

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 5 septembre 2018)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Septembre 2018	Décembre 2018	Mars 2019	Juin 2019
Coupon	Échéance					
3.5%	1er décembre 2045	16400	0.6665	0.6678	0.6690	0.6703
2.75%	1er décembre 2048	14900	0.5489	0.5503	0.5516	0.5530
2%	1er décembre 2051	3500	0.4267	0.4281	0.4295	0.4309
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			34800	34800	34800	34800

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 2018	Décembre 2018	Mars 2019	Juin 2019
Coupon	Échéance					
1%	1er Juin 2027	15000	0.6634	0.6708	0.6783	0.6860
2%	1er Juin 2028	13500	0.7079	0.7135	0.7191	0.7249
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 2018	Décembre 2018	Mars 2019	Juin 2019
Coupon	Échéance					
1.75%	1er Mars 2023	15000	0.8345	0.8426		
2%	1er Septembre 2023	12000	0.8294	0.8367	0.8443	0.8518
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			27000	27000	12000	12000

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 2018	Décembre 2018	Mars 2019	Juin 2019
Coupon	Échéance					
1.75%	1er Mai 2020	12600	0.9335			
1.75%	1er Août 2020	12000	0.9241	0.9335		
2%	1er Novembre 2020	3000	0.9198	0.9286	0.9374	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			27600	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).