NEWS RELEASE

La Bourse de Montréal lance le contrat à terme sur le taux CORRA

2020-06-15

La bourse canadienne de produits dérivés étend sa gamme d'instruments sur titres à revenu fixe en appuyant un taux de référence canadien amélioré

Montréal, le 15 juin 2020 – La Bourse de Montréal (« MX »), la bourse canadienne de produits dérivés, a annoncé aujourd'hui le lancement du contrat à terme sur le taux CORRA, un nouveau contrat à terme de trois mois reposant sur le taux canadien moyen des opérations de pension à un jour (le « taux CORRA »). Ce lancement coïncide avec la prise en charge par la Banque du Canada de l'administration du taux d'intérêt de référence CORRA. Le taux CORRA est une mesure du coût moyen des opérations de pension à un jour visant des titres du gouvernement du Canada constitués en garantie, ainsi qu'une mesure représentative des taux de financement à un jour.

« Le lancement du contrat à terme sur le taux CORRA est le point culminant d'un effort de collaboration inspirant entre la Bourse de Montréal et la Banque du Canada, de concert avec nos partenaires au sein de tout le secteur, dans le but de positionner le Canada comme chef de file au centre de la transformation mondiale passant de taux interbancaires (« IBOR ») à des taux de référence fondés sur les opérations, a déclaré Luc Fortin, président et chef de la direction de la MX et chef des activités globales de négociation du Groupe TMX. Alors que s'amorce le travail fondamental requis et que nous travaillons à constituer la liquidité et à soutenir la croissance continue de ce nouveau produit, nous demeurons concentrés sur les moyens novateurs de répondre aux besoins des clients et des parties prenantes tout en favorisant une transparence et une rigueur accrues au sein des marchés canadiens. »

La Banque du Canada a apporté des améliorations à la méthode de calcul du taux CORRA qui a été élaborée en consultation avec le Groupe de travail sur le taux de référence complémentaire pour le

marché canadien (« TARCOM »), afin d'établir un taux de référence moins volatile et plus fiable relativement au taux cible du financement à un jour.

« Le développement d'un marché à terme robuste est une étape importante pour faire du CORRA un taux d'intérêt de référence clé au Canada, affirme Harri Vikstedt, directeur principal, Département des marchés financiers, Banque du Canada. Nous espérons que le nouveau contrat à terme sur le taux CORRA de la Bourse de Montréal sera largement utilisé. »

Dans la même veine que les taux de référence à un jour sans risque similaires publiés par d'autres banques centrales et conformément aux normes internationales, le contrat à terme sur le taux CORRA est calculé à partir des données sur les opérations de pension soumises à l'Organisme canadien de réglementation du commerce des valeurs mobilières (« OCRVM ») dans le Système d'établissement de relevés des opérations sur le marché (« SEROM »). Vous pouvez consulter la méthode complète de calcul du taux CORRA sur le site Web de la Banque du Canada.

Le contrat à terme sur le taux CORRA de trois mois est coté à la Bourse aux fins de négociation depuis le vendredi 12 juin à 7 h (HAE). Pour obtenir de plus amples renseignements au sujet du contrat à terme sur le taux CORRA, veuillez consulter le site Web de la MX à m-x.ca/corra.

À propos du Groupe TMX (TSX : X)
Le Groupe TMX exploite des marchés mondiaux. Il met au point des solutions d'analyse et bâtit des communautés numériques appuyant le financement, la croissance et la réussite des entreprises, des négociateurs et des investisseurs. Les principales activités du Groupe TMX comprennent la Bourse de Toronto, la Bourse de croissance TSX, la Bourse Alpha TSX, la Bourse de Montréal, La Caisse canadienne de dépôt de valeurs, la Corporation canadienne de compensation de produits dérivés et Trayport, qui offrent des marchés d'inscription, des marchés de négociation, des mécanismes de compensation, des services de dépôt, des solutions technologiques, des produits d'information et d'autres services à la communauté financière mondiale. Le Groupe TMX a son siège social à Toronto et des bureaux dans l'ensemble de l'Amérique du Nord (Montréal, Calgary, Vancouver et New York), ainsi que dans des marchés internationaux clés, dont Londres et Singapour. Pour en savoir plus sur le Groupe TMX, visitez le www.tmx.com. Suivez le Groupe TMX sur Twitter : @TMXGroup.

Renseignements :

Catherine Kee
Gestionnaire principale, Communications d'entreprise et relations avec les médias
Groupe TMX
416 814-8834
catherine.kee@tmx.com