

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 31 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
1.75%	1er décembre 2053	6000	0.3969	0.3985	0.4000	0.4017
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			72717	72717	72717	72717

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	37000	0.6714	0.6777	0.6841	0.6905
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			121200	121200	121200	121200

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	19500	0.7867	0.7960	0.8053	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			53500	19500	19500	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			
0.5%	1er novembre 2023	8500	0.8898	0.9018	0.9140	
0.25%	1er avril 2024	37000		0.8765	0.8889	
0.75%	1er octobre 2024	8000				0.8872
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			99000	65500	45500	8000

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