

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(au 8 octobre 2024)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Décembre 2024	Mars 2025	Juin 2025	Septembre 2025
Coupon	Échéance					
1.75%	1er décembre 2053	32000	0.4192	0.4211	0.4230	
2.75%	1er décembre 2055	24750	0.5450	0.5462	0.5476	0.5489
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			56750	56750	56750	24750

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)	Décembre 2024	Mars 2025	Juin 2025	Septembre 2025
Coupon	Échéance					
2.5%	1er décembre 2032	21000	0.7802			
2.75%	1er juin 2033	19000	0.7861	0.7909	0.7959	
3.25%	1er décembre 2033	21000	0.8109	0.8148	0.8190	0.8230
3%	1er juin 2034	34000	0.7851	0.7893	0.7937	0.7980
3.25%	1er décembre 2034	15000	0.7954	0.7992	0.8030	0.8069
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			110000	89000	89000	70000

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)	Décembre 2024	Mars 2025	Juin 2025	Septembre 2025
Coupon	Échéance					
3.5%	1er septembre 2029	30000	0.8979	0.9027		
2.75%	1er mars 2030	5000	0.8554	0.8614	0.8673	0.8735
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			35000	35000	5000	5000

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)	Décembre 2024	Mars 2025	Juin 2025	Septembre 2025
Coupon	Échéance					
4%	1er août 2026	22000	0.9687			
3.25%	1er novembre 2026	16500	0.9509	0.9569		
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			38500	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