

<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](mailto: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 <sup>er</sup> juin 2037	<b>13 999</b>	0.8718	0.8725	0.8730	0.8737
4 %	1 <sup>er</sup> juin 2041	<b>15 800</b>	0.7275	0.7285	0.7293	0.7303
3½%	1 <sup>er</sup> dec 2045	<b>6 500</b>	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 <sup>er</sup> juin 2021	<b>11 500</b>	0.8148	0.8190	0.8230	0.8273
2¾%	1 <sup>er</sup> juin 2022	<b>12 700</b>	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 <sup>er</sup> juin 2016	<b>9 900</b>	0.8674	0.8754	N/A	N/A
2¾ %	1 <sup>er</sup> septembre 2016	<b>10 500</b>	0.8859	0.8922	0.8988	N/A
1½ %	1 <sup>er</sup> mars 2017	<b>10 500</b>	0.8248	0.8333	0.8421	0.8508
1½ %	1 <sup>er</sup> septembre 2017	<b>6 800</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)			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 <sup>er</sup> mai 2014	<b>10 867</b>	0.9179	N/A	N/A	N/A
2¼ %	1 <sup>er</sup> août 2014	<b>15 600</b>	0.9330	0.9413	N/A	N/A
1 %	1 <sup>er</sup> novembre 2014	<b>6 600</b>	0.8998	0.9107	0.9218	N/A
1 %	1 <sup>er</sup> février 2015	<b>9 000</b>	0.8890	0.8998	N/A	N/A
1 ½ %	1 <sup>er</sup> août 2015	<b>5 800</b>	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).