

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(au 7 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 | 4000 | 0.9110 | 0.9147 | 0.9183 | 0.9221 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 24000 | 24000 | 4000 | 4000 |

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 | 5500 | 0.9699 | 0.9732 | 0.9765 | |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 54250 | 35250 | 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