

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES  
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE  
( au 26 Mai 2025)**

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

| Obligations du gouvernement du Canada     |                   | Montant en cours | Juin 2025 | Septembre 2025 | Décembre 2025 | Mars 2026 |
|---|-------------------|------------------|-----------|----------------|---------------|-----------|
| Coupon                                    | Échéance          | (CAN \$ million) |           |                |               |           |
| 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 | 11000            | 0.6443    | 0.6452         | 0.6462        | 0.6470    |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS |                   |                  | 71750     | 39750          | 39750         | 39750     |

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 | Juin 2025 | Septembre 2025 | Décembre 2025 | Mars 2026 |
|---|-------------------|------------------|-----------|----------------|---------------|-----------|
| Coupon                                    | Échéance          | (CAN \$ million) |           |                |               |           |
| 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 | Juin 2025 | Septembre 2025 | Décembre 2025 | Mars 2026 |
|---|--------------------|------------------|-----------|----------------|---------------|-----------|
| Coupon                                    | Échéance           | (CAN \$ million) |           |                |               |           |
| 2.75%                                     | 1er mars 2030      | 33000            | 0.8673    | 0.8735         |               |           |
| 2.75%                                     | 1er septembre 2030 | 15750            | 0.8554    | 0.8614         | 0.8673        | 0.8735    |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS |                    |                  | 48750     | 48750          | 15750         | 15750     |

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 | Juin 2025 | Septembre 2025 | Décembre 2025 | Mars 2026 |
|---|------------------|------------------|-----------|----------------|---------------|-----------|
| Coupon                                    | Échéance         | (CAN \$ million) |           |                |               |           |
| 3%  | 1er février 2027 | 27500            | 0.9530    |                |               |           |
| 2.75%                                     | 1er mai 2027     | 28500            | 0.9419    | 0.9491         |               |           |
| 2.5%                                      | 1er août 2027    | 6000             | 0.9298    | 0.9375         | 0.9452        |           |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS |                  |                  | 62000     | 34500          | 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