est produite conformément aux Règles de Bourse de Montréal Inc. et de la Corporation canadienne de compensation de produits dérivés (CDCC) qui traitent des normes de livraison. Cette liste remplace celle qui a été diffusée le 16 juin 2011 (circulaire no : 106-2011).

Pour de plus amples renseignements, veuillez communiquer avec M. Santo Ferraiuolo, analyste de marché, Division de la réglementation, au 514 871-4949, poste 413, ou par courriel à sferraiuolo@m-x.ca.

Jacques Tanguay
Vice-président
Division de la réglementation

p.j.

Circulaire no : 122-2011

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE**

(En date du 11 juillet 2011)

CONTRATS À TERME SUR OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA DE TRENTE ANS – LGB

| Obligations du gouvernement du Canada | | Montant en cours | Septembre 2011 | Septembre 2011 | March 2012 | Juin 2012 |
|--|---------------------------|-------------------|----------------|----------------|------------|-----------|
| Coupon | Échéance | (millions \$ CAN) | | | | |
| 5¾ % | 1 ^{er} juin 2033 | 13 410 | 0,9697 | 0,9700 | 0,9701 | 0,9704 |
| 5 % | 1 ^{er} juin 2037 | 13 999 | 0,8696 | 0,8702 | 0,8707 | 0,8714 |
| 4 % | 1 ^{er} juin 2041 | 15 800 | 0,7240 | 0,7249 | 0,7257 | 0,7267 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN) | | | 43 209 | 43 209 | 43 209 | 43 209 |

Facteurs de conversion calculés sur la base d'un rendement de 6 %

CONTRATS À TERME SUR OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA DE DIX ANS – CGB

| Obligations du gouvernement du Canada | | Montant en cours | Juin 2011 | Septembre 2011 | Décembre 2011 | Mars 2012 |
|--|---------------------------|-------------------|-----------|----------------|---------------|-----------|
| Coupon | Échéance | (millions \$ CAN) | | | | |
| 3½ % | 1 ^{er} juin 2020 | 13 100 | 0,8317 | 0,8354 | 0,8391 | 0,8430 |
| 3¼ % | 1 ^{er} juin 2021 | 11 500 | 0,7992 | 0,8030 | 0,8069 | 0,8169 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN) | | | 24 600 | 24 600 | 24 600 | 24 600 |

Facteurs de conversion calculés sur la base d'un rendement de 6 %

CONTRATS À TERME SUR OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA DE CINQ ANS – CGF

| Obligations du gouvernement du Canada | | Montant en cours | Septembre 2011 | Décembre 2011 | Mars 2012 | Juin 2012 |
|---|--------------------------------|-------------------|----------------|---------------|-----------|-----------|
| Coupon | Échéance | (millions \$ CAN) | | | | |
| 2½ % | 1 ^{er} juin 2015 | 9 000 | 0,8840 | 0,8910 | S/O | S/O |
| 3 % | 1 ^{er} décembre 2015 | 11 341 | 0,8889 | 0,8947 | 0,9005 | 0,9065 |
| 2 % | 1 ^{er} juin 2016 | 9 900 | 0,8367 | 0,8443 | 0,8518 | 0,8596 |
| 2¾ % | 1 ^{er} septembre 2016 | 7 000 | 0,8614 | 0,8673 | 0,8735 | 0,8796 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN) | | | 37 241 | 37 241 | 28 241 | 28 241 |

Facteurs de conversion calculés sur la base d'un rendement de 6 %

CONTRATS À TERME SUR OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA DE DEUX ANS - CGZ

| Obligations du gouvernement du Canada | | Montant en cours | Septembre 2011 | Décembre 2011 | Mars 2012 | Juin 2012 |
|---|--------------------------------|-------------------|----------------|---------------|-----------|-----------|
| Coupon | Échéance | (millions \$ CAN) | | | | |
| 1¾ % | 1 ^{er} mars 2013 | 18 990 | 0,9399 | S/O | S/O | S/O |
| 2 % | 1 ^{er} août 2013 | 10 500 | 0,9344 | 0,9434 | S/O | S/O |
| 2½ % | 1 ^{er} septembre 2013 | 9 200 | 0,9350 | 0,9426 | 0,9505 | S/O |
| 2 % | 1 ^{er} mars 2014 | 9 600 | 0,9084 | 0,9169 | 0,9257 | 0,9344 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN) | | | 48 290 | 29 300 | 18 800 | 9 600 |

Facteurs de conversion calculés sur la base d'un rendement de 6 %

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