

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 5 octobre 2022)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Decembre 2022	Mars 2023	Juin 2023	Septembre 2023
Coupon	Échéance					
2%	1er décembre 2051	51817	0.4534	0.4551	0.4570	
1.75%	1er décembre 2053	28500	0.4050	0.4066	0.4084	0.4101
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			80317	80317	80317	28500

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)	Decembre 2022	Mars 2023	Juin 2023	Septembre 2023
Coupon	Échéance					
0.5%	1er décembre 2030	40000	0.6546			
1.5%	1er juin 2031	42000	0.7038	0.7105	0.7174	
1.5%	1er décembre 2031	32000	0.6905	0.6971	0.7038	0.7105
2%	1er juin 2032	24000	0.7135	0.7191	0.7249	0.7307
2.5%	1er décembre 2032	13000	0.7396	0.7444	0.7493	0.7542
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			151000	111000	111000	69000

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)	Decembre 2022	Mars 2023	Juin 2023	Septembre 2023
Coupon	Échéance					
2.75%	1er septembre 2027	16000	0.8673	0.8735		
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			16000	16000	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)	Decembre 2022	Mars 2023	Juin 2023	Septembre 2023
Coupon	Échéance					
2.75%	1er août 2024	16500	0.9491			
3%	1er novembre 2024	12000	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			40500	24000	17000	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