

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES  
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE  
(Au 26 novembre 2021)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Décembre 2021	Mars 2022	Juin 2022	Septembre 2022
Coupon	Échéance					
2%	1er décembre 2051	51817	0.4465	0.4481	0.4499	0.4516
1.75%	1er décembre 2053	13000	0.3985	0.4000	0.4017	0.4033
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			64817	64817	64817	64817

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)	Décembre 2021	Mars 2022	Juin 2022	Septembre 2022
Coupon	Échéance					
1.25%	1er juin 2030	44200	0.6873	0.6944	0.7017	
0.5%	1er décembre 2030	40000	0.6218	0.6298	0.6379	0.6462
1.5%	1er juin 2031	42000	0.6777	0.6841	0.6905	0.6971
1.5%	1er décembre 2031	9000	0.6653	0.6714	0.6777	0.6841
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			135200	135200	135200	91000

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)	Décembre 2021	Mars 2022	Juin 2022	Septembre 2022
Coupon	Échéance					
1%	1er septembre 2026	23000	0.7960	0.8053		
1.25%	1er mars 2027	9000	0.7887	0.7974	0.8062	0.8151
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			32000	32000	9000	9000

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)	Décembre 2021	Mars 2022	Juin 2022	Septembre 2022
Coupon	Échéance					
0.25%	1er août 2023	20000	0.9101			
0.5%	1er novembre 2023	16500	0.9018	0.9140		
0.75%	1er février 2024	7000	0.8948	0.9063	0.9179	
0.25%	1er avril 2024	37000	0.8765	0.8889	0.9016	0.9144
0.75%	1er octobre 2024	14000			0.8872	0.8986
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			80500	60500	58000	51000

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