

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 25 août 2022)**

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

| Obligations du gouvernement du Canada | | Montant en cours (CAN \$ million) | Septembre 2022 | Decembre 2022 | Mars 2023 | Juin 2023 |
|---|-------------------|--------------------------------------|----------------|---------------|-----------|-----------|
| Coupon | Échéance | | | | | |
| 2% | 1er décembre 2051 | 51817 | 0.4516 | 0.4534 | 0.4551 | 0.4570 |
| 1.75% | 1er décembre 2053 | 27000 | 0.4033 | 0.4050 | 0.4066 | 0.4084 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 78817 | 78817 | 78817 | 78817 |

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 2022 | Decembre 2022 | Mars 2023 | Juin 2023 |
|---|-------------------|--------------------------------------|----------------|---------------|-----------|-----------|
| Coupon | Échéance | | | | | |
| 0.5% | 1er décembre 2030 | 40000 | 0.6462 | 0.6546 | | |
| 1.5% | 1er juin 2031 | 42000 | 0.6971 | 0.7038 | 0.7105 | 0.7174 |
| 1.5% | 1er décembre 2031 | 32000 | 0.6841 | 0.6905 | 0.6971 | 0.7038 |
| 2% | 1er juin 2032 | 24000 | 0.7079 | 0.7135 | 0.7191 | 0.7249 |
| 2.5% | 1er décembre 2022 | 6000 | 0.7349 | 0.7396 | 0.7444 | 0.7493 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 144000 | 144000 | 104000 | 104000 |

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 2022 | Decembre 2022 | Mars 2023 | Juin 2023 |
|---|--------------------|--------------------------------------|----------------|---------------|-----------|-----------|
| Coupon | Échéance | | | | | |
| 1.25% | 1er mars 2027 | 17000 | 0.8151 | | | |
| 2.75% | 1er septembre 2027 | 12000 | 0.8614 | 0.8673 | 0.8735 | |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 29000 | 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) | Septembre 2022 | Decembre 2022 | Mars 2023 | Juin 2023 |
|---|-------------------|--------------------------------------|----------------|---------------|-----------|-----------|
| Coupon | Échéance | | | | | |
| 1.5% | 1er mai 2024 | 16000 | 0.9296 | | | |
| 2.75% | 1er août 2024 | 16500 | 0.9419 | 0.9491 | | |
| 0.75% | 1er octobre 2024 | 14000 | 0.8986 | | | |
| 3% | 1er novembre 2024 | 4000 | 0.9398 | 0.9464 | 0.9530 | |
| 1.5% | 1er avril 2025 | 12000 | | 0.9033 | 0.9131 | 0.9229 |
| 3% | 1er octobre 2025 | 5000 | | | | 0.9355 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 50500 | 32500 | 16000 | 17000 |

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