

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 5 septembre 2018)**

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

| Obligations du gouvernement du Canada | | Montant en cours (CAN \$ million) | Septembre 2018 | Décembre 2018 | Mars 2019 | Juin 2019 |
|---|-------------------|--------------------------------------|----------------|---------------|-----------|-----------|
| Coupon | Échéance | | | | | |
| 3.5% | 1er décembre 2045 | 16400 | 0.6665 | 0.6678 | 0.6690 | 0.6703 |
| 2.75% | 1er décembre 2048 | 14900 | 0.5489 | 0.5503 | 0.5516 | 0.5530 |
| 2% | 1er décembre 2051 | 3500 | 0.4267 | 0.4281 | 0.4295 | 0.4309 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 34800 | 34800 | 34800 | 34800 |

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 2018 | Décembre 2018 | Mars 2019 | Juin 2019 |
|---|---------------|--------------------------------------|----------------|---------------|-----------|-----------|
| Coupon | Échéance | | | | | |
| 1% | 1er Juin 2027 | 15000 | 0.6634 | 0.6708 | 0.6783 | 0.6860 |
| 2% | 1er Juin 2028 | 13500 | 0.7079 | 0.7135 | 0.7191 | 0.7249 |
| 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 CINQ ANS – CGF

| Obligations du gouvernement du Canada | | Montant en cours (CAN \$ million) | Septembre 2018 | Décembre 2018 | Mars 2019 | Juin 2019 |
|---|--------------------|--------------------------------------|----------------|---------------|-----------|-----------|
| Coupon | Échéance | | | | | |
| 1.75% | 1er Mars 2023 | 15000 | 0.8345 | 0.8426 | | |
| 2% | 1er Septembre 2023 | 12000 | 0.8294 | 0.8367 | 0.8443 | 0.8518 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 27000 | 27000 | 12000 | 12000 |

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 2018 | Décembre 2018 | Mars 2019 | Juin 2019 |
|---|-------------------|--------------------------------------|----------------|---------------|-----------|-----------|
| Coupon | Échéance | | | | | |
| 1.75% | 1er Mai 2020 | 12600 | 0.9335 | | | |
| 1.75% | 1er Août 2020 | 12000 | 0.9241 | 0.9335 | | |
| 2% | 1er Novembre 2020 | 3000 | 0.9198 | 0.9286 | 0.9374 | |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 27600 | 15000 | 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).