

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(au 5 Aout 2025)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours	Septembre 2025	Décembre 2025	Mars 2026	Juin 2026
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
2.75%	1er décembre 2055	28750	0.5489	0.5503	0.5516	0.5530
3.5%	1er décembre 2057	14000	0.6452	0.6462	0.6470	0.6481
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			42750	42750	42750	42750

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	Septembre 2025	Décembre 2025	Mars 2026	Juin 2026
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
3.25%	1er décembre 2033	21000	0.8230	0.8273		
3%	1er juin 2034	34000	0.7980	0.8025	0.8070	0.8116
3.25%	1er décembre 2034	30000	0.8069	0.8109	0.8148	0.8190
3.25%	1er juin 2035	39000	0.7992	0.8030	0.8069	0.8109
3.25%	1er décembre 2035	5250	0.7917	0.7954	0.7992	0.8030
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			129250	129250	108250	108250

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	Septembre 2025	Décembre 2025	Mars 2026	Juin 2026
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
2.75%	1er mars 2030	33000	0.8735			
2.75%	1er septembre 2030	26250	0.8614	0.8673	0.8735	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			59250	26250	26250	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	Septembre 2025	Décembre 2025	Mars 2026	Juin 2026
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
2.75%	1er mai 2027	28500	0.9491			
2.5%	1er aout 2027	30000	0.9375	0.9452		
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			58500	30000	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