

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(au 07 Octobre 2025)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Décembre 2025	Mars 2026	Juin 2026	Septembre 2026
Coupon	Échéance					
2.75%	1er décembre 2055	28750	0.5503	0.5516	0.5530	0.5544
3.5%	1er décembre 2057	17000	0.6462	0.6470	0.6481	0.6490
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			45750	45750	45750	45750

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 2025	Mars 2026	Juin 2026	Septembre 2026
Coupon	Échéance					
3.25%	1er décembre 2033	21000	0.8273			
3%	1er juin 2034	34000	0.8025	0.8070	0.8116	
3.25%	1er décembre 2034	30000	0.8109	0.8148	0.8190	0.8230
3.25%	1er juin 2035	39000	0.8030	0.8069	0.8109	0.8148
3.25%	1er décembre 2035	21000	0.7954	0.7992	0.8030	0.8069
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			145000	124000	124000	90000

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 2025	Mars 2026	Juin 2026	Septembre 2026
Coupon	Échéance					
2.75%	1er septembre 2030	42000	0.8673	0.8735		
2.75%	1er Mars 2031	5250	0.8554	0.8614	0.8673	0.8735
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			47250	47250	5250	5250

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 2025	Mars 2026	Juin 2026	Septembre 2026
Coupon	Échéance					
2.5%	1er aout 2027	30000	0.9452			
2.5%	1er novembre 2027	18000	0.9375	0.9452		
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			48000	18000	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