

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES  
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE  
(au 06 juillet 2026)**

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

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Septembre 2026	Decembre 2026	Mars 2027	Juin 2027
Coupon	Échéance					
2.75%	1er décembre 2055	28750	0.5544	0.5559	0.5573	0.5588
3.5%	1er décembre 2057	35000	0.6490	0.6500	0.6509	0.6520
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			63750	63750	63750	63750

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)	Septembre 2026	Decembre 2026	Mars 2027	Juin 2027
Coupon	Échéance					
3.25%	1er décembre 2034	30000	0.8230	0.8273		
3.25%	1er juin 2035	39000	0.8148	0.8190	0.8230	0.8273
3.25%	1er décembre 2035	42000	0.8069	0.8109	0.8148	0.8190
3.25%	1er juin 2036	41000	0.7992	0.8030	0.8069	0.8109
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			152000	152000	122000	122000

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)	Septembre 2026	Decembre 2026	Mars 2027	Juin 2027
Coupon	Échéance					
2.75%	1er mars 2031	42000	0.8735			
3%	1er septembre 2031	25000	0.8720	0.8775	0.8832	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			67000	25000	25000	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)	Septembre 2026	Decembre 2026	Mars 2027	Juin 2027
Coupon	Échéance					
2.5%	1er mai 2028	29000	0.9452			
2.75%	1er aout 2028	16500	0.9419	0.9491		
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			45500	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