

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

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Mars 2025	Juin 2025	Septembre 2025	Décembre 2025
Coupon	Échéance					
1.75%	1er décembre 2053	32000	0.4211	0.4230		
2.75%	1er décembre 2055	28750	0.5462	0.5476	0.5489	0.5503
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			60750	60750	28750	28750

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)	Mars 2025	Juin 2025	Septembre 2025	Décembre 2025
Coupon	Échéance					
2.75%	1er juin 2033	19000	0.7909	0.7959		
3.25%	1er décembre 2033	21000	0.8148	0.8190	0.8230	0.8273
3%	1er juin 2034	34000	0.7893	0.7937	0.7980	0.8025
3.25%	1er décembre 2034	30000	0.7992	0.8030	0.8069	0.8109
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			104000	104000	85000	85000

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)	Mars 2025	Juin 2025	Septembre 2025	Décembre 2025
Coupon	Échéance					
3.5%	1er septembre 2029	30000	0.9027			
2.75%	1er mars 2030	15000	0.8614	0.8673	0.8735	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			45000	15000	15000	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 (CAN \$ million)	Mars 2025	Juin 2025	Septembre 2025	Décembre 2025
Coupon	Échéance					
3.25%	1er novembre 2026	21500	0.9569			
3%	1er février 2027	16500	0.9464	0.9530		
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			38000	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