

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 5 octobre 2021)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Décembre 2021	Mars 2022	Juin 2022	Septembre 2022
Coupon	Échéance					
2.75%	1er décembre 2048	14900	0.5681	0.5697	0.5714	0.5730
2%	1er décembre 2051	51817	0.4465	0.4481	0.4499	0.4516
1.75%	1er décembre 2053	9000	0.3985	0.4000	0.4017	0.4033
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			75717	75717	75717	75717

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	Décembre 2021	Mars 2022	Juin 2022	Septembre 2022
Coupon	Échéance					
1.25%	1er juin 2030	44200	0.6873	0.6944	0.7017	
0.5%	1er décembre 2030	40000	0.6218	0.6298	0.6379	0.6462
1.5%	1er juin 2031	42000	0.6777	0.6841	0.6905	0.6971
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			126200	126200	126200	82000

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 2021	Mars 2022	Juin 2022	Septembre 2022
Coupon	Échéance					
1%	1er septembre 2026	23000	0.7960	0.8053		
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			23000	23000	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 %

CONTRATS À TERME SUR OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA DE DEUX ANS - CGZ

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Décembre 2021	Mars 2022	Juin 2022	Septembre 2022
Coupon	Échéance					
0.25%	1er août 2023	20000	0.9101			
0.5%	1er novembre 2023	16500	0.9018	0.9140		
0.25%	1er avril 2024	37000	0.8765	0.8889		
0.75%	1er octobre 2024	8000			0.8872	0.8986
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			73500	53500	8000	8000

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