

<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 106-16
Le 12 septembre 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 **4 août 2016** (circulaire no : 101-16).

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.

Annexe I

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

(Au 2 septembre 2016)

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

Obligations du gouvernement du Canada	Montant en cours	Septembre 2016	Décembre 2016	Mars 2017	Juin 2017
Coupon Échéance	(millions \$ CAN)				
3½% 1 ^{er} déc. 2045	16,400	0.6572	0.6584	0.6594	0.6606
2¾% 1 ^{er} déc. 2048	9,550	0.5388	0.5400	0.5412	0.5425
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)		25,950	25,950	25,950	25,950

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	Septembre 2016	Décembre 2016	Mars 2017	Juin 2017
Coupon Échéance	(millions \$ CAN)				
2¼% 1 ^{er} juin 2025	13,100	0.7475	0.7531	0.7587	0.7645
1½% 1 ^{er} juin 2026	13,500	0.6714	0.6777	0.6841	0.6905
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)		26,600	26,600	26,600	26,600

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 2016	Décembre 2016	Mars 2017	Juin 2017
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
¾%	1 ^{er} mars 2021	13,800	0.7956	0.8056	N/A	N/A
¾%	1 ^{er} septembre 2021	15,000	0.7761	0.7858	0.7956	0.8056
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			28,800	28,800	15,000	15,000

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 2016	Décembre 2016	Mars 2017	Juin 2017
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
¼%	1 ^{er} mai, 2018	15,000	0.9101	N/A	N/A	N/A
½%	1 ^{er} août, 2018	15,600	0.9018	0.9140	N/A	N/A
½%	1 ^{er} novembre, 2018	7,800	0.8898	0.9018	0.9140	N/A
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			38,400	23,400	7,800	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).