

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

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Juin 2022	Septembre 2022	Decembre 2022	Mars 2023
Coupon	Échéance					
2%	1er décembre 2051	51817	0.4499	0.4516	0.4534	0.4551
1.75%	1er décembre 2053	23000	0.4017	0.4033	0.4050	0.4066
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			74817	74817	74817	74817

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)	Juin 2022	Septembre 2022	Decembre 2022	Mars 2023
Coupon	Échéance					
1.25%	1er juin 2030	44200	0.7017			
0.5%	1er décembre 2030	40000	0.6379	0.6462	0.6546	
1.5%	1er juin 2031	42000	0.6905	0.6971	0.7038	0.7105
1.5%	1er décembre 2031	32000	0.6777	0.6841	0.6905	0.6971
2%	1er juin 2032	17000	0.7025	0.7079	0.7135	0.7191
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			175200	131000	131000	91000

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)	Juin 2022	Septembre 2022	Decembre 2022	Mars 2023
Coupon	Échéance					
1.25%	1er mars 2027	17000	0.8062	0.8151		
2.75%	1er septembre 2027	4000	0.8554	0.8614	0.8673	0.8735
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			21000	21000	4000	4000

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)	Juin 2022	Septembre 2022	Decembre 2022	Mars 2023
Coupon	Échéance					
0.75%	1er février 2024	17500	0.9179			
1.5%	1er mai 2024	16000	0.9196	0.9296		
2.75%	1er août 2024	4500		0.9419	0.9491	
0.75%	1er octobre 2024	14000	0.8872	0.8986		
1.5%	1er avril 2025	9000			0.9033	0.9131
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			47500	34500	13500	9000

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