

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 26 août 2020)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Septembre 2020	Decembre 2020	Mars 2021	Juin 2021
Coupon	Échéance					
3.5%	1er décembre 2045	16300	0.6769	0.6784		
2.75%	1er décembre 2048	14900	0.5602	0.5618	0.5633	0.5649
2%	1er décembre 2051	21817	0.4384	0.4400	0.4415	0.4432
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			53017	53017	36717	36717

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 2020	Decembre 2020	Mars 2021	Juin 2021
Coupon	Échéance					
2.25%	1er juin 2029	12300	0.7475	0.7531	0.7587	0.7645
1.25%	1er juin 2030	39200	0.6532	0.6598	0.6665	0.6734
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			51500	51500	51500	51500

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 2020	Decembre 2020	Mars 2021	Juin 2021
Coupon	Échéance					
1.25%	1er mars 2025	17300	0.8151			
0.5%	1er septembre 2025	42500	0.7654	0.7756	0.7859	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			59800	42500	42500	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)	Septembre 2020	Decembre 2020	Mars 2021	Juin 2021
Coupon	Échéance					
1.5%	1er mai 2022	20000	0.9296			
0.25%	1er août 2022	30000	0.8973	0.9101		
1%	1er septembre 2022	25200	0.9071			
0.25%	1er novembre 2022	12000	0.8848	0.8973	0.9101	
1.75%	1er mars 2023	24600	0.9027	0.9117		
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			111800	66600	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