



| | | | |
|---|--|---|-----------------------|
| X | Négociation - Dérivés sur taux d'intérêt | | Back-office - Options |
| | Négociation - Dérivés sur actions et indices | X | Technologie |
| X | Back-office - Contrats à terme | X | Réglementation |

CIRCULAIRE 140-16
Le 4 novembre 2016

**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 11 octobre 2016 (circulaire no : 124-16).

Pour plus de renseignements, veuillez communiquer avec M. Daniel Fontaine, Superviseur de marché principal, Marchés financier – Opérations de marché au 514 871-7871, ou à daniel.fontaine@tmx.com

Luc Fortin
Président et chef de la direction par intérim

p.j.

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 2 novembre 2016)**

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

| Obligations du gouvernement du Canada | | Montant en cours | Décembre 2016 | Mars 2017 | Juin 2017 | Septembre 2017 |
|---|------------------|------------------|---------------|-----------|-----------|----------------|
| Coupon | Maturity | (CAN \$ million) | | | | |
| 3,5% | December 1, 2045 | 16400 | 0.6584 | 0.6594 | 0.6606 | 0.6617 |
| 2,75% | December 1, 2048 | 9950 | 0.5400 | 0.5412 | 0.5425 | 0.5437 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 26350 | 26350 | 26350 | 26350 |

POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)

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 | Décembre 2016 | Mars 2017 | Juin 2017 | Septembre 2017 |
|---|--------------|------------------|---------------|-----------|-----------|----------------|
| Coupon | Maturity | (CAN \$ million) | | | | |
| 2,25% | June 1, 2025 | 13100 | 0.7531 | 0.7587 | 0.7645 | |
| 1,5% | June 1, 2026 | 13500 | 0.6777 | 0.6841 | 0.6905 | 0.6971 |
| 1% | June 1, 2027 | 6000 | 0.6146 | 0.6213 | 0.6281 | 0.6349 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 32600 | 32600 | 32600 | 19500 |

POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)

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 | Décembre 2016 | Mars 2017 | Juin 2017 | Septembre 2017 |
|---|-------------------|------------------|---------------|-----------|-----------|----------------|
| Coupon | Maturity | (CAN \$ million) | | | | |
| 0,75% | March 1, 2021 | 13800 | 0.8056 | | | |
| 0,75% | September 1, 2021 | 15000 | 0.7858 | 0.7956 | 0.8056 | |
| 0,5% | March 1, 2022 | 3800 | 0.7554 | 0.7654 | 0.7756 | 0.7859 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 32600 | 18800 | 18800 | 3800 |

POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)

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 | Décembre 2016 | Mars 2017 | Juin 2017 | Septembre 2017 |
|---|------------------|------------------|---------------|-----------|-----------|----------------|
| Coupon | Échéance | (CAN \$ million) | | | | |
| 0,5% | August 1, 2018 | 15600 | 0.9140 | | | |
| 0,5% | November 1, 2018 | 15600 | 0.9018 | 0.9140 | | |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 31200 | 15600 | N/A | N/A |

POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)

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).