

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(au 5 décembre 2001)**

CONTRATS À TERME SUR OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA DE DIX ANS - CGB

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours	Décembre 2001	Mars 2002	Juin 2002	Septembre 2002
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
5 ½ %	1 ^{er} juin 2010	10 400	0,9671	0,9677	0,9686	N/A
6 %	1 ^{er} juin 2011	15 000	1,0000	0,9999	1,0000	0,9999
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS ÉLIGIBLES POUR LIVRAISON (millions \$ CAN)			25 400	25 400	25 400	15 000

Facteurs 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	Décembre 2001	Mars 2002	Juin 2002	Septembre 2002
Coupon	Échéance	(millions \$ CAN)				
6 %	1 ^{er} septembre 2005	11 100	0,9999	1,0000	N/A	N/A
8 ¾ %	1 ^{er} décembre 2005	8 000	1,0965	1,0910	1,0857	N/A
5 ¾ %	1 ^{er} septembre 2006	10 000	0,9897	0,9903	0,9906	0,9912
7 %	1 ^{er} décembre 2006	9 100	1,0427	1,0407	1,0389	1,0369
7 ¼ %	1 ^{er} juin 2007	9 500	N/A	1,0555	1,0533	1,0509
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS ÉLIGIBLES POUR LIVRAISON (millions \$ CAN)			38 200	47 700	36 600	28 600

Facteurs 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 («CCCPD»).