

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

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours	Jun 2020	Septembre 2020	Decembre 2020	Mars 2021
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
3.5%	1er décembre 2045	16300	0.6756	0.6769	0.6784	
2.75%	1er décembre 2048	14900	0.5588	0.5602	0.5618	0.5633
2%	1er décembre 2051	10817	0.4369	0.4384	0.4400	0.4415
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			42017	42017	42017	25717

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	Jun 2020	Septembre 2020	Decembre 2020	Mars 2021
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
2%	1er juin 2028	13500	0.7488			
2.25%	1er juin 2029	12300	0.7421	0.7475	0.7531	0.7587
1.25%	1er juin 2030	10200	0.6467	0.6532	0.6598	0.6665
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			36000	22500	22500	22500

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	Jun 2020	Septembre 2020	Decembre 2020	Mars 2021
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
1.25%	1er mars 2025	17300	0.8062	0.8151		
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			17300	17300	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 %

CONTRATS À TERME SUR OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA DE DEUX ANS - CGZ

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours	Jun 2020	Septembre 2020	Decembre 2020	Mars 2021
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
1.5%	1er février 2022	12000	0.9296			
1.5%	1er mai 2022	9000	0.9196	0.9296		
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).

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