

<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 124-16
Le 11 octobre 2016

**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 **12 septembre 2016** (circulaire no : 106-16).

Pour de plus amples renseignements, veuillez communiquer avec M. Daniel Fontaine, Superviseur de marché principal, Marchés financier – Opérations de marché au 514 871-7871, ou à dfontaine@m-x.ca.

Jean-François Bertrand
Vice-président, opération de marché, service et connectivité, Marchés financiers,

p.j.

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 4 octobre 2016)**

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

Government of Canada Bonds		Outstanding	Décembre 2016	Mars 2017	Juin 2017	Septembre 2017
Coupon	Maturity	(CAN \$ million)				
3,5%	1 décembre 2045	16400	0.6584	0.6594	0.6606	0.6617
2,75%	1 décembre 2048	9550	0.5400	0.5412	0.5425	0.5437
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millionS \$ CAN)			25950	25950	25950	25950

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

Government of Canada Bonds		Outstanding	Décembre 2016	Mars 2017	Juin 2017	Septembre 2017
Coupon	Maturity	(CAN \$ million)				
2,25%	1 juin 2025	13100	0.7531	0.7587	0.7645	
1,5%	1 juin 2026	13500	0.6777	0.6841	0.6905	0.6971
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millionS \$ CAN)			26600	26600	26600	13500

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

Government of Canada Bonds		Outstanding	Décembre 2016	Mars 2017	Juin 2017	Septembre 2017
Coupon	Maturity	(CAN \$ million)				
0,75%	1 mars 2021	13800	0.8056			
0,75%	1 septembre 2021	15000	0.7858	0.7956	0.8056	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millionS \$ CAN)			28800	15000	15000	N/A

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

Government of Canada Bonds		Outstanding	Décembre 2016	Mars 2017	Juin 2017	Septembre 2017
Coupon	Maturity	(CAN \$ million)				
0,5%	1 août 2018	15600	0.9140			
0,5%	1 novembre 2018	11700	0.9018	0.9140		
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millionS \$ CAN)			27300	11700	N/A	N/A

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).