

Passage du taux CDOR au taux CORRA : suivi mensuel des prêts qui sont passés au taux CORRA/CORRA à terme^{1,2}

Total notionnel absolu, prêts autorisés ou valeur nominale de l'exposition restante au taux CDOR venant à échéance après le 28 juin 2024 (millions \$ CA)

	Trimestriel		Mensuel					
	Oct. 2023	Janv. 2024	Févr. 2024	Mars 2024	Avr. 2024	Mai 2024	Juin 2024	Juill. 2024
Total	617,599	598,298	589,269	557,970	508,225	398,391	67,715	
- avec clauses de repli	157,601	188,506	210,149	213,970	208,724	189,925	53,352	
- sans clauses de repli	459,998	409,792	379,120	344,000	299,501	208,466	14,363	

Total des activités de prêt en dollars canadiens au taux CORRA ou CORRA à terme durant la période, ce qui comprend les nouveaux prêts autorisés et les prêts initialement autorisés au taux CDOR (millions \$ CA)

Contrats de prêt selon leur taux de référence ³	Trimestriel		Mensuel					
	Oct. 2023	Janv. 2024	Févr. 2024	Mars 2024	Avr. 2024	Mai 2024	Juin 2024	Juill. 2024
Taux CORRA seulement	88	8,987	1,995	5,389	5,404	10,738	17,113	
Taux CORRA à terme seulement	2,903	34,207	14,579	23,453	27,295	31,295	54,859	
Taux CORRA et taux CORRA à terme	10,604	43,866	13,054	30,859	24,441	56,312	104,810	

Total notionnel absolu des produits dérivés de gré à gré fondés sur le taux CORRA à terme et négociés durant la période (millions \$ CA)

	Trimestriel		Mensuel					
	Oct. 2023	Janv. 2024	Févr. 2024	Mars 2024	Avr. 2024	Mai 2024	Juin 2024	Juill. 2024
Dérivés fondés sur le taux CORRA à terme	0	1,147	552	322	45	251	1,070	

¹ Le Groupe de travail sur le TARCOT publiera ce document chaque mois pour aider les participants au marché à suivre le passage du taux CDOR aux taux CORRA ou CORRA à terme sur les marchés des prêts aux entreprises et des prêts commerciaux (y compris les prêts consortiaux) ainsi que l'évolution des produits dérivés fondés sur le taux CORRA à terme. Les données servent à illustrer la tendance et non à compiler les montants exacts, puisque l'interprétation des critères par chaque banque déclarante peut différer.

² Les données se fondent sur les réponses fournies au sondage du BSIF par les institutions financières fédérales ayant la plus grande exposition au taux CDOR, sauf pour les données concernant les produits dérivés fondés sur le taux CORRA à terme, qui se limitent aux réponses des six grandes banques canadiennes. Les chiffres n'ont pas été ajustés pour tenir compte d'un double comptage, le cas échéant.

³ Données non disponibles pour TD.