

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES  
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE  
(Au 4 novembre 2022)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Decembre 2022	Mars 2023	Juin 2023	Septembre 2023
Coupon	Échéance					
2%	1er décembre 2051	51817	0.4534	0.4551	0.4570	
1.75%	1er décembre 2053	30500	0.4050	0.4066	0.4084	0.4101
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			82317	82317	82317	30500

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)	Decembre 2022	Mars 2023	Juin 2023	Septembre 2023
Coupon	Échéance					
0.5%	1er décembre 2030	40000	0.6546			
1.5%	1er juin 2031	42000	0.7038	0.7105	0.7174	
1.5%	1er décembre 2031	32000	0.6905	0.6971	0.7038	0.7105
2%	1er juin 2032	24000	0.7135	0.7191	0.7249	0.7307
2.5%	1er décembre 2032	17000	0.7396	0.7444	0.7493	0.7542
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			155000	115000	115000	73000

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)	Decembre 2022	Mars 2023	Juin 2023	Septembre 2023
Coupon	Échéance					
2.75%	1er septembre 2027	16000	0.8673	0.8735		
3.5%	1er mars 2028	4000	0.8888	0.8934	0.8979	0.9027
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			20000	20000	4000	4000

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)	Decembre 2022	Mars 2023	Juin 2023	Septembre 2023
Coupon	Échéance					
2.75%	1er août 2024	16500	0.9491			
3%	1er novembre 2024	16000	0.9464	0.9530		
3.75%	1er février 2025	4000	0.9549	0.9598	0.9648	
1.5%	1er avril 2025	12000	0.9033	0.9131	0.9229	
3%	1er octobre 2025	7500			0.9355	0.9420
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			48500	32000	23500	7500

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