

**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 | 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 | 23000 | 0.6470 | 0.6481 | 0.6490 | 0.6500 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 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 | 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 |
| 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 | Decembre 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 | Decembre 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