

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE
(au 22 May 2026)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours	Juin 2026	Septembre 2026	Decembre 2026	Mars 2027
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
2.75%	1er décembre 2055	28750	0.5530	0.5544	0.5559	0.5573
3.5%	1er décembre 2057	32000	0.6481	0.6490	0.6500	0.6509
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			60750	60750	60750	60750

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	Juin 2026	Septembre 2026	Decembre 2026	Mars 2027
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
3%	1er juin 2034	34000	0.8116			
3.25%	1er décembre 2034	30000	0.8190	0.8230	0.8273	
3.25%	1er juin 2035	39000	0.8109	0.8148	0.8190	0.8230
3.25%	1er décembre 2035	42000	0.8030	0.8069	0.8109	0.8148
3.25%	1er juin 2036	26000	0.7954	0.7992	0.8030	0.8069
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			171000	137000	137000	107000

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	Juin 2026	Septembre 2026	Decembre 2026	Mars 2027
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
2.75%	1er mars 2031	42000	0.8673	0.8735		
3%	1er septembre 2031	15000	0.8665	0.8720	0.8775	0.8832
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			57000	57000	15000	15000

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	Juin 2026	Septembre 2026	Decembre 2026	Mars 2027
Coupon	Échéance	(CAN \$ million)				
2.25%	1er février 2028	30000	0.9413			
2.5%	1er mai 2028	29000	0.9375	0.9452		
2.75%	1er août 2028	11000	0.9348	0.9419	0.9491	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			70000	40000	11000	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