

<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 checked="" type="checkbox"/>	Réglementation

**CIRCULAIRE**  
Le 5 janvier 2012

**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 3 novembre 2011 (circulaire no : 168-2011).

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 par courriel à [dfontaine@m-x.ca](mailto:dfontaine@m-x.ca).

Brian Gelfand  
Vice-président  
Relations institutionnelles et opérations de marché  
Marchés financiers

p.j.

Circulaire no : 001-2012

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

(Au 23 décembre 2011)

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours	Mars 2012	Juin 2012	Septembre 2012	Décembre 2012
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
5¾ %	1 <sup>er</sup> juin 2033	<b>13 342</b>	0.9701	0.9704	N/A	N/A
5 %	1 <sup>er</sup> juin 2037	<b>13 999</b>	0.8707	0.8714	0.8718	0.8725
4 %	1 <sup>er</sup> juin 2041	<b>15 800</b>	0.7257	0.7267	0.7275	0.7285
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			43 141	43 141	29,799	29 799

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	Mars 2012	Juin 2012	Septembre 2012	Décembre 2012
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
3½ %	1 <sup>er</sup> juin 2020	<b>13 100</b>	0.8391	0.8430	N/A	N/A
3¼ %	1 <sup>er</sup> juin 2021	<b>11 500</b>	0.8069	0.8109	0.8148	0.8190
2¾ %	1 <sup>er</sup> juin 2022	<b>5 000</b>	0.7538	0.7582	0.7627	0.7672
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			29,600	29,600	16,500	16,500

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	Mars 2012	Juin 2012	Septembre 2012	Décembre 2012
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
3 %	1 <sup>er</sup> décembre 2015	<b>11 342</b>	0.9005	0.9065	N/A	N/A
2 %	1 <sup>er</sup> juin 2016	<b>9 900</b>	0.8518	0.8596	0.8674	0.8754
2¾ %	1 <sup>er</sup> septembre 2016	<b>10 500</b>	0.8735	0.8796	0.8859	0.8922
1½%	1 <sup>er</sup> mars 2017	<b>7 000</b>	0.8081	0.8164	0.8248	0.8333
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			38,742	38,742	27,400	27,400

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	Mars 2012	Juin 2012	Septembre 2012	Décembre 2012
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
1½%	1 <sup>er</sup> novembre 2013	<b>11 500</b>	0.9296	N/A	N/A	N/A
1%	1 <sup>er</sup> février 2014	<b>11 114</b>	0.9107	0.9218	N/A	N/A
2%	1 <sup>er</sup> mars 2014	<b>9 600</b>	0.9257	N/A	N/A	N/A
2¼%	1 <sup>er</sup> août 2014	<b>9 600</b>	0.9168	0.9248	N/A	N/A
1%	1 <sup>er</sup> février 2015	<b>6 000</b>	N/A	N/A	0.8890	0.8998
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			41,214	20,114	6,000	6,000

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).