

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 3 novembre 2020)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours	Decembre 2020	Mars 2021	Juin 2021	Septembre 2021
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
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	30817	0.4400	0.4415	0.4432	0.4448
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			62017	45717	45717	45717

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	Decembre 2020	Mars 2021	Juin 2021	Septembre 2021
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
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
0.5%	1er décembre 2030	10000	0.5909	0.5984	0.6061	0.6139
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			66500	66500	66500	54200

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	Decembre 2020	Mars 2021	Juin 2021	Septembre 2021
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
0.5%	1er septembre 2025	47500	0.7756	0.7859		
0.25%	1er mars 2026	10000	0.7443	0.7548	0.7654	0.7761
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			57500	57500	10000	10000

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	Decembre 2020	Mars 2021	Juin 2021	Septembre 2021
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
0.25%	1er août 2022	30000	0.9101			
0.25%	1er novembre 2022	37000	0.8973	0.9101		
0.25%	1er février 2023	12000	0.8848	0.8973	0.9101	
1.75%	1er mars 2023	24600	0.9117	0.9210		
2%	1er septembre 2023	40500		0.9084	0.9169	0.9257
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			103600	114100	52500	40500

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