

<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 checked="" type="checkbox"/>	Réglementation

CIRCULAIRE
Le 4 mai 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 **4 avril** 2012 (circulaire no : 055-2012).

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 : 067-2012

Annexe I

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

(Au 3 mai 2012)

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours	Juin 2012	Septembre 2012	Décembre 2012	Mars 2013
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
5¾ %	1 ^{er} juin 2033	13 272	0.9704	N/A	N/A	N/A
5 %	1 ^{er} juin 2037	13 999	0.8714	0.8718	0.8725	0.8730
4 %	1 ^{er} juin 2041	15 800	0.7267	0.7275	0.7285	0.7293
3½%	1 ^{er} dec 2045	4 700	N/A	N/A	0.6426	0.6434
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			43 071	29,799	34,499	34,499

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	Juin 2012	Septembre 2012	Décembre 2012	Mars 2013
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
3½ %	1 ^{er} juin 2020	13 100	0.8430	N/A	N/A	N/A
3¼ %	1 ^{er} juin 2021	11 500	0.8109	0.8148	0.8190	0.8230
2¾%	1 ^{er} juin 2022	10 100	0.7582	0.7627	0.7672	0.7718
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			34,700	21,600	21,600	21,600

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	Juin 2012	Septembre 2012	Décembre 2012	Mars 2013
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
3 %	1^{er} décembre 2015	11 342	0.9065	N/A	N/A	N/A
2 %	1^{er} juin 2016	9 900	0.8596	0.8674	0.8754	N/A
2¾ %	1^{er} septembre 2016	10 500	0.8796	0.8859	0.8922	0.8988
1½ %	1^{er} mars 2017	10 500	0.8164	0.8248	0.8333	0.8421
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			42,242	30,900	30,900	21,000

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	Juin 2012	Septembre 2012	Décembre 2012	Mars 2013
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
1 %	1^{er} février 2014	11 114	0.9218	N/A	N/A	N/A
¾ %	1^{er} mai 2014	10 867	0.9063	0.9179	N/A	N/A
2¼ %	1^{er} août 2014	12 300	0.9248	0.9330	0.9413	N/A
1 %	1^{er} février 2015	9 000	N/A	0.8890	0.8998	N/A
1 ½ %	1^{er} août 2015	2 900	N/A	N/A	N/A	0.9001
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			34,280	32,167	21,300	2,900

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).