

| | |
|--|--|
| <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 checked="" type="checkbox"/> Technologie |
| <input checked="" type="checkbox"/> Back-office - Contrats à terme | <input checked="" type="checkbox"/> Réglementation |

CIRCULAIRE

Le 3 février 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 5 janvier 2012 (circulaire no : 001-2012).

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.

Brian Gelfand
Vice-président
Relations institutionnelles et opérations de marché
Marchés financiers

p.j.

Circulaire no : 015-2012

Annexe I

ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE (Au 3 février 2012)

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

| Obligations du gouvernement du Canada | | Montant en cours | Mars 2012 | Juin 2012 | Septembre 2012 | Décembre 2012 |
|---|---------------------------|-------------------|-----------|-----------|----------------|---------------|
| Coupon | Échéance | (millions \$ CAN) | | | | |
| 5¾ % | 1 ^{er} juin 2033 | 13 342 | 0.9701 | 0.9704 | N/A | N/A |
| 5 % | 1 ^{er} juin 2037 | 13 999 | 0.8707 | 0.8714 | 0.8718 | 0.8725 |
| 4 % | 1 ^{er} juin 2041 | 15 800 | 0.7257 | 0.7267 | 0.7275 | 0.7285 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN) | | | 43 141 | 43 141 | 29 799 | 29 799 |

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 2012 | Juin 2012 | Septembre 2012 | Décembre 2012 |
|---|---------------------------|-------------------|-----------|-----------|----------------|---------------|
| Coupon | Échéance | (millions \$ CAN) | | | | |
| 3½ % | 1 ^{er} juin 2020 | 13 100 | 0.8391 | 0.8430 | N/A | N/A |
| 3¼ % | 1 ^{er} juin 2021 | 11 500 | 0.8069 | 0.8109 | 0.8148 | 0.8190 |
| 2¾ % | 1 ^{er} juin 2022 | 7 500 | 0.7538 | 0.7582 | 0.7627 | 0.7672 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN) | | | 32,100 | 32,100 | 19,000 | 19,000 |

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 2012 | Juin 2012 | Septembre 2012 | Décembre 2012 |
|---|--------------------------------|-------------------|-----------|-----------|----------------|---------------|
| Coupon | Échéance | (millions \$ CAN) | | | | |
| 3 % | 1 ^{er} décembre 2015 | 11 342 | 0.9005 | 0.9065 | N/A | N/A |
| 2 % | 1 ^{er} juin 2016 | 9 900 | 0.8518 | 0.8596 | 0.8674 | 0.8754 |
| 2¾ % | 1 ^{er} septembre 2016 | 10 500 | 0.8735 | 0.8796 | 0.8859 | 0.8922 |
| 1½ % | 1 ^{er} mars 2017 | 7 000 | 0.8081 | 0.8164 | 0.8248 | 0.8333 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN) | | | 38,742 | 38,742 | 27,400 | 27,400 |

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 2012 | Juin 2012 | Septembre 2012 | Décembre 2012 |
|---|-------------------------------|-------------------|-----------|-----------|----------------|---------------|
| Coupon | Échéance | (millions \$ CAN) | | | | |
| 1½ % | 1 ^{er} novembre 2013 | 11 500 | 0.9296 | N/A | N/A | N/A |
| 1 % | 1 ^{er} février 2014 | 11 114 | 0.9107 | 0.9218 | N/A | N/A |
| 2 % | 1 ^{er} mars 2014 | 9 600 | 0.9257 | N/A | N/A | N/A |
| ¾ % | 1 ^{er} mai 2014 | 3 500 | 0.8948 | 0.9063 | 0.9179 | N/A |
| 2¼ % | 1 ^{er} août 2014 | 9 000 | 0.9168 | 0.9248 | N/A | N/A |
| 1 % | 1 ^{er} février 2015 | 9 000 | N/A | N/A | 0.8890 | 0.8998 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN) | | | 44,714 | 23,614 | 12,500 | 9,000 |

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).