

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(au 23 août 2024)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Septembre 2024	Décembre 2024	Mars 2025	Juin 2025
Coupon	Échéance					
1.75%	1er décembre 2053	32000	0.4173	0.4192	0.4211	0.4230
2.75%	1er décembre 2055	22750	0.5437	0.5450	0.5462	0.5476
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			54750	54750	54750	54750

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 2024	Décembre 2024	Mars 2025	Juin 2025
Coupon	Échéance					
2.5%	1er décembre 2032	21000	0.7748	0.7802		
2.75%	1er juin 2033	19000	0.7812	0.7861	0.7909	0.7959
3.25%	1er décembre 2033	21000	0.8069	0.8109	0.8148	0.8190
3%	1er juin 2034	34000	0.7809	0.7851	0.7893	0.7937
3.25%	1er décembre 2034	10000	0.7917	0.7954	0.7992	0.8030
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			105000	105000	84000	84000

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 2024	Décembre 2024	Mars 2025	Juin 2025
Coupon	Échéance					
4%	1er mars 2029	27000	0.9221			
3.5%	1er septembre 2029	25000	0.8934	0.8979	0.9027	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			52000	25000	25000	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 2024	Décembre 2024	Mars 2025	Juin 2025
Coupon	Échéance					
4%	1er mai 2026	26000	0.9687			
4%	1er août 2026	22000	0.9643	0.9687		
3.25%	1er novembre 2026	5500	0.9448	0.9509	0.9569	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			53500	27500	5500	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