



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).