

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(au 5 janvier 2024)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Mars 2024	Juin 2024	Septembre 2024	Décembre 2024
Coupon	Échéance					
1.75%	1er décembre 2053	32000	0.4137	0.4155	0.4173	0.4192
2.75%	1er décembre 2055	11750	0.5412	0.5425	0.5437	0.5450
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			43750	43750	43750	43750

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 2024	Juin 2024	Septembre 2024	Décembre 2024
Coupon	Échéance					
2%	1er juin 2032	24000	0.7426	0.7488		
2.5%	1er décembre 2032	21000	0.7644	0.7696	0.7748	0.7802
2.75%	1er juin 2033	19000	0.7718	0.7765	0.7812	0.7861
3.25%	1er décembre 2033	21000	0.7992	0.8030	0.8069	0.8109
3%	1er juin 2034	4000	0.7727	0.7768	0.7809	0.7851
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			89000	89000	65000	65000

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 2024	Juin 2024	Septembre 2024	Décembre 2024
Coupon	Échéance					
3.25%	1er septembre 2028	20000	0.8929			
4%	1er mars 2029	12000	0.9147	0.9183	0.9221	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			32000	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)	Mars 2024	Juin 2024	Septembre 2024	Décembre 2024
Coupon	Échéance					
4.5%	1er novembre 2025	19750	0.9765			
3%	1er avril 2026	10000	0.9420			
4.5%	1er février 2026	16500	0.9732	0.9765		
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			46250	16500	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 %

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