

AVIS DE L'OCRCVM

Avis sur les règles

Avis technique

Règles des courtiers membres

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

Personnes-ressources :

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

Mindy Sequeira
Analyste principale de l'information,
Politique de réglementation des membres
416 943-6979
msequeira@iiroc.ca

21-0005
Le 11 janvier 2021

Liste des taux de marge variables (taux de couverture flottants) et des taux de marge (couverture) pour les erreurs de suivi à l'égard des produits sur indice canadien ou américain admissibles

Cette liste est publiée tous les mois et donne les taux de marge applicables aux produits sur indice canadien ou américain dont l'indice est admissible à titre d'« indice » selon le sous-alinéa 9(a)(xii) de la Règle 100 des courtiers membres de l'OCRCVM [le paragraphe 5130(9) des Règles de l'OCRCVM]¹. Lorsque des produits sont admissibles à titre d'indices, ils peuvent donner lieu à l'utilisation de la

¹ Afin d'aider les lecteurs, nous avons indiqué le renvoi à la disposition applicable des Règles de l'OCRCVM (se reporter à l'Avis [19-0144](#) – Mise en œuvre du Manuel de réglementation en langage simple des courtiers membres de l'OCRCVM). Étant donné que le Manuel de réglementation en langage simple (qui sera appelé « Règles de l'OCRCVM ») n'a pas encore pris effet, nous avons surligné ce renvoi en gris. Lorsque les Règles de l'OCRCVM auront pris effet, nous supprimerons le surlignage gris.



méthode des taux de marge variables (taux de couverture flottants) pour le calcul de la marge (couverture).

Cette liste est établie en fonction des données disponibles sur la période terminée le 31 décembre 2020, et est en vigueur à compter du 14 janvier 2021 et jusqu'à ce qu'elle soit remplacée par une liste subséquente. Les taux de marge (couverture) ont été calculés selon la méthode énoncée au sous-alinéa 9(a)(x) de la Règle 100 des courtiers membres [paragraphe 5360(3) des Règles de l'OCRCVM].

La [liste des taux de marge variables et des taux de marge pour les erreurs de suivi à l'égard des produits sur indice canadien ou américain admissibles](#) est accessible en format Microsoft Excel sur le site Internet de l'OCRCVM, dans la section « Manuel de réglementation », sous « Ressources complémentaires ».