

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(au 05 Janvier 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	Décembre 2026
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
2.75%	1er décembre 2055	28750	0.5516	0.5530	0.5544	0.5559
3.5%	1er décembre 2057	23000	0.6470	0.6481	0.6490	0.6500
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS		51750	51750	51750	51750	51750

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	Décembre 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
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS		145000	145000	111000	111000	

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	Décembre 2026
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
2.75%	1er septembre 2030	42000	0.8735			
2.75%	1er mars 2031	21000	0.8614	0.8673	0.8735	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS		63000	21000	21000	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	Décembre 2026
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
2.5%	1er novembre 2027	30000	0.9452			
2.25%	1er février 2028	18000	0.9330	0.9413		
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