

CIRCULAIRE 084-19

Le 31 mai 2019

SUSPENSION DES CONTRATS À TERME SUR SWAP INDEXÉ À UN JOUR (OIS)

Dans le cadre des efforts mondiaux déployés dans de nombreuses juridictions, y compris au Canada, afin de promouvoir l'adoption d'un taux de référence complémentaire, Bourse de Montréal Inc. (la « Bourse ») collabore actuellement avec les membres du secteur pour renouveler son offre de produits fondés sur le taux CORRA (Canadian Overnight Repo Rate Average). Les détails concernant l'initiative d'adoption d'un taux de référence complémentaire seront publiés sur le site Web de la Bourse à mesure de l'évolution de l'initiative.

En vue de faciliter le passage des produits qui sont actuellement fondés sur le taux CORRA aux nouveaux produits à venir, la Bourse va suspendre la négociation sur les contrats à terme sur swap indexé à un jour (OIS) pendant une durée indéterminée à partir du vendredi 7 juin 2019 après la clôture de la séance de négociation.

Pour obtenir de plus amples renseignements sur le travail accompli au Canada à l'égard de la réforme du taux de référence complémentaire, veuillez consulter le site Web suivant, à l'adresse <https://www.banqueducanada.ca/marches/groupe-travail-taux-reference>.

Veuillez prendre note que la Bourse participe à titre d'observateur au groupe de travail sur le taux de référence complémentaire pour le marché canadien (TARCOM) et qu'elle préside le groupe de travail sur les marchés à terme dans le cadre du sous-groupe de transition. Le sous-groupe vise à mettre sur pied un contrat à terme de référence canadien de qualité, soit un contrat à terme de taux d'intérêt fondé sur le taux CORRA.

Pour des renseignements supplémentaires, veuillez contacter :

Robert Tasca
Directeur, Groupe des produits dérivés sur taux d'intérêt et des solutions clients
Robert.tasca@tmx.com
514 871-3501