

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 14 août 2017)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Septembre 2017	Décembre 2017	Mars 2018	Juin 2018
Coupon	Échéance					
3.5%	1er décembre 2045	16400	0.6617	0.6629	0.6641	0.6653
2.75%	1er décembre 2048	13300	0.5437	0.5450	0.5462	0.5476
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			29700	29700	29700	29700

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 2017	Décembre 2017	Mars 2018	Juin 2018
Coupon	Échéance					
1.5%	1er Juin 2026	13500	0.6971	0.7038	0.7105	0.7174
1%	1er Juin 2027	15000	0.6349	0.6419	0.6490	0.6562
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 2017	Décembre 2017	Mars 2018	Juin 2018
Coupon	Échéance					
0.5%	1er Mars 2022	15000	0.7859	0.7963		
1%	1er Septembre 2022	11700	0.7867	0.7960	0.8053	0.8148
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			26700	26700	11700	11700

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 2017	Décembre 2017	Mars 2018	Juin 2018
Coupon	Échéance					
0.75%	1er Mai 2019	15600	0.9179			
0.75%	1er Août 2019	15600	0.9063	0.9179		
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			31200	15600	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).