

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES  
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE  
( au 09 Février 2026)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours	Mars 2026	Juin 2026	Septembre 2026	Decembre 2026
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
2.75%	1er décembre 2055	28750	0.5516	0.5530	0.5544	0.5559
3.5%	1er décembre 2057	26000	0.6470	0.6481	0.6490	0.6500
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			54750	54750	54750	54750

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	Mars 2026	Juin 2026	Septembre 2026	Decembre 2026
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
3%	1er Juin 2034	34000	0.8070	0.8116		
3.25%	1er décembre 2034	30000	0.8148	0.8190	0.8230	0.8273
3.25%	1er Juin 2035	39000	0.8069	0.8109	0.8148	0.8190
3.25%	1er décembre 2035	42000	0.7992	0.8030	0.8069	0.8109
3.25%	1er Juin 2036	5250	0.7917	0.7954	0.7992	0.8030
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			150250	150250	116250	116250

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	Mars 2026	Juin 2026	Septembre 2026	Decembre 2026
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
2.75%	1er septembre 2030	42000	0.8735			
2.75%	1er mars 2031	31500	0.8614	0.8673	0.8735	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			73500	31500	31500	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	Mars 2026	Juin 2026	Septembre 2026	Decembre 2026
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
2.5%	1er novembre 2027	30000	0.9452			
2.25%	1er février 2028	30000	0.9330	0.9413		
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			60000	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