

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(au 24 mai 2024)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Juin 2024	Septembre 2024	Décembre 2024	Mars 2025
Coupon	Échéance					
1.75%	1er décembre 2053	32000	0.4155	0.4173	0.4192	0.4211
2.75%	1er décembre 2055	18750	0.5425	0.5437	0.5450	0.5462
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			50750	50750	50750	50750

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)	Juin 2024	Septembre 2024	Décembre 2024	Mars 2025
Coupon	Échéance					
2%	1er juin 2032	24000	0.7488			
2.5%	1er décembre 2032	21000	0.7696	0.7748	0.7802	
2.75%	1er juin 2033	19000	0.7765	0.7812	0.7861	0.7909
3.25%	1er décembre 2033	21000	0.8030	0.8069	0.8109	0.8148
3%	1er juin 2034	29000	0.7768	0.7809	0.7851	0.7893
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			114000	90000	90000	69000

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)	Juin 2024	Septembre 2024	Décembre 2024	Mars 2025
Coupon	Échéance					
4%	1er mars 2029	27000	0.9183	0.9221		
3.5%	1er septembre 2029	10000	0.8888	0.8934	0.8979	0.9027
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			37000	37000	10000	10000

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)	Juin 2024	Septembre 2024	Décembre 2024	Mars 2025
Coupon	Échéance					
4.5%	1er février 2026	23000	0.9765			
4%	1er mai 2026	26000	0.9643	0.9687		
4%	1er août 2026	6000	0.9599	0.9643	0.9687	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			55000	32000	6000	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