**Annexe I**

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE (au 05 Octobre 2026)**

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

| Obligations du gouvernement du Canada | | Montant en cours | Decembre 2026 | Mars 2027 | Juin 2027 | Septembre 2027 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Coupon | Échéance | (CAN $ million) | | | | |
| 3.5% | 1er décembre 2057 | 35000 | 0.9116 | 0.9119 | 0.9124 | 0.9127 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 35000 | 35000 | 35000 | 35000 |

POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions $ CAN)

Facteurs de conversion calculés sur la base d'un rendement de 4 %

CONTRATS À TERME SUR OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA DE DIX ANS – CGB

| Obligations du gouvernement du Canada | | Montant en cours | Decembre 2026 | Mars 2027 | Juin 2027 | Septembre 2027 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Coupon | Échéance | (CAN $ million) | | | | |
| 3.25% | 1er décembre 2034 | 30000 | 0.8273 | | | |
| 3.25% | 1er juin 2035 | 39000 | 0.8190 | 0.8230 | 0.8273 | |
| 3.25% | 1er décembre 2035 | 42000 | 0.8109 | 0.8148 | 0.8190 | 0.8230 |
| 3.25% | 1er juin 2036 | 41000 | 0.8030 | 0.8069 | 0.8109 | 0.8148 |
| 3.5% | 1er décembre 2036 | 20000 | 0.8140 | 0.8174 | 0.8210 | 0.8244 |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 172000 | 142000 | 142000 | 103000 |

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 | Decembre 2026 | Mars 2027 | Juin 2027 | Septembre 2027 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Coupon | Échéance | (CAN $ million) | | | | |
| 3% | 1er Septembre 2031 | 40000 | 0.8775 | 0.8832 | | |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 40000 | 40000 | 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 %

CONTRATS À TERME SUR OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA DE DEUX ANS - CGZ

| Obligations du gouvernement du Canada | | Montant en cours | Decembre 2026 | Mars 2027 | Juin 2027 | Septembre 2027 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Coupon | Échéance | (CAN $ million) | | | | |
| 2.75% | 1er Août 2028 | 27500 | 0.9491 | | | |
| 3% | 1er Novembre 2028 | 16500 | 0.9464 | 0.9530 | | |
| TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS | | | 44000 | 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