

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES  
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE  
(Au 5 décembre 2016)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours	Décembre 2016	Mars 2017	Juin 2017	Septembre 2017
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
3,5%	1er décembre 2045	16400	0.6584	0.6594	0.6606	0.6617
2,75%	1er décembre 2048	11700	0.5400	0.5412	0.5425	0.5437
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	Décembre 2016	Mars 2017	Juin 2017	Septembre 2017
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
2,25%	1er Juin 2025	13100	0.7531	0.7587	0.7645	
1,5%	1er Juin 2026	13500	0.6777	0.6841	0.6905	0.6971
1%	1er Juin 2027	6000	0.6146	0.6213	0.6281	0.6349
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			32600	32600	32600	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	Décembre 2016	Mars 2017	Juin 2017	Septembre 2017
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
0,75%	1er Mars 2021	13800	0.8056			
0,75%	1er Septembre 2021	15000	0.7858	0.7956	0.8056	
0,5%	1er Mars 2022	7500	0.7554	0.7654	0.7756	0.7859
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			36300	22500	22500	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	Décembre 2016	Mars 2017	Juin 2017	Septembre 2017
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
0,5%	1er Août 2018	15600	0.9140			
0,5%	1er Novembre 2018	15600	0.9018	0.9140		
0,5%	1er Février 2019	3900	0.8898	0.9018	0.9140	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			35100	19500	3900	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).