

<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

Le 5 août 2011

**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 juillet 2011 (circulaire no : 122-2011).

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.

Jacques Tanguay
Vice-président
Division de la réglementation

p.j.

Circulaire no : 128-2011

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

(Au 5 août 2011)

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours	Septembre 2011	Septembre 2011	March 2012	Juin 2012
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
5¾ %	1^{er} juin 2033	13 410	0,9697	0,9700	0,9701	0,9704
5 %	1^{er} juin 2037	13 999	0,8696	0,8702	0,8707	0,8714
4 %	1^{er} juin 2041	15 800	0,7240	0,7249	0,7257	0,7267
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			43 209	43 209	43 209	43 209

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 2011	Septembre 2011	Décembre 2011	Mars 2012
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
3½ %	1^{er} juin 2020	13 100	0,8317	0,8354	0,8391	0,8430
3¼ %	1^{er} juin 2021	11 500	0,7992	0,8030	0,8069	0,8169
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			24 600	24 600	24 600	24 600

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	Septembre 2011	Décembre 2011	Mars 2012	Juin 2012
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
2½ %	1 ^{er} juin 2015	9 000	0,8840	0,8910	S/O	S/O
3 %	1 ^{er} décembre 2015	11 341	0,8889	0,8947	0,9005	0,9065
2 %	1 ^{er} juin 2016	9 900	0,8367	0,8443	0,8518	0,8596
2¾ %	1 ^{er} septembre 2016	10 500	0,8614	0,8673	0,8735	0,8796
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			40 741	40 741	31 741	31 741

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 2011	Décembre 2011	Mars 2012	Juin 2012
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
1¾ %	1 ^{er} mars 2013	18 990	0,9399	S/O	S/O	S/O
2 %	1 ^{er} août 2013	10 500	0,9344	0,9434	S/O	S/O
2½ %	1 ^{er} septembre 2013	9 200	0,9350	0,9426	0,9505	S/O
1½ %	1 ^{er} novembre 2013	3 500	0,9164	0,9263	0,9364	S/O
2 %	1 ^{er} mars 2014	9 600	0,9084	0,9169	0,9257	0,9344
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			51 790	32 800	22 300	9 600

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).