

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES  
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE  
(Au 3 août 2021)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Septembre 2021	Décembre 2021	Mars 2022	Juin 2022
Coupon	Échéance					
2.75%	1er décembre 2048	14900	0.5665	0.5681	0.5697	0.5714
2%	1er décembre 2051	51817	0.4448	0.4465	0.4481	0.4499
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			66717	66717	66717	66717

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)	Septembre 2021	Décembre 2021	Mars 2022	Juin 2022
Coupon	Échéance					
1.25%	1er juin 2030	44200	0.6803	0.6873	0.6944	0.7017
0.5%	1er décembre 2030	40000	0.6139	0.6218	0.6298	0.6379
1.5%	1er juin 2031	26500	0.6714	0.6777	0.6841	0.6905
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			110700	110700	110700	110700

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)	Septembre 2021	Décembre 2021	Mars 2022	Juin 2022
Coupon	Échéance					
0.25%	1er mars 2026	34000	0.7761			
1%	1er septembre 2026	16000	0.7867	0.7960	0.8053	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			50000	16000	16000	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)	Septembre 2021	Décembre 2021	Mars 2022	Juin 2022
Coupon	Échéance					
0.25%	1er mai 2023	30000	0.9101			
0.25%	1er août 2023	20000	0.8973	0.9101		
2%	1er septembre 2023	40500	0.9257			
0.25%	1er avril 2024	37000		0.8765	0.8889	
0,75%	1er octobre 2024	4500				0.8872
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			90500	57000	37000	4500

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