

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 24 avril 2020)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Juin 2020	Septembre 2020	Decembre 2020	Mars 2021
Coupon	Échéance					
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 (CAN \$ million)	Juin 2020	Septembre 2020	Decembre 2020	Mars 2021
Coupon	Échéance					
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	14700	0.6467	0.6532	0.6598	0.6665
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			40500	27000	27000	27000

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)	Juin 2020	Septembre 2020	Decembre 2020	Mars 2021
Coupon	Échéance					
1.25%	1er mars 2025	17300	0.8062	0.8151		
0.5%	1er septembre 2025	11000	0.7554	0.7654	0.7756	0.7859
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			28300	28300	11000	11000

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)	Juin 2020	Septembre 2020	Decembre 2020	Mars 2021
Coupon	Échéance					
1.5%	1er février 2022	12000	0.9296			
1.5%	1er mai 2022	20000	0.9196	0.9296		
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			32000	20000	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