

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(au 5 octobre 2023)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Decembre 2023	Mars 2024	Juin 2024	Septembre 2024
Coupon	Échéance					
1.75%	1er décembre 2053	32000	0.4119	0.4137	0.4155	0.4173
2.75%	1er décembre 2055	8000	0.5400	0.5412	0.5425	0.5437
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			40000	40000	40000	40000

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)	Decembre 2023	Mars 2024	Juin 2024	Septembre 2024
Coupon	Échéance					
1.5%	1er décembre 2031	32000	0.7174			
2%	1er juin 2032	24000	0.7367	0.7426	0.7488	
2.5%	1er decembre 2032	21000	0.7593	0.7644	0.7696	0.7748
2.75%	1er juin 2033	19000	0.7672	0.7718	0.7765	0.7812
3.25%	1er décembre 2033	13000	0.7954	0.7992	0.8030	0.8069
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			109000	77000	77000	53000

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)	Decembre 2023	Mars 2024	Juin 2024	Septembre 2024
Coupon	Échéance					
3.25%	1er septembre 2028	20000	0.8877	0.8929		
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			20000	20000	N/A	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)	Decembre 2023	Mars 2024	Juin 2024	Septembre 2024
Coupon	Échéance					
3.5%	1er août 2025	19000	0.9608			
4.5%	1er novembre 2025	19750	0.9732	0.9765		
3%	1er avril 2025	10000	0.9355	0.9420	0.9486	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			48750	29750	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