

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 2 juin 2017)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Juin 2017	Septembre 2017	Décembre 2017	Mars 2018
Coupon	Échéance					
3.5%	1er décembre 2045	16400	0.6606	0.6617	0.6629	0.6641
2.75%	1er décembre 2048	13300	0.5425	0.5437	0.5450	0.5462
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)	Juin 2017	Septembre 2017	Décembre 2017	Mars 2018
Coupon	Échéance					
2.25%	1er Juin 2025	13100	0.7645			
1.5%	1er Juin 2026	13500	0.6905	0.6971	0.7038	0.7105
1%	1er Juin 2027	12000	0.6281	0.6349	0.6419	0.6490
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			38600	25500	25500	25500

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)	Juin 2017	Septembre 2017	Décembre 2017	Mars 2018
Coupon	Échéance					
0.75%	1er Septembre 2021	15000	0.8056			
0.5%	1er Mars 2022	15000	0.7756	0.7859	0.7963	
1%	1er Septembre 2022	7800	0.7776	0.7867	0.7960	0.8053
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			37800	22800	22800	7800

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)	Juin 2017	Septembre 2017	Décembre 2017	Mars 2018
Coupon	Échéance					
0.5%	1er Février 2019	15600	0.9140			
0.75%	1er Mai 2019	15600	0.9063	0.9179		
0.75%	1er Août 2019	3900	0.8948	0.9063	0.9179	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			35100	19500	3900	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).