



Bourse de
Montréal

<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
		<input type="checkbox"/>	MCeX

CIRCULAIRE

Le 6 août 2009

**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 juillet (circulaire no : 110-2009).

Pour de plus amples renseignements, veuillez communiquer avec M. Santo Ferraiuolo, analyste de marché, Division de la réglementation, au 514 871-4949, poste 413, ou par courriel à sferraiuolo@m-x.ca.

Denis Chouinard
Directeur, inspections et analyses de marché
Division de la réglementation

p.j.

Circulaire no : 126-2009

Annexe I

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(au 6 août 2009)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours	Septembre 2009	Décembre 2009	Mars 2010	Juin 2010
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
5¾ %	1 ^{er} Juin 2033	13 410	1,2666	1,2650	1,2632	1,2616
5 %	1 ^{er} Juin 2037	13 999	1,1666	1,1659	1,1650	1,1642
4 %	1 ^{er} Juin 2041	6 400	1,0000	1,0000	1,0000	1,0000
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			33 809	33 809	33 809	33 809

Facteurs de conversion calculés sur la base d'un rendement de 4 %

CONTRATS À TERME SUR OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA DE DIX ANS – CGB

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours	Septembre 2009	Décembre 2009	Mars 2010	Juin 2010
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
4¼ %	1 ^{er} Juin 2018	10 622	0,8821	0,8848	0,8873	0,8901
3¾ %	1 ^{er} Juin 2019	14 450	0,8357	0,8389	0,8420	0,8453
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			25 072	25 072	25 072	25 072

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 2009	Décembre 2009	Mars 2010	Juin 2010
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
3½ %	1 ^{er} Juin 2013	15 063	0,9171	0,9221	S/O	S/O
5¼ %	1 ^{er} Juin 2013	8 996	0,9750	0,9766	S/O	S/O
3 %	1 ^{er} Juin 2014	16 000	0,8775	0,8832	0,8889	0,8947
5 %	1 ^{er} Juin 2014	9 753	0,9591	0,9611	0,9629	0,9649
2 %	1 ^{er} Décembre 2014	9 000	0,8221	0,8294	0,8367	0,8443
4½ %	1 ^{er} Juin 2015	10 143	S/O	S/O	0,9332	0,9360
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			58 812	58 812	44 896	44 896

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 2009	Décembre 2009	Mars 2010	Juin 2010
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
6 %	1 ^{er} juin 2011	9 802	1,0334	1,0288	S/O	S/O
1¼ %	1 ^{er} juin 2011	11 000	0,9539	0,9603	S/O	S/O
1 %	1 ^{er} septembre 2011	10 000	0,9429	0,9498	0,9567	S/O
3¾ %	1 ^{er} septembre 2011	8 766	0,9952	0,9958	0,9964	S/O
3¾ %	1 ^{er} juin 2012	6 799	S/O	0,9941	0,9946	0,9952
5¼ %	1 ^{er} juin 2012	10 356	S/O	1,0295	1,0266	1,0238
2 %	1 ^{er} septembre 2012	7 000	S/O	S/O	0,9529	0,9573
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			39 568	56 723	42 921	24 155

Facteurs de conversion calculés sur la base d'un rendement de 4 %

Note: Cette liste est produite conformément aux Règles de Bourse de Montréal Inc. et de la Corporation canadienne de compensation de produits dérivés (CDCC).