

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 27 janvier 2020)**

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

| Obligations du gouvernement du Canada | | Montant en cours (CAN \$ million) | Mars 2020 | Juin 2020 | Septembre 2020 | Decembre 2020 |
|---|-------------------|--------------------------------------|-----------|-----------|----------------|---------------|
| Coupon | Échéance | | | | | |
| 3.5% | 1er décembre 2045 | 16400 | 0.6742 | 0.6756 | 0.6769 | 0.6784 |
| 2.75% | 1er décembre 2048 | 14900 | 0.5573 | 0.5588 | 0.5602 | 0.5618 |
| 2% | 1er décembre 2051 | 9900 | 0.4353 | 0.4369 | 0.4384 | 0.4400 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 41200 | 41200 | 41200 | 41200 |

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) | Mars 2020 | Juin 2020 | Septembre 2020 | Decembre 2020 |
|---|---------------|--------------------------------------|-----------|-----------|----------------|---------------|
| Coupon | Échéance | | | | | |
| 2% | 1er juin 2028 | 13500 | 0.7426 | 0.7488 | | |
| 2.25% | 1er juin 2029 | 12300 | 0.7367 | 0.7421 | 0.7475 | 0.7531 |
| 1.25% | 1er juin 2030 | 9700 | 0.6402 | 0.6467 | 0.6532 | 0.6598 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 35500 | 35500 | 22000 | 22000 |

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) | Mars 2020 | Juin 2020 | Septembre 2020 | Decembre 2020 |
|---|--------------------|--------------------------------------|-----------|-----------|----------------|---------------|
| Coupon | Échéance | | | | | |
| 1.5% | 1er septembre 2024 | 16200 | 0.8248 | | | |
| 1.25% | 1er mars 2025 | 8400 | 0.7974 | 0.8062 | 0.8151 | |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 24600 | 8400 | 8400 | N/A |

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) | Mars 2020 | Juin 2020 | Septembre 2020 | Decembre 2020 |
|---|-------------------|--------------------------------------|-----------|-----------|----------------|---------------|
| Coupon | Échéance | | | | | |
| 1.25% | 1er novembre 2021 | 12000 | 0.9257 | | | |
| 1.5% | 1er février 2022 | 12000 | 0.9196 | 0.9296 | | |
| 1.5% | 1er mai 2022 | 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