

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES  
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE  
(Au 25 mai 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	13317	0.4369	0.4384	0.4400	0.4415
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			44517	44517	44517	28217

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	19700	0.6467	0.6532	0.6598	0.6665
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			45500	32000	32000	32000

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		
0.5%	1er septembre 2025	16500	0.7554	0.7654	0.7756	0.7859
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			33800	33800	16500	16500

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	20000	0.9196	0.9296		
0.25%	1er Août 2022	12000	0.8848	0.8973	0.9101	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			44000	32000	12000	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