

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES  
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE  
( au 7 Mai 2025)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Juin 2025	Septembre 2025	Décembre 2025	Mars 2026
Coupon	Échéance					
1.75%	1er décembre 2053	32000	0.4230			
2.75%	1er décembre 2055	28750	0.5476	0.5489	0.5503	0.5516
3.5%	1er décembre 2057	8000	0.6443	0.6452	0.6462	0.6470
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			68750	36750	36750	36750

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 2025	Septembre 2025	Décembre 2025	Mars 2026
Coupon	Échéance					
2.75%	1er juin 2033	19000	0.7959			
3.25%	1er décembre 2033	21000	0.8190	0.8230	0.8273	
3%	1er juin 2034	34000	0.7937	0.7980	0.8025	0.8070
3.25%	1er décembre 2034	30000	0.8030	0.8069	0.8109	0.8148
3.25%	1er juin 2035	28500	0.7954	0.7992	0.8030	0.8069
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			132500	113500	113500	92500

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 2025	Septembre 2025	Décembre 2025	Mars 2026
Coupon	Échéance					
2.75%	1er mars 2030	33000	0.8673	0.8735		
2.75%	1er septembre 2030	10500	0.8554	0.8614	0.8673	0.8735
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			43500	43500	10500	10500

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 2025	Septembre 2025	Décembre 2025	Mars 2026
Coupon	Échéance					
3%	1er février 2027	27500	0.9530			
2.75%	1er mai 2027	28500	0.9419	0.9491		
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			56000	28500	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