

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 6 septembre 2017)**

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

| Obligations du gouvernement du Canada | | Montant en cours (CAN \$ million) | Septembre 2017 | Décembre 2017 | Mars 2018 | Juin 2018 |
|-------------------------------------------|-------------------|--------------------------------------|----------------|---------------|-----------|-----------|
| Coupon | Échéance | | | | | |
| 3.5% | 1er décembre 2045 | 16400 | 0.6617 | 0.6629 | 0.6641 | 0.6653 |
| 2.75% | 1er décembre 2048 | 14500 | 0.5437 | 0.5450 | 0.5462 | 0.5476 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 30900 | 30900 | 30900 | 30900 |

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) | Septembre 2017 | Décembre 2017 | Mars 2018 | Juin 2018 |
|-------------------------------------------|---------------|--------------------------------------|----------------|---------------|-----------|-----------|
| Coupon | Échéance | | | | | |
| 1.5% | 1er Juin 2026 | 13500 | 0.6971 | 0.7038 | 0.7105 | 0.7174 |
| 1% | 1er Juin 2027 | 15000 | 0.6349 | 0.6419 | 0.6490 | 0.6562 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 28500 | 28500 | 28500 | 28500 |

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) | Septembre 2017 | Décembre 2017 | Mars 2018 | Juin 2018 |
|-------------------------------------------|--------------------|--------------------------------------|----------------|---------------|-----------|-----------|
| Coupon | Échéance | | | | | |
| 0.5% | 1er Mars 2022 | 15000 | 0.7859 | 0.7963 | | |
| 1% | 1er Septembre 2022 | 15600 | 0.7867 | 0.7960 | 0.8053 | 0.8148 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 30600 | 30600 | 15600 | 15600 |

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) | Septembre 2017 | Décembre 2017 | Mars 2018 | Juin 2018 |
|-------------------------------------------|-------------------|--------------------------------------|----------------|---------------|-----------|-----------|
| Coupon | Échéance | | | | | |
| 0.75% | 1er Mai 2019 | 15600 | 0.9179 | | | |
| 0.75% | 1er Août 2019 | 15600 | 0.9063 | 0.9179 | | |
| 1.25% | 1er Novembre 2019 | 7800 | 0.9048 | 0.9152 | 0.9257 | |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 39000 | 23400 | 7800 | 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).