

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 4 Janvier 2019)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Mars 2019	Juin 2019	Septembre 2019	Décembre 2019
Coupon	Échéance					
3.5%	1er décembre 2045	16400	0.6690	0.6703	0.6715	0.6729
2.75%	1er décembre 2048	14900	0.5516	0.5530	0.5544	0.5559
2%	1er décembre 2051	4900	0.4295	0.4309	0.4324	0.4339
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			36200	36200	36200	36200

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 2019	Juin 2019	Septembre 2019	Décembre 2019
Coupon	Échéance					
1%	1er Juin 2027	15000	0.6783	0.6860		
2%	1er Juin 2028	13500	0.7191	0.7249	0.7307	0.7367
2.25%	1er Juin 2029	6000	0.7159	0.7210	0.7262	0.7314
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			34500	34500	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 (CAN \$ million)	Mars 2019	Juin 2019	Septembre 2019	Décembre 2019
Coupon	Échéance					
2%	1er Septembre 2023	12000	0.8443	0.8518		
2.25%	1er Mars 2024	6000	0.8401	0.8469	0.8540	0.8611
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			18000	18000	6000	6000

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 2019	Juin 2019	Septembre 2019	Décembre 2019
Coupon	Échéance					
2%	1er Novembre 2020	12000	0.9374			
2.25%	1er Février 2021	9000	0.9330	0.9413		
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			21000	9000	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).