

Taux CORRA : graphiques

Réunion du Groupe consultatif sur le taux CORRA (GCC)

4 février 2021

Banque du Canada



Publication du taux CORRA

- Source de données quotidiennes gratuites et publiques, la [page Web](#) consacrée au taux CORRA a été lancée le 15 juin 2020



Données récentes

Formats de données offerts : [CSV](#), [JSON](#) et [XML](#)



Notre interface Valet est conçue pour vous aider à intégrer vos applications et vos processus à nos données. Pour de plus amples renseignements, veuillez consulter notre [documentation](#).

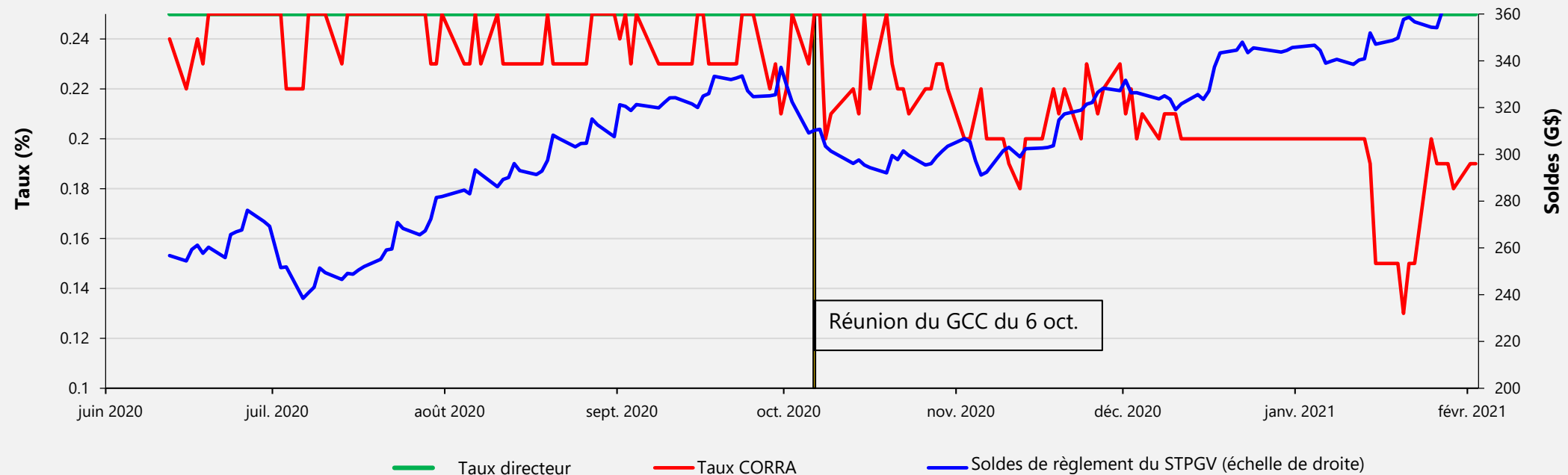
	2021-02-12	2021-02-15	2021-02-16	2021-02-17	2021-02-18
Taux des opérations de pension à un jour (CORRA) (%)	0,2000	Jour férié	0,2000	0,2000	0,2000
Valeur nominale totale des opérations admissibles pour le taux CORRA (\$)	15 640 640 055	Jour férié	15 332 386 924	13 604 217 506	17 524 102 296
Valeur nominale du volume tronqué des opérations admissibles pour le taux CORRA (\$)	11 730 480 041	Jour férié	11 499 290 193	10 203 163 130	13 143 076 722
Nombre de déclarants uniques de données pour le taux CORRA	14	Jour férié	13	14	13
Taux correspondant au volume tronqué (%)	0,1800	Jour férié	0,1500	0,1700	0,1700
Taux du 5e centile du volume tronqué (%)	0,1800	Jour férié	0,1700	0,1700	0,1700
Taux du 25e centile du volume tronqué (%)	0,2000	Jour férié	0,1800	0,1800	0,1800
Taux du 75e centile du volume tronqué (%)	0,2000	Jour férié	0,2100	0,2100	0,2100
Taux du 95e centile du volume tronqué (%)	0,2300	Jour férié	0,2500	0,2200	0,2100
État de publication	publié	-	publié	publié	publié
Méthode de calcul	standard	-	standard	standard	standard

Nota : Les données révisées portent la mention « R ».

Évolution du taux CORRA et des soldes de règlement du STPGV¹

- Le taux CORRA quotidien s'est situé entre 0,25 % et 0,13 % depuis la dernière réunion, le 6 octobre

Graphique 1 : Taux CORRA, taux directeur et soldes de règlement du STPGV



Source : Banque du Canada

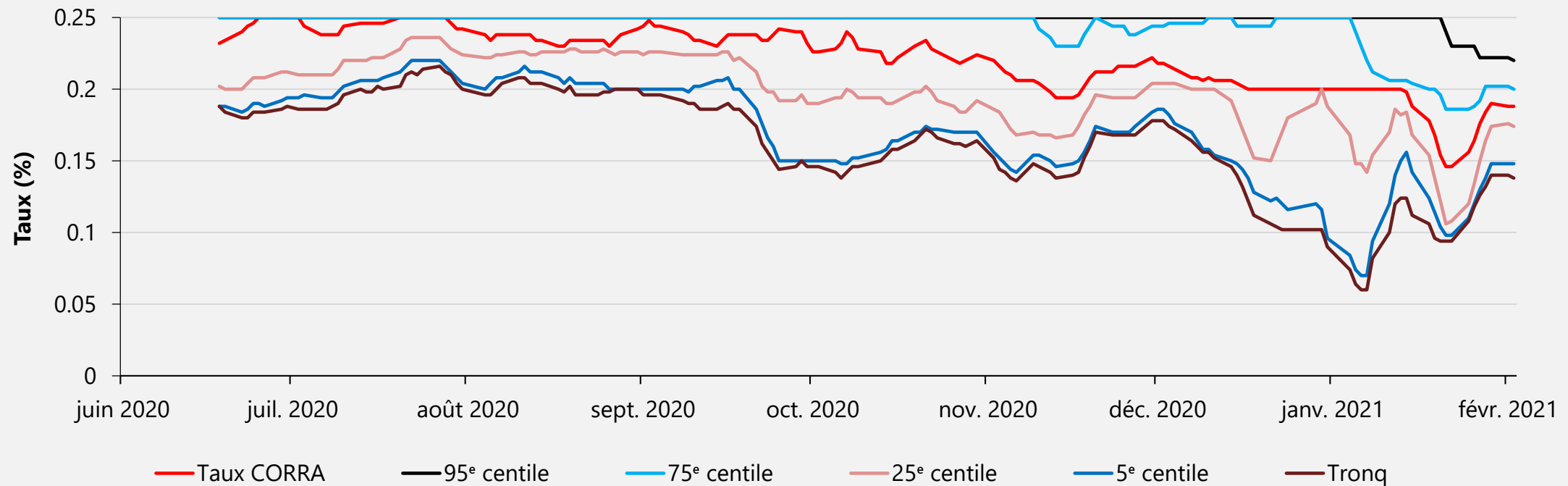
Dernière observation : 2 février 2021

¹ Ce [document](#) donne des explications sur les soldes de règlement du STPGV

Centiles de la distribution des taux des opérations de pension

- Le volume des opérations de pension ventilé par taux s'est inscrit en baisse, mais a quelque peu remonté par rapport aux niveaux extrêmes de janvier

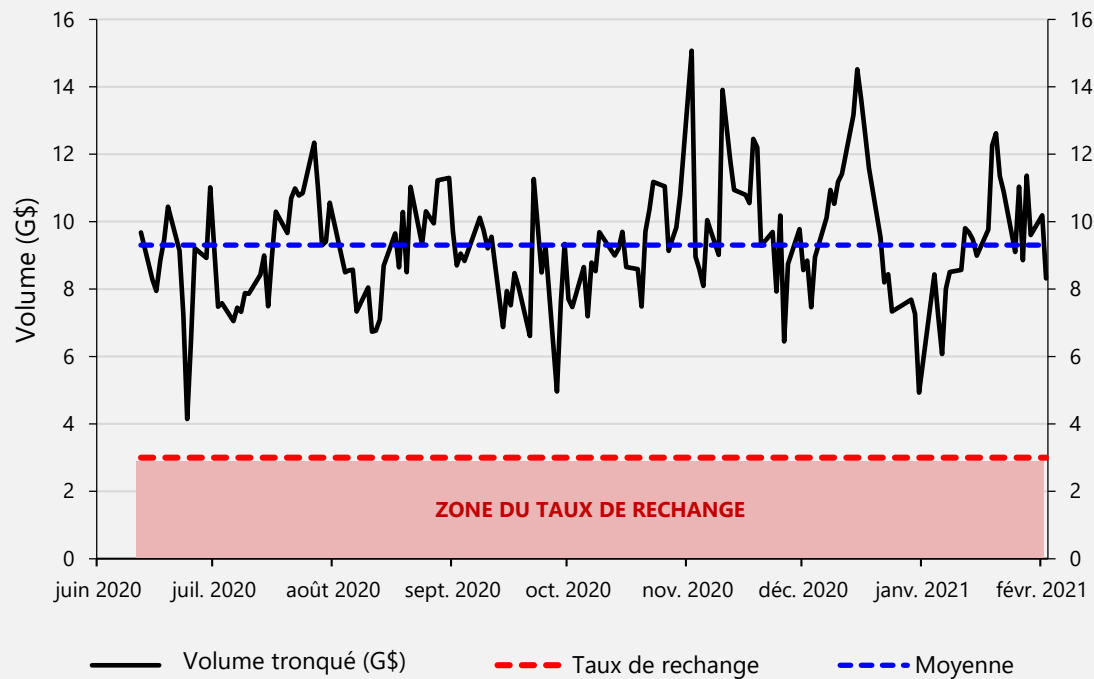
Graphique 2 : Moyenne mobile sur cinq jours du taux CORRA, centiles et taux correspondant au volume tronqué



Volume d'opérations CORRA

- Le volume tronqué quotidien d'opérations CORRA s'est établi à environ 9,7 G\$ en moyenne depuis la réunion du GCC du 6 octobre

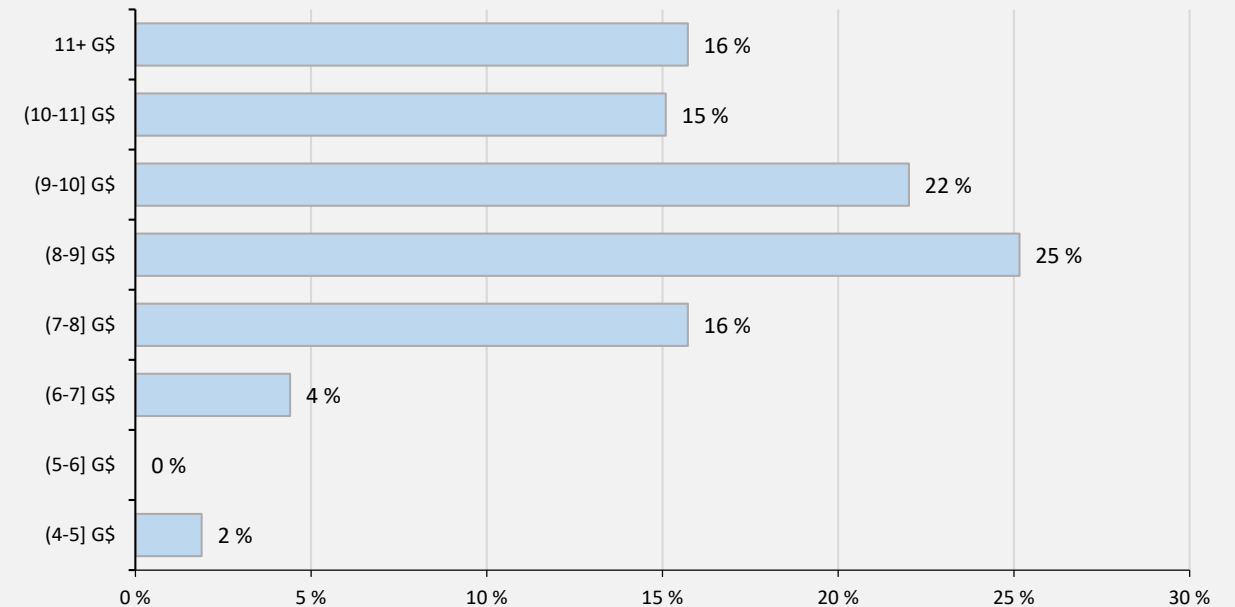
Graphique 3 : Volume quotidien d'opérations CORRA depuis le 15 juin



Source : Banque du Canada

Dernière observation : 2 février 2021

Graphique 4 : Fréquence relative du volume quotidien d'opérations CORRA depuis le 15 juin

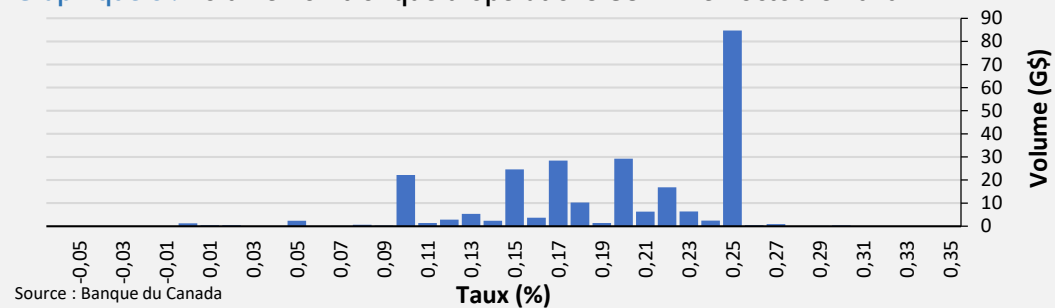


Source : Banque du Canada

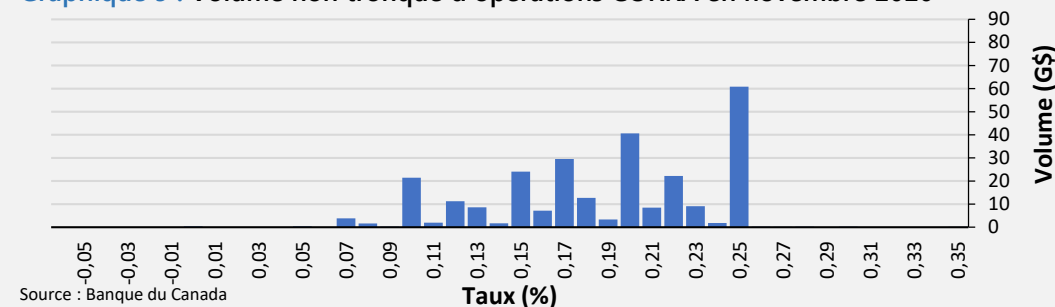
Dernière observation : 2 février 2021

Distribution du volume non tronqué mensuel d'opérations CORRA pour les mois d'octobre 2020 à janvier 2021

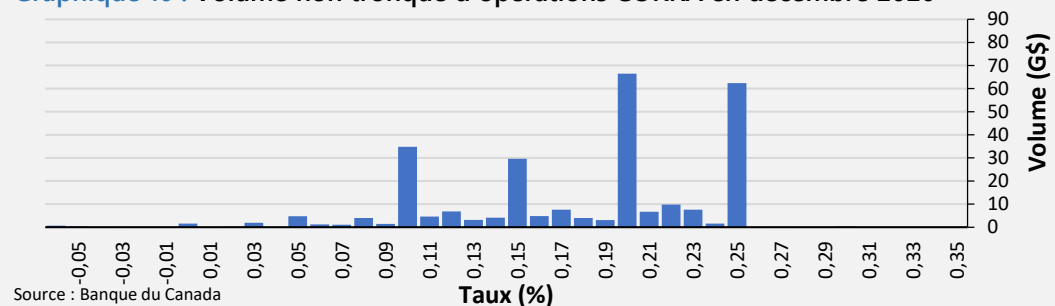
Graphique 8 : Volume non tronqué d'opérations CORRA en octobre 2020



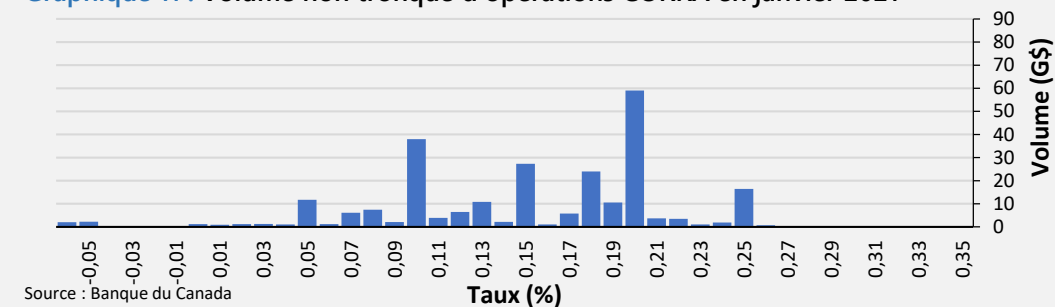
Graphique 9 : Volume non tronqué d'opérations CORRA en novembre 2020



Graphique 10 : Volume non tronqué d'opérations CORRA en décembre 2020



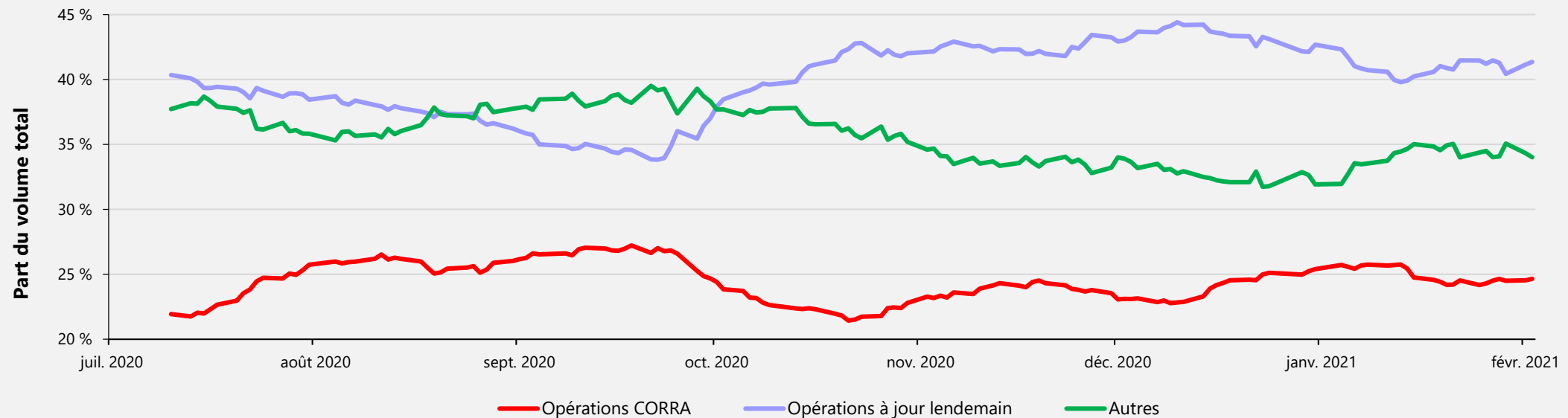
Graphique 11 : Volume non tronqué d'opérations CORRA en janvier 2021



Part du volume des opérations de pensions admissibles pour le taux CORRA

- La part des opérations de pension admissibles pour le taux CORRA et la part des opérations « à jour lendemain »

Graphique 5 : Moyenne mobile sur 20 jours de la part des opérations de pension selon l'admissibilité pour le taux CORRA

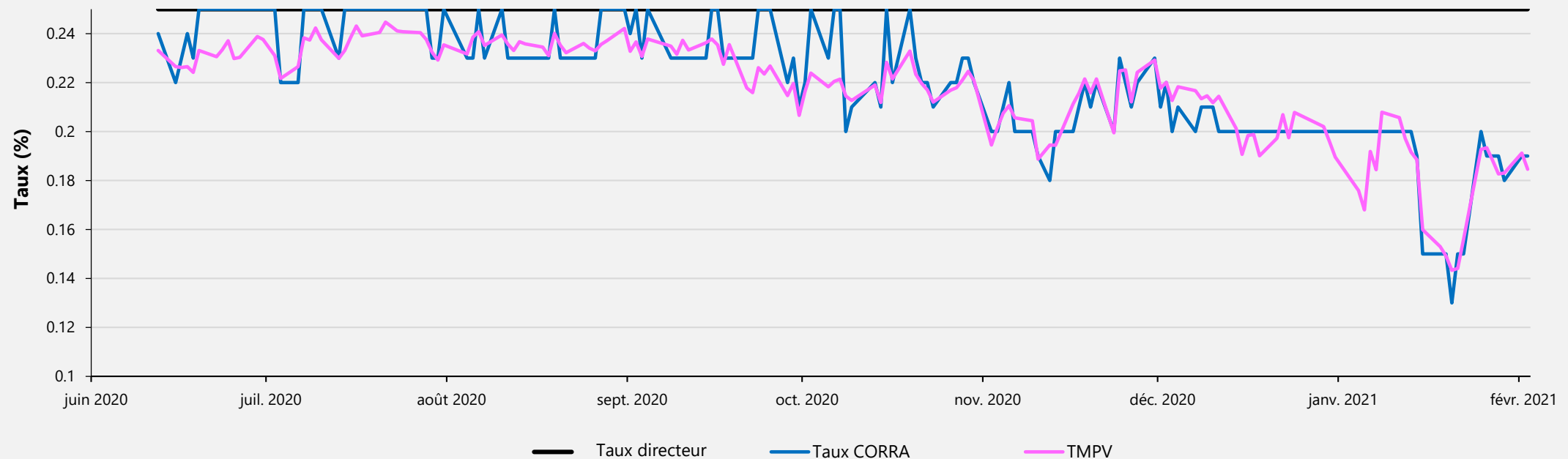


Nota : La catégorie « Autres » comprend toutes les opérations qui ne sont pas admissibles pour le taux CORRA et qui ne sont pas des opérations à jour lendemain, c.-à-d. les opérations à plus long terme, non libellées en dollars canadiens et entre sociétés affiliées. Les opérations à jour lendemain et les opérations de la catégorie « Autres » ne sont pas traitées par un algorithme d'appariement; leurs volumes sont, par conséquent, légèrement surestimés.

Taux CORRA (médiane tronquée) et taux basé sur la moyenne tronquée pondérée en fonction du volume

- Les deux méthodes de calcul du taux CORRA se traduisent par des résultats et des tendances générales similaires

Graphique 6 : Taux CORRA et taux basé sur la moyenne tronquée pondérée en fonction du volume (TMPV)



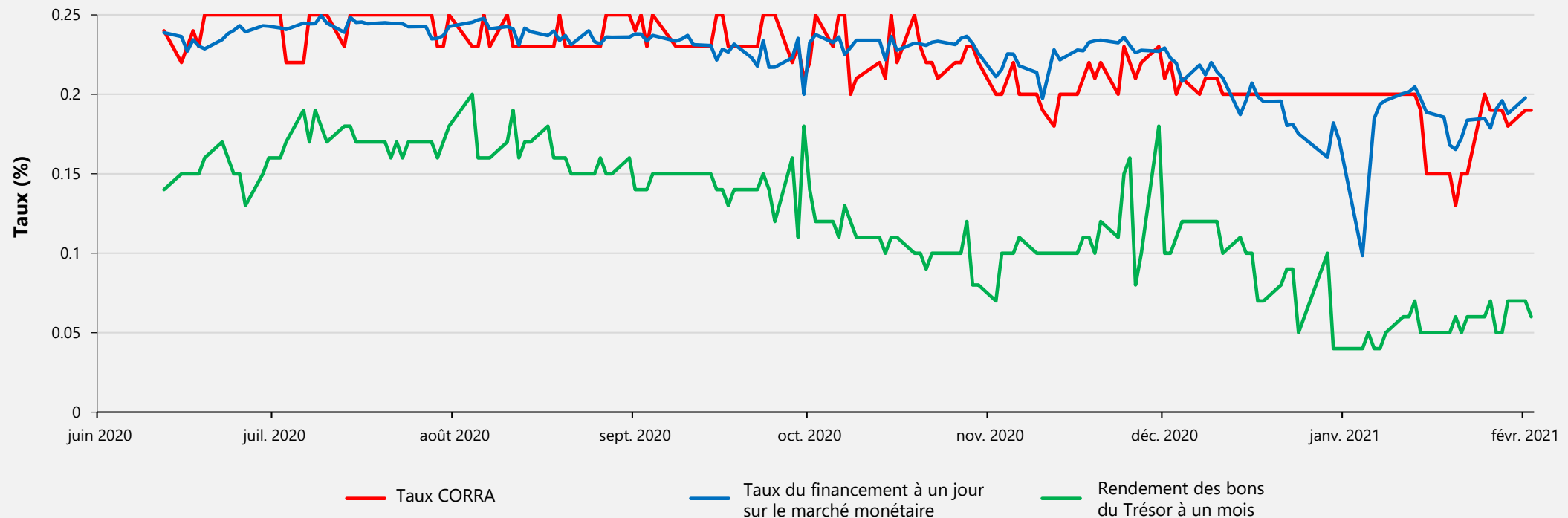
Source : Banque du Canada

Dernière observation : 2 février 2021

Taux sur le marché monétaire

- La baisse de rendement a été observée dans l'ensemble des segments du marché monétaire

Graphique 7 : Taux CORRA, taux du financement à un jour sur le marché monétaire, rendement des bons du Trésor à un mois



A low-angle, upward-looking perspective of several modern skyscrapers with glass facades. The buildings are arranged in a way that they appear to converge towards the top of the frame, creating a sense of height and scale. The glass reflects the sky and clouds, adding depth to the image. A semi-transparent dark grey horizontal band is positioned across the middle of the image, serving as a background for the text.

Merci