

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 25 février 2020)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Mars 2020	Juin 2020	Septembre 2020	Decembre 2020
Coupon	Échéance					
3.5%	1er décembre 2045	16400	0.6742	0.6756	0.6769	0.6784
2.75%	1er décembre 2048	14900	0.5573	0.5588	0.5602	0.5618
2%	1er décembre 2051	9900	0.4353	0.4369	0.4384	0.4400
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			41200	41200	41200	41200

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 2020	Juin 2020	Septembre 2020	Decembre 2020
Coupon	Échéance					
2%	1er juin 2028	13500	0.7426	0.7488		
2.25%	1er juin 2029	12300	0.7367	0.7421	0.7475	0.7531
1.25%	1er juin 2030	9700	0.6402	0.6467	0.6532	0.6598
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			35500	35500	22000	22000

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 2020	Juin 2020	Septembre 2020	Decembre 2020
Coupon	Échéance					
1.5%	1er septembre 2024	16200	0.8248			
1.25%	1er mars 2025	16800	0.7974	0.8062	0.8151	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			33000	16800	16800	N/A

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 2020	Juin 2020	Septembre 2020	Decembre 2020
Coupon	Échéance					
1.25%	1er novembre 2021	12000	0.9257			
1.5%	1er février 2022	12000	0.9196	0.9296		
1.5%	1er mai 2022	6000	0.9098	0.9196	0.9296	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			30000	18000	6000	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).

Les montants en cours sont représentatifs du marché à la date de publication de ce document et sont fournis à titre informatif seulement.

Les limites de positions déterminées et publiées par la division de la Réglementation de la Bourse peuvent être basées sur des montants différents