

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 5 avril 2017)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Juin 2017	Septembre 2017	Décembre 2017	Mars 2018
Coupon	Échéance					
3.5%	1er décembre 2045	16400	0.6606	0.6617	0.6629	0.6641
2.75%	1er décembre 2048	12100	0.5425	0.5437	0.5450	0.5462
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			28500	28500	28500	28500

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 (CAN \$ million)	Juin 2017	Septembre 2017	Décembre 2017	Mars 2018
Coupon	Échéance					
2.25%	1er Juin 2025	13100	0.7645			
1.5%	1er Juin 2026	13500	0.6905	0.6971	0.7038	0.7105
1%	1er Juin 2027	9000	0.6281	0.6349	0.6419	0.6490
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			35600	22500	22500	22500

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 (CAN \$ million)	Juin 2017	Septembre 2017	Décembre 2017	Mars 2018
Coupon	Échéance					
0.75%	1er Septembre 2021	15000	0.8056			
0.5%	1er Mars 2022	15000	0.7756	0.7859	0.7963	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			30000	15000	15000	N/A

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 (CAN \$ million)	Juin 2017	Septembre 2017	Décembre 2017	Mars 2018
Coupon	Échéance					
0.5%	1er Novembre 2018	15600	0.9140			
0.75%	1er Février 2019	11700	0.9063	0.9179		
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			27300	11700	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).