

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 8 janvier 2018)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Mars 2018	Juin 2018	Septembre 2018	Décembre 2018
Coupon	Échéance					
3.5%	1er décembre 2045	16400	0.6641	0.6653	0.6665	0.6678
2.75%	1er décembre 2048	14900	0.5462	0.5476	0.5489	0.5503
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			31300	31300	31300	31300

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 2018	Juin 2018	Septembre 2018	Décembre 2018
Coupon	Échéance					
1.5%	1er Juin 2026	13500	0.7105	0.7174		
1%	1er Juin 2027	15000	0.6490	0.6562	0.6634	0.6708
2%	1er Juin 2028	6000	0.6970	0.7025	0.7079	0.7135
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			34500	34500	21000	21000

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 2018	Juin 2018	Septembre 2018	Décembre 2018
Coupon	Échéance					
1%	1er Septembre 2022	15600	0.8053	0.8148		
1.75%	1er Mars 2023	7600	0.8187	0.8265	0.8345	0.8426
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			23200	23200	7600	7600

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 2018	Juin 2018	Septembre 2018	Décembre 2018
Coupon	Échéance					
1.25%	1er Novembre 2019	15600	0.9257			
1.25%	1er Février 2020	10800	0.9152	0.9257		
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			26400	10800	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).