

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 3 octobre 2018)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Décembre 2018	Mars 2019	Juin 2019	Septembre 2019
Coupon	Échéance					
3.5%	1er décembre 2045	16400	0.6678	0.6690	0.6703	0.6715
2.75%	1er décembre 2048	14900	0.5503	0.5516	0.5530	0.5544
2%	1er décembre 2051	3900	0.4281	0.4295	0.4309	0.4324
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			35200	35200	35200	35200

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 2018	Mars 2019	Juin 2019	Septembre 2019
Coupon	Échéance					
1%	1er Juin 2027	15000	0.6708	0.6783	0.6860	
2%	1er Juin 2028	13500	0.7135	0.7191	0.7249	0.7307
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			28500	28500	28500	13500

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 2018	Mars 2019	Juin 2019	Septembre 2019
Coupon	Échéance					
1.75%	1er Mars 2023	15000	0.8426			
2%	1er Septembre 2023	12000	0.8367	0.8443	0.8518	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			27000	12000	12000	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 (CAN \$ million)	Décembre 2018	Mars 2019	Juin 2019	Septembre 2019
Coupon	Échéance					
1.75%	1er Août 2020	12000	0.9335			
2%	1er Novembre 2020	9000	0.9286	0.9374		
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).