

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES  
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE  
( au 22 novembre 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	9250	0.5400	0.5412	0.5425	0.5437
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			41250	41250	41250	41250

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	17000	0.7954	0.7992	0.8030	0.8069
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			113000	81000	81000	57000

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		
4%	1er mars 2029	8000	0.9110	0.9147	0.9183	0.9221
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			28000	28000	8000	8000

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 2026	10000	0.9355	0.9420		
4.5%	1er février 2026	11000	0.9699	0.9732	0.9765	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			59750	40750	11000	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