

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 28 Octobre 2019)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Décembre 2019	Mars 2020	Juin 2020	Septembre 2020
Coupon	Échéance					
3.5%	1er décembre 2045	16400	0.6729	0.6742	0.6756	0.6769
2.75%	1er décembre 2048	14900	0.5559	0.5573	0.5588	0.5602
2%	1er décembre 2051	8500	0.4339	0.4353	0.4369	0.4384
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			39800	39800	39800	39800

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)	Décembre 2019	Mars 2020	Juin 2020	Septembre 2020
Coupon	Échéance					
2%	1er Juin 2028	13500	0.7367	0.7426	0.7488	
2.25%	1er Juin 2029	12300	0.7314	0.7367	0.7421	0.7475
1.25%	1er Juin 2030	6300	0.6339	0.6402	0.6467	0.6532
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			32100	32100	32100	18600

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)	Décembre 2019	Mars 2020	Juin 2020	Septembre 2020
Coupon	Échéance					
1.5%	1er Septembre 2024	16200	0.8164	0.8248		
1.25%	1er Mars 2025	4200	0.7887	0.7974	0.8062	0.8151
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			20400	20400	4200	4200

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)	Décembre 2019	Mars 2020	Juin 2020	Septembre 2020
Coupon	Échéance					
1.5%	1er Août 2021	12000	0.9296			
1.25%	1er Novembre 2021	12000	0.9152	0.9257		
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			24000	12000	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).

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