

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 3 novembre 2017)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Décembre 2017	Mars 2018	Juin 2018	Septembre 2018
Coupon	Échéance					
3.5%	1er décembre 2045	16400	0.6629	0.6641	0.6653	0.6665
2.75%	1er décembre 2048	14900	0.5450	0.5462	0.5476	0.5489
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			31300	31300	31300	31300

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)	Décembre 2017	Mars 2018	Juin 2018	Septembre 2018
Coupon	Échéance					
1.5%	1er Juin 2026	13500	0.7038	0.7105	0.7174	
1%	1er Juin 2027	15000	0.6419	0.6490	0.6562	0.6634
2%	1er Juin 2028	6000	0.6917	0.6970	0.7025	0.7079
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			34500	34500	34500	21000

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)	Décembre 2017	Mars 2018	Juin 2018	Septembre 2018
Coupon	Échéance					
0.5%	1er Mars 2022	15000	0.7963			
1%	1er Septembre 2022	15600	0.7960	0.8053	0.8148	
1.75%	1er Mars 2023	3900	0.8110	0.8187	0.8265	0.8345
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			34500	19500	19500	3900

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)	Décembre 2017	Mars 2018	Juin 2018	Septembre 2018
Coupon	Échéance					
0.75%	1er Août 2019	15600	0.9179			
1.25%	1er Novembre 2019	15600	0.9152	0.9257		
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).