

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

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Mars 2022	Juin 2022	Septembre 2022	Decembre 2022
Coupon	Échéance					
2%	1er décembre 2051	51817	0.4481	0.4499	0.4516	0.4534
1.75%	1er décembre 2053	15000	0.4000	0.4017	0.4033	0.4050
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			66817	66817	66817	66817

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 2022	Juin 2022	Septembre 2022	Decembre 2022
Coupon	Échéance					
1.25%	1er juin 2030	44200	0.6944	0.7017		
0.5%	1er décembre 2030	40000	0.6298	0.6379	0.6462	0.6546
1.5%	1er juin 2031	42000	0.6841	0.6905	0.6971	0.7038
1.5%	1er décembre 2031	17000	0.6714	0.6777	0.6841	0.6905
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			143200	143200	99000	99000

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 2022	Juin 2022	Septembre 2022	Decembre 2022
Coupon	Échéance					
1%	1er septembre 2026	23000	0.8053			
1.25%	1er mars 2027	9000	0.7974	0.8062	0.8151	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			32000	9000	9000	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 2022	Juin 2022	Septembre 2022	Decembre 2022
Coupon	Échéance					
0.5%	1er novembre 2023	16500	0.9140			
0.75%	1er février 2024	10500	0.9063	0.9179		
0.25%	1er avril 2024	37000	0.8889			
0.75%	1er octobre 2024	14000		0.8872	0.8986	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			64000	24500	14000	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