

<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 121-14
Le 4 septembre, 2014

**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 août, 2014** (circulaire no : 110-2014).

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.

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

(Au 4 septembre 2014)

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours	Septembre 2014	Décembre 2014	Mars 2015	Juin 2015
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
4 %	1 ^{er} juin 2041	15 800	0.7352	0.7363	0.7372	0.7383
3½%	1 ^{er} dec 2045	16 400	0.6490	0.6500	0.6509	0.6520
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			32,200	32,200	32,200	32,200

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 2014	Décembre 2014	Mars 2015	Juin 2015
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
1½%	1 ^{er} juin 2023	14 200	0.6971	0.7038	0.7105	0.7174
2½%	1 ^{er} juin 2024	13 800	0.7444	0.7493	0.7542	0.7593
2 ¼%	1 ^{er} juin 2025	5 400	N/A	0.7110	0.7159	0.7210
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			28,000	33,400	33,400	33,400

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	Septembre 2014	Décembre 2014	Mars 2015	Juin 2015
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
1 ¾%	1 ^{er} mars 2019	10 200	0.8345	0.8426	N/A	N/A
1 ¾%	1 ^{er} septembre 2019	10 200	0.8187	0.8265	0.8345	0.8426
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			20,400	20,400	10,200	10,200

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 2014	Décembre 2014	Mars 2015	Juin 2015
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
1 %	1 ^{er} mai 2016	10 000	0.9218	N/A	N/A	N/A
1%	1 ^{er} août 2016	17 100	0.9107	0.9218	N/A	N/A
1%	1 ^{er} novembre 2016	3 400	0.8998	0.9107	0.9218	N/A
1 ½ %	1 ^{er} février 2017	8 100	0.9001	0.9098	N/A	N/A
1 ¼%	1 ^{er} août 2017	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)			38,600	28,600	8,800	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).