

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 26 mai 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	48817	0.4432	0.4448	0.4465	0.4481
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			63717	63717	63717	63717

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
1.5%	1er juin 2031	11000	0.6653	0.6714	0.6777	0.6841
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			107500	95200	95200	95200

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		
1%	1er septembre 2026	8000	0.7776	0.7867	0.7960	0.8053
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			42000	42000	8000	8000

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	30000	0.8973	0.9101		
0.25%	1er août 2023	5000	0.8848	0.8973	0.9101	
2%	1er septembre 2023	40500	0.9169	0.9257		
0.25%	1er avril 2024	37000			0.8765	0.8889
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			107500	75500	42000	37000

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