

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 4 janvier 2017)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours	Mars 2017	Juin 2017	Septembre 2017	Décembre 2017
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
3.5%	1er décembre 2045	16400	0.6594	0.6606	0.6617	0.6629
2.75%	1er décembre 2048	11700	0.5412	0.5425	0.5437	0.5450
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			28100	28100	28100	28100

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	Mars 2017	Juin 2017	Septembre 2017	Décembre 2017
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
2.25%	1er Juin 2025	13100	0.7587	0.7645		
1.5%	1er Juin 2026	13500	0.6841	0.6905	0.6971	0.7038
1%	1er Juin 2027	6000	0.6213	0.6281	0.6349	0.6419
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			32600	32600	19500	19500

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	Mars 2017	Juin 2017	Septembre 2017	Décembre 2017
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
0.75%	1er Septembre 2021	15000	0.7956	0.8056		
0.5%	1er Mars 2022	7500	0.7654	0.7756	0.7859	0.7963
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			22500	22500	7500	7500

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	Mars 2017	Juin 2017	Septembre 2017	Décembre 2017
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
0.5%	1er Novembre 2018	15600	0.9140			
0.5%	1er Février 2019	11700	0.9018	0.9140		
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			27300	11700	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).