

AVIS DE L'OCRCVM

Avis sur les Règles Avis d'approbation/de mise en œuvre

Règles des courtiers membres

Destinataires à l'interne :
Affaires juridiques et conformité
Comptabilité réglementaire
Crédit
Formation
Haute direction
Institutions
Opérations
Pupitre de négociation
Vérification interne

Personne-ressource :

Bruce Grossman
Analyste de l'information, Politique de
réglementation des membres
416 943-5782
bgrossman@iiroc.ca

10-0322
Le 3 décembre 2010

Modifications des Règles des courtiers membres concernant les stratégies de compensation de la conversion et de la reconversion

Le conseil d'administration de l'OCRCVM a approuvé la mise en œuvre des modifications jointes aux présentes des articles 9 et 10 de la Règle 100 des courtiers membres concernant les stratégies de compensation de la conversion et de la reconversion. Ces modifications entrent en vigueur à compter du 4 janvier 2011.

Actuellement, la Règle 100 des courtiers membres mentionne les conversions et les reconversions dans les trois séries de dispositions suivantes :

- *Combinaisons de titres et d'options* – alinéas 9(g)(v) et (vi), et 10(g)(v) et (vi)
- *Combinaisons d'options sur indice avec des paniers indiciels et des parts liées à un indice* – alinéas 9(h)(ii)(E) et (F), et 10(h)(ii)(E) et (F)



- *Combinaisons d'options sur indice avec des contrats à terme sur indice – alinéas 9(h)(v)(E) et (F), et 10(h)(v)(E) et (F)*

L'objectif premier des modifications est de clarifier la méthode de calcul des conversions et des reconversions dans ces trois dispositions. Plus particulièrement, les modifications visent à rendre explicites les valeurs de quelles options doivent être utilisées pour calculer le capital minimal prescrit (obligations en matière de capital minimum) et la couverture minimale prescrite (marge obligatoire minimum) dans le cadre de toutes les stratégies de compensation de la conversion et de la reconversion. Les modifications permettent également l'utilisation de formulations uniformes dans les trois dispositions.

[ANNEXE - MODIFICATION DES RÈGLES DES COURTIER MEMBRES](#)