

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 9 janvier 2023)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Mars 2023	Juin 2023	Septembre 2023	Decembre 2023
Coupon	Échéance					
2%	1er décembre 2051	51817	0.4551	0.4570		
1.75%	1er décembre 2053	32000	0.4066	0.4084	0.4101	0.4119
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			83817	83817	32000	32000

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)	Mars 2023	Juin 2023	Septembre 2023	Decembre 2023
Coupon	Échéance					
1.5%	1er juin 2031	42000	0.7105	0.7174		
1.5%	1er décembre 2031	32000	0.6971	0.7038	0.7105	0.7174
2%	1er juin 2032	24000	0.7191	0.7249	0.7307	0.7367
2.5%	1er décembre 2032	21000	0.7444	0.7493	0.7542	0.7593
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			119000	119000	77000	77000

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)	Mars 2023	Juin 2023	Septembre 2023	Decembre 2023
Coupon	Échéance					
2.75%	1er septembre 2027	16000	0.8735			
3.5%	1er mars 2028	7500	0.8934	0.8979	0.9027	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			23500	7500	7500	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)	Mars 2023	Juin 2023	Septembre 2023	Decembre 2023
Coupon	Échéance					
3%	1er novembre 2024	16000	0.9530			
3.75%	1er février 2025	11000	0.9598	0.9648		
1.5%	1er avril 2025	12000	0.9131	0.9229		
3%	1er octobre 2025	10000		0.9355	0.9420	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			39000	33000	10000	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