

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(Au 6 juillet 2023)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Septembre 2023	Decembre 2023	Mars 2024	Juin 2024
Coupon	Échéance					
1.75%	1er décembre 2053	32000	0.4101	0.4119	0.4137	0.4155
2.75%	1er décembre 2055	5550	0.5388	0.5400	0.5412	0.5425
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			37550	37550	37550	37550

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)	Septembre 2023	Decembre 2023	Mars 2024	Juin 2024
Coupon	Échéance					
1.5%	1er décembre 2031	32000	0.7105	0.7174		
2%	1er juin 2031	24000	0.7307	0.7367	0.7426	0.7488
2.5%	1er decembre 2032	21000	0.7542	0.7593	0.7644	0.7696
2.75%	1er juin 2032	19000	0.7627	0.7672	0.7718	0.7765
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			96000	96000	64000	64000

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)	Septembre 2023	Decembre 2023	Mars 2024	Juin 2024
Coupon	Échéance					
3.5%	1er mars 2028	15000	0.9027			
3.25%	1er septembre 2028	15000	0.8827	0.8877	0.8929	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			30000	15000	15000	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)	Septembre 2023	Decembre 2023	Mars 2024	Juin 2024
Coupon	Échéance					
3.75%	1er mai 2025	15250	0.9648			
3.5%	1er août 2025	14250	0.9553	0.9608		
3%	1er octobre 2025	10000	0.9420			
3%	1er avril 2026	10000		0.9355	0.9420	0.9486
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			39500	24250	10000	10000

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