

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 25 septembre 2020)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Decembre 2020	Mars 2021	Juin 2021	Septembre 2021
Coupon	Échéance					
3.5%	1er décembre 2045	16300	0.6784			
2.75%	1er décembre 2048	14900	0.5618	0.5633	0.5649	0.5665
2%	1er décembre 2051	24817	0.4400	0.4415	0.4432	0.4448
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			56017	39717	39717	39717

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 2020	Mars 2021	Juin 2021	Septembre 2021
Coupon	Échéance					
2.25%	1er juin 2029	12300	0.7531	0.7587	0.7645	
1.25%	1er juin 2030	44200	0.6598	0.6665	0.6734	0.6803
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			56500	56500	56500	44200

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 2020	Mars 2021	Juin 2021	Septembre 2021
Coupon	Échéance					
0.5%	1er septembre 2025	47500	0.7756	0.7859		
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			47500	47500	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

***** La négociation sur CGZ est temporairement suspendue *****

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Decembre 2020	Mars 2021	Juin 2021	Septembre 2021
Coupon	Échéance					
0.25%	1er août 2022	30000	0.9101			
0.25%	1er novembre 2022	24000	0.8973	0.9101		
1.75%	1er mars 2023	24600	0.9117			
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			78600	24000	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 %

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