

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 25 février 2021)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Mars 2021	Juin 2021	Septembre 2021	Décembre 2021
Coupon	Échéance					
2.75%	1er décembre 2048	14900	0.5633	0.5649	0.5665	0.5681
2%	1er décembre 2051	39817	0.4415	0.4432	0.4448	0.4465
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			54717	54717	54717	54717

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 2021	Juin 2021	Septembre 2021	Décembre 2021
Coupon	Échéance					
2.25%	1er juin 2029	12300	0.7587	0.7645		
1.25%	1er juin 2030	44200	0.6665	0.6734	0.6803	0.6873
0.5%	1er décembre 2030	30000	0.5984	0.6061	0.6139	0.6218
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			86500	86500	74200	74200

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 2021	Juin 2021	Septembre 2021	Décembre 2021
Coupon	Échéance					
0.5%	1er septembre 2025	47500	0.7859			
0.25%	1er mars 2026	26000	0.7548	0.7654	0.7761	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			73500	26000	26000	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 2021	Juin 2021	Septembre 2021	Décembre 2021
Coupon	Échéance					
0.25%	1er novembre 2022	37000	0.9101			
0.25%	1er février 2023	32000	0.8973	0.9101		
1.75%	1er mars 2023	24600	0.9210			
0.25%	1er mai 2023	12000	0.8848	0.8973	0.9101	
2%	1er septembre 2023	40500	0.9084	0.9169	0.9257	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			146100	84500	52500	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