

<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 3 Octobre 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 **6 Septembre** 2012 (circulaire no : 117-2012).

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 : xxx-2012

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

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours	Décembre 2012	Mars 2013	Juin 2013	Septembre 2013
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
5 %	1^{er} juin 2037	13 999	0.8725	0.8730	0.8737	0.8742
4 %	1^{er} juin 2041	15 800	0.7285	0.7293	0.7303	0.7312
3½%	1^{er} dec 2045	7 900	0.6426	0.6434	0.6443	0.6452
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			37,699	37,699	37,699	37,699

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 2012	Mars 2013	Juin 2013	Septembre 2013
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
3¼ %	1^{er} juin 2021	11 500	0.8190	0.8230	0.8273	N/A
2¾%	1^{er} juin 2022	12 700	0.7672	0.7718	0.7765	0.7812
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			24,200	24,200	24,200	12,700

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 2012	Mars 2013	Juin 2013	Septembre 2013
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
2 %	1 ^{er} juin 2016	9 900	0.8754	N/A	N/A	N/A
2¾ %	1 ^{er} septembre 2016	10 500	0.8922	0.8988	N/A	N/A
1½ %	1 ^{er} mars 2017	10 500	0.8333	0.8421	0.8508	0.8598
1½ %	1 ^{er} septembre 2017	10 200	0.8164	0.8248	0.8333	0.8421
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			41,100	31,200	20,700	20,700

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 2012	Mars 2013	Juin 2013	Septembre 2013
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
2¼ %	1 ^{er} août 2014	15 600	0.9413	N/A	N/A	N/A
1 %	1 ^{er} novembre 2014	9 900	0.9107	0.9218	N/A	N/A
1 %	1 ^{er} février 2015	9 000	0.8998	N/A	N/A	N/A
1 ½ %	1 ^{er} août 2015	8 700	N/A	0.9001	0.9098	N/A
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)			34,500	18,600	8,700	N/A

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).