

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES  
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE  
(Au 7 juillet 2021)**

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

| Obligations du gouvernement du Canada     |                   | Montant en cours<br>(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<br>(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     | 21000                                | 0.6714         | 0.6777        | 0.6841    | 0.6905    |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS |                   |                                      | 105200         | 105200        | 105200    | 105200    |

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<br>(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<br>(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      | 15000                                | 0.8973         | 0.9101        |           |           |
| 2%  | 1er septembre 2023 | 40500                                | 0.9257         |               |           |           |
| 0.25%                                     | 1er avril 2024     | 37000                                |                | 0.8765        | 0.8889    |           |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS |                    |                                      | 85500          | 52000         | 37000     | N/A       |

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