

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 5 avril 2021)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Juin 2021	Septembre 2021	Décembre 2021	Mars 2022
Coupon	Échéance					
2.75%	1er décembre 2048	14900	0.5649	0.5665	0.5681	0.5697
2%	1er décembre 2051	42817	0.4432	0.4448	0.4465	0.4481
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			57717	57717	57717	57717

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 2021	Septembre 2021	Décembre 2021	Mars 2022
Coupon	Échéance					
2.25%	1er juin 2029	12300	0.7645			
1.25%	1er juin 2030	44200	0.6734	0.6803	0.6873	0.6944
0.5%	1er décembre 2030	40000	0.6061	0.6139	0.6218	0.6298
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			96500	84200	84200	84200

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 2021	Septembre 2021	Décembre 2021	Mars 2022
Coupon	Échéance					
0.25%	1er mars 2026	34000	0.7654	0.7761		
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			34000	34000	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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Juin 2021	Septembre 2021	Décembre 2021	Mars 2022
Coupon	Échéance					
0.25%	1er février 2023	32000	0.9101			
0.25%	1er mai 2023	24000	0.8973	0.9101		
2%	1er septembre 2023	40500	0.9169	0.9257		
0.25%	1er avril 2024	28000			0.8765	0.8889
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			96500	64500	28000	28000

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