

<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 011-15

Le 4 février, 2015

**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 **8 janvier, 2015** (circulaire no : 002-15).

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.

Claude Cyr
Vice-président principal, Marchés financiers,

p.j.

Annexe I

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

(Au 4 février 2015)

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours	Mars 2015	Juin 2015	Septembre 2015	Décembre 2015
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
4 %	1 ^{er} juin 2041	15,693	0.7372	0.7383	0.7393	0.7405
3½%	1 ^{er} dec 2045	16,400	0.6509	0.6520	0.6530	0.6541
2¾%	1 ^{er} dec 2064	3,500	0.4869	0.4874	0.4877	0.4882
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			35,593	35,593	35,593	35,593

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 2015	Juin 2015	Septembre 2015	Décembre 2015
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
1½%	1 ^{er} juin 2023	14,200	0.7105	0.7174	N/A	N/A
2½%	1 ^{er} juin 2024	13,800	0.7542	0.7593	0.7644	0.7696
2¼%	1 ^{er} juin 2025	10,600	0.7159	0.7210	0.7262	0.7314
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			38,600	38,600	24,400	24,400

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 2015	Juin 2015	Septembre 2015	Décembre 2015
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
1 ¾%	1 ^{er} septembre 2019	10,200	0.8345	0.8426	N/A	N/A
1 ½%	1 ^{er} mars 2020	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)			17,000	17,000	6,800	6,800

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 2015	Juin 2015	Septembre 2015	Décembre 2015
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
1%	1 ^{er} novembre 2016	10,200	0.9218	N/A	N/A	N/A
1 ½ %	1 ^{er} février 2017	17,100	0.9196	0.9296	N/A	N/A
1 ¼%	1 ^{er} août 2017	8,100	0.8946	0.9048	0.9152	N/A
1 ¼%	1 ^{er} février 2018	5,400	N/A	N/A	0.8946	0.9048
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			35,400	25,200	13,500	5,400

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).