

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 4 Juin 2018)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Juin 2018	Septembre 2018	Décembre 2018	Mars 2019
Coupon	Échéance					
3.5%	1er décembre 2045	16400	0.6653	0.6665	0.6678	0.6690
2.75%	1er décembre 2048	14900	0.5476	0.5489	0.5503	0.5516
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)	Juin 2018	Septembre 2018	Décembre 2018	Mars 2019
Coupon	Échéance					
1.5%	1er Juin 2026	13500	0.7174			
1%	1er Juin 2027	15000	0.6562	0.6634	0.6708	0.6783
2%	1er Juin 2028	11300	0.7025	0.7079	0.7135	0.7191
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			39800	26300	26300	26300

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 2018	Septembre 2018	Décembre 2018	Mars 2019
Coupon	Échéance					
1%	1er Septembre 2022	15600	0.8148			
1.75%	1er Mars 2023	15000	0.8265	0.8345	0.8426	
2%	1er Septembre 2023	6000	0.8221	0.8294	0.8367	0.8443
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			36600	21000	21000	6000

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 2018	Septembre 2018	Décembre 2018	Mars 2019
Coupon	Échéance					
1.25%	1er Février 2020	14400	0.9257			
1.75%	1er Mai 2020	12600	0.9241	0.9335		
1.75%	1er Août 2020	3000	0.9148	0.9241	0.9335	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			30000	15600	3000	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).