

<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 3 Août 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 **9 juillet** 2012 (circulaire no : 103-2012).

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.

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

p.j.

Circulaire no : 111-2012

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

(Au 3 août 2012)

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours	Septembre 2012	Décembre 2012	Mars 2013	Juin 2013
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
5 %	1 ^{er} juin 2037	13 999	0.8718	0.8725	0.8730	0.8737
4 %	1 ^{er} juin 2041	15 800	0.7275	0.7285	0.7293	0.7303
3½%	1 ^{er} dec 2045	6 500	N/A	0.6426	0.6434	0.6443
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			29,799	36,299	36,299	36,299

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 2012	Décembre 2012	Mars 2013	Juin 2013
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
3¼ %	1 ^{er} juin 2021	11 500	0.8148	0.8190	0.8230	0.8273
2¾%	1 ^{er} juin 2022	12 700	0.7627	0.7672	0.7718	0.7765
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			24,200	24,200	24,200	24,200

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 2012	Décembre 2012	Mars 2013	Juin 2013
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
2 %	1 ^{er} juin 2016	9 900	0.8674	0.8754	N/A	N/A
2¾ %	1 ^{er} septembre 2016	10 500	0.8859	0.8922	0.8988	N/A
1½ %	1 ^{er} mars 2017	10 500	0.8248	0.8333	0.8421	0.8508
1½ %	1 ^{er} septembre 2017	6 800	0.8081	0.8164	0.8248	0.8333
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			37,700	37,700	27,800	17,300

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 2012	Décembre 2012	Mars 2013	Juin 2013
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
¾ %	1 ^{er} mai 2014	10 867	0.9179	N/A	N/A	N/A
2¼ %	1 ^{er} août 2014	15 600	0.9330	0.9413	N/A	N/A
1 %	1 ^{er} novembre 2014	6 600	0.8998	0.9107	0.9218	N/A
1 %	1 ^{er} février 2015	9 000	0.8890	0.8998	N/A	N/A
1 ½ %	1 ^{er} août 2015	5 800	N/A	N/A	0.9001	0.9098
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			42,067	31,200	12,400	5,800

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).