

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 25 Juin 2019)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Septembre 2019	Décembre 2019	Mars 2020	Juin 2020
Coupon	Échéance					
3.5%	1er décembre 2045	16400	0.6715	0.6729	0.6742	0.6756
2.75%	1er décembre 2048	14900	0.5544	0.5559	0.5573	0.5588
2%	1er décembre 2051	6700	0.4324	0.4339	0.4353	0.4369
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			38000	38000	38000	38000

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)	Septembre 2019	Décembre 2019	Mars 2020	Juin 2020
Coupon	Échéance					
2%	1er Juin 2028	13500	0.7307	0.7367	0.7426	0.7488
2.25%	1er Juin 2029	12300	0.7262	0.7314	0.7367	0.7421
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			25800	25800	25800	25800

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)	Septembre 2019	Décembre 2019	Mars 2020	Juin 2020
Coupon	Échéance					
2.25%	1er Mars 2024	12000	0.8540			
1.5%	1er Septembre 2024	8000	0.8081			
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			20000			

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)	Septembre 2019	Décembre 2019	Mars 2020	Juin 2020
Coupon	Échéance					
1.75%	1er Mai 2021	12000	0.9335			
1.5%	1er Août 2021	6000	0.9196	0.9296		
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			18000	6000	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).

Les montants en cours sont représentatifs du marché à la date de publication de ce document et sont fournis à titre informatif seulement.

Les limites de positions déterminées et publiées par la division de la Réglementation de la Bourse peuvent être basées sur des montants différents