

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 3 février 2021)**

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

| Obligations du gouvernement du Canada | | Montant en cours (CAN \$ million) | Mars 2021 | Juin 2021 | Septembre 2021 | Décembre 2021 |
|---|-------------------|--------------------------------------|-----------|-----------|----------------|---------------|
| Coupon | Échéance | | | | | |
| 2.75% | 1er décembre 2048 | 14900 | 0.5633 | 0.5649 | 0.5665 | 0.5681 |
| 2% | 1er décembre 2051 | 36817 | 0.4415 | 0.4432 | 0.4448 | 0.4465 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 51717 | 51717 | 51717 | 51717 |

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) | Mars 2021 | Juin 2021 | Septembre 2021 | Décembre 2021 |
|---|-------------------|--------------------------------------|-----------|-----------|----------------|---------------|
| Coupon | Échéance | | | | | |
| 2.25% | 1er juin 2029 | 12300 | 0.7587 | 0.7645 | | |
| 1.25% | 1er juin 2030 | 44200 | 0.6665 | 0.6734 | 0.6803 | 0.6873 |
| 0.5% | 1er décembre 2030 | 30000 | 0.5984 | 0.6061 | 0.6139 | 0.6218 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 86500 | 86500 | 74200 | 74200 |

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) | Mars 2021 | Juin 2021 | Septembre 2021 | Décembre 2021 |
|---|--------------------|--------------------------------------|-----------|-----------|----------------|---------------|
| Coupon | Échéance | | | | | |
| 0.5% | 1er septembre 2025 | 47500 | 0.7859 | | | |
| 0.25% | 1er mars 2026 | 22000 | 0.7548 | 0.7654 | 0.7761 | |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 69500 | 22000 | 22000 | 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) | Mars 2021 | Juin 2021 | Septembre 2021 | Décembre 2021 |
|---|--------------------|--------------------------------------|-----------|-----------|----------------|---------------|
| Coupon | Échéance | | | | | |
| 0.25% | 1er novembre 2022 | 37000 | 0.9101 | | | |
| 0.25% | 1er février 2023 | 32000 | 0.8973 | 0.9101 | | |
| 1.75% | 1er mars 2023 | 24600 | 0.9210 | | | |
| 2% | 1er septembre 2023 | 40500 | 0.9084 | 0.9169 | 0.9257 | |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 134100 | 72500 | 40500 | 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