

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 2 mai 2023)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Juin 2023 *	Septembre 2023	Decembre 2023	Mars 2024
Coupon	Échéance					
2%	1er décembre 2051	51817	0.4570			
1.75%	1er décembre 2053	32000	0.4084	0.4101	0.4119	0.4137
2.75%	1er décembre 2055	4250		0.5388	0.5400	0.5412
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			83817	36250	36250	36250

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)	Juin 2023	Septembre 2023	Decembre 2023	Mars 2024
Coupon	Échéance					
1.5%	1er juin 2031	42000	0.7174			
1.5%	1er décembre 2031	32000	0.7038	0.7105	0.7174	
2%	1er juin 2032	24000	0.7249	0.7307	0.7367	0.7426
2.5%	1er décembre 2032	21000	0.7493	0.7542	0.7593	0.7644
2.75%	1er juin 2033	15500	0.7582	0.7627	0.7672	0.7718
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			134500	92500	92500	60500

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)	Juin 2023	Septembre 2023	Decembre 2023	Mars 2024
Coupon	Échéance					
3.5%	1er mars 2028	15000	0.8979	0.9027		
3.25%	1er septembre 2028	5000	0.8776	0.8827	0.8877	0.8929
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			20000	20000	5000	5000

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)	Juin 2023	Septembre 2023	Decembre 2023	Mars 2024
Coupon	Échéance					
3.75%	1er février 2025	15000	0.9648			
1.5%	1er avril 2025	12000	0.9229			
3.75%	1er mai 2025	15250	0.9598	0.9648		
3%	1er octobre 2025	10000	0.9355	0.9420		
3%	1er avril 2026	7000			0.9355	0.9420
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			52250	25250	7000	7000

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

* LGBM23 expiration : CAN 2.75 12/01/2055 est exclu (référence Avis informationnel A23-002)