NEWS RELEASE

La Bourse de Montréal lancera les contrats à terme sur swap de taux d'intérêt en dollars canadiens fondés sur la méthodologie Eris

2016-03-16

Montréal, le 16 mars 2016. – La Bourse de Montréal, principale bourse de dérivés au Canada, a annoncé aujourd'hui qu'elle élargira sa gamme de produits dérivés sur taux d'intérêt grâce au lancement des contrats à terme sur swap de taux d'intérêt en dollars canadiens fondés sur la méthodologie Eris[mc]. Ces nouveaux contrats à terme sur swap, dont la Corporation canadienne de compensation de produits dérivés (la « CDCC ») assumera la compensation, pourront se négocier à la Bourse de Montréal à compter de septembre 2016.*

« Les réformes réglementaires transforment le marché mondial des swaps de taux d'intérêt, où les marchés boursiers et les chambres de compensation assument un rôle accru, explique Alain Miquelon, président et chef de la direction de la Bourse de Montréal et chef des marchés de dérivés du Groupe TMX. En offrant ce nouveau produit novateur, la Bourse de Montréal mettra à la disposition des participants au marché un produit de référence transparent et économique qui s'ajoute au marché canadien des swaps de taux d'intérêt, tout en améliorant l'établissement des cours à l'échelle de la courbe de rendement canadienne. »

Propriété intellectuelle d'Eris Exchange, la méthodologie Eris réunit les caractéristiques économiques de swaps de gré à gré en un seul prix de contrat à terme, de façon à ce que le produit demeure un contrat à terme tout au long de son cycle de vie. La conception novatrice du produit permet aux participants au marché d'évoluer au sein du cadre familier que constituent la réglementation, les processus de post-marché, les services d'exécution et les outils logiciels du secteur des contrats à terme. Une fois lancés, les contrats respecteront les conventions du marché canadien des swaps de taux d'intérêt et auront des durées de deux, cinq et dix ans.

« C'est avec fierté que nous collaborons avec la Bourse de Montréal au lancement des contrats à terme sur swap de taux d'intérêt en dollars canadiens, et la date de lancement prévue en septembre vient à point, constate Neal Brady, chef de la direction d'Eris Exchange. Au Canada et ailleurs dans le monde, le resserrement des normes relatives aux fonds propres qui découle de l'instauration d'exigences de marge à l'égard des opérations sur swap non compensées, de la compensation obligatoire des opérations sur swap et du calcul révisé du ratio de levier Bâle III pousse les banques et les utilisateurs finaux des swaps à adopter les contrats à terme sur swap fondés sur la méthodologie Eris pour leur rentabilité à l'égard des fonds propres. »

** Sous réserve de l'autocertification à l'égard du produit.*

Les marques de commerce d'Eris Exchange ou de ses sociétés affiliées comprennent Eris[MD], Eris Exchange[MD], Eris Methodology[MD], Eris SwapBook[mc], Eris BlockBox[mc] et Eris Pricing Engine[mc].

À propos du Groupe TMX (TSX : X)
Les filiales principales du Groupe TMX exploitent des marchés au comptant, des marchés dérivés et des chambres de compensation couvrant de multiples catégories d'actifs, dont les actions, les titres à revenu fixe et les produits énergétiques. La Bourse de Toronto, la Bourse de croissance TSX, la Bourse Alpha TSX, la Caisse canadienne de dépôt de valeurs, la Bourse de Montréal, la Corporation canadienne de compensation de produits dérivés, NGX, BOX Options Exchange, Shorcan, Shorcan Energy Brokers, AgriClear et d'autres sociétés du Groupe TMX offrent des marchés d'inscription, des marchés de négociation, des mécanismes de compensation, des services de dépôt, 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 du Canada (Montréal, Calgary et Vancouver), dans des marchés clés des États-Unis (New York, Houston, Boston et Chicago), ainsi qu'à Londres, à Beijing, à Singapour et à Sydney. Pour en savoir plus sur le Groupe TMX, visitez le http://www.tmx.com. Suivez le Groupe TMX sur Twitter, à @TMXGroup.

Renseignements :

Mathieu Labrèche
Gestionnaire, Communications d'entreprise et affaires publiques
Groupe TMX
416 947-4474
mathieu.labreche@tmx.com