

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 27 Mai 2019)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Juin 2019	Septembre 2019	Décembre 2019	Mars 2020
Coupon	Échéance					
3.5%	1er décembre 2045	16400	0.6703	0.6715	0.6729	0.6742
2.75%	1er décembre 2048	14900	0.5530	0.5544	0.5559	0.5573
2%	1er décembre 2051	6700	0.4309	0.4324	0.4339	0.4353
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)	Juin 2019	Septembre 2019	Décembre 2019	Mars 2020
Coupon	Échéance					
1%	1er Juin 2027	15000	0.6860			
2%	1er Juin 2028	13500	0.7249	0.7307	0.7367	0.7426
2.25%	1er Juin 2029	12300	0.7210	0.7262	0.7314	0.7367
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			40800	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)	Juin 2019	Septembre 2019	Décembre 2019	Mars 2020
Coupon	Échéance					
2%	1er Septembre 2023	12000	0.8518			
2.25%	1er Mars 2024	12000	0.8469	0.8540	0.8611	
1.5%	1er Septembre 2024	8000	0.7999	0.8081	0.8164	0.8248
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			32000	20000	20000	8000

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 2019	Septembre 2019	Décembre 2019	Mars 2020
Coupon	Échéance					
2.25%	1er Février 2021	12000	0.9413			
1.75%	1er Mai 2021	12000	0.9241	0.9335		
1.5%	1er Août 2021	3000	0.9098	0.9196	0.9296	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			27000	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).

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