

AVIS DE L'OCRCVM

Avis sur les règles Modifications de forme Règles sur les courtiers membres

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

Personnes-ressources :

Mindy Kwok
Analyste de l'information, Politique de réglementation
des membres
416 943-6979
mkwok@iiroc.ca

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

10-0074
Le 19 mars 2010

Groupe de devises

Il s'agit d'une nouvelle liste qui indique le groupe auquel appartient chaque devise. Auparavant, les changements apportés à un groupe étaient communiqués dans des avis de « surclassement de groupes de devises » ou de « déclassement de groupes de devises », mais sans que soit dressée une liste de toutes les devises figurant dans chaque groupe. Dorénavant, les surclassements et déclassements de devises seront communiqués au moyen de cette liste de groupes de devises, qui répertorie toutes les devises de chaque groupe. Comme aucun changement n'a été apporté à l'un ou l'autre des groupes, cette liste prend effet immédiatement.

Aux fins de couverture et de capital, l'OCRCVM répartit les devises en 4 groupes en fonction de critères quantitatifs et qualitatifs, que le paragraphe 2(d) de la Règle 100 des courtiers membres explique plus en détail et qui sont résumés dans les Notes et directives des Tableaux



11 et 11A du Formulaire 1 (le Rapport et questionnaire financiers réglementaires uniformes). Un taux de couverture du risque au comptant de base et un taux de couverture du risque au comptant à terme sont affectés à chaque groupe. L'OCRCVM surveille le risque au comptant de chaque devise dans les groupes 1, 2 et 3 et augmente le taux de couverture du risque au comptant d'une devise lorsque sa volatilité dépasse un certain seuil. Cette augmentation est communiquée au moyen de la liste dressant la couverture supplémentaire des devises.

Le courtier membre doit suivre cette liste de groupes de devises, la liste dressant la couverture supplémentaire des devises et le paragraphe 2(d) de la Règle 100 des courtiers membres pour couvrir ses positions non couvertes en devises (inventaire) et celles de ses clients ainsi que toutes autres opérations d'un client ou du courtier membre qui donne lieu à une exposition au risque de change.



Groupe de devises

[Liste mise à jour le 19 mars 2010]

Groupe 1

1. États-Unis - Dollar

Groupe 2

1. Australie - Dollar
2. Euro
3. Japon - Yen
4. Norvège - Couronne
5. Mexique – Nouveau Peso
6. Nouvelle-Zélande - Dollar
7. Suisse - Franc
8. Suède - Couronne
9. Royaume-Uni - Livre

Groupe 3

1. République tchèque - Couronne
2. Danemark - Couronne
3. Hong Kong - Dollar
4. Hongrie - Forint
5. Malaisie - Ringgit
6. Pologne - Zloty
7. Arabie Saoudite - Riyal
8. Singapour - Dollar

Groupe 4

L'ensemble des autres devises qui ne sont pas comprises dans les groupes 1, 2 et 3.