

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 25 août 2022)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Septembre 2022	Decembre 2022	Mars 2023	Juin 2023
Coupon	Échéance					
2%	1er décembre 2051	51817	0.4516	0.4534	0.4551	0.4570
1.75%	1er décembre 2053	27000	0.4033	0.4050	0.4066	0.4084
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			78817	78817	78817	78817

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 2022	Decembre 2022	Mars 2023	Juin 2023
Coupon	Échéance					
0.5%	1er décembre 2030	40000	0.6462	0.6546		
1.5%	1er juin 2031	42000	0.6971	0.7038	0.7105	0.7174
1.5%	1er décembre 2031	32000	0.6841	0.6905	0.6971	0.7038
2%	1er juin 2032	24000	0.7079	0.7135	0.7191	0.7249
2.5%	1er décembre 2022	6000	0.7349	0.7396	0.7444	0.7493
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			144000	144000	104000	104000

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 2022	Decembre 2022	Mars 2023	Juin 2023
Coupon	Échéance					
1.25%	1er mars 2027	17000	0.8151			
2.75%	1er septembre 2027	12000	0.8614	0.8673	0.8735	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			29000	12000	12000	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 2022	Decembre 2022	Mars 2023	Juin 2023
Coupon	Échéance					
1.5%	1er mai 2024	16000	0.9296			
2.75%	1er août 2024	16500	0.9419	0.9491		
0.75%	1er octobre 2024	14000	0.8986			
3%	1er novembre 2024	4000	0.9398	0.9464	0.9530	
1.5%	1er avril 2025	12000		0.9033	0.9131	0.9229
3%	1er octobre 2025	5000				0.9355
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			50500	32500	16000	17000

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