

RÈGLEMENT MODIFIANT LE RÈGLEMENT 94-101 SUR LA COMPENSATION OBLIGATOIRE DES DÉRIVÉS PAR CONTREPARTIE CENTRALE

Loi sur les instruments dérivés
(chapitre I-14.01, a. 175, 1^{er} al., par. 11° et 29°)

1. L'article 1 du Règlement 94-101 sur la compensation obligatoire des dérivés par contrepartie centrale (chapitre I-14.01, r. 0.01) est modifié par l'insertion, dans le paragraphe 1 et après la définition de l'expression « dérivé obligatoirement compensable », de la suivante :

« « fonds d'investissement » : un fonds d'investissement au sens du Règlement 81-106 sur l'information continue des fonds d'investissement (chapitre V-1.1, r. 42); ».

2. L'article 3 de ce règlement est modifié par le remplacement, dans le paragraphe 1, des sous-paragraphes *b* et *c* par les suivants :

« *b*) elle remplit les conditions suivantes :

i) elle est une entité du même groupe que le participant visé au paragraphe *a*;

ii) elle n'est ni un fonds d'investissement ni une fiducie;

iii) à un moment quelconque après la date d'entrée en vigueur du présent règlement, le montant notionnel brut de l'ensemble de ses dérivés en cours à la fin du mois excède 1 000 000 000 \$, compte non tenu des dérivés auxquels le sous-paragraphe *a* du paragraphe 1 de l'article 7 s'applique;

« *c*) elle remplit les conditions suivantes :

i) elle est une contrepartie locale dans un territoire du Canada;

ii) elle n'est ni un fonds d'investissement ni une fiducie;

iii) à un moment quelconque après la date d'entrée en vigueur du présent règlement, le montant notionnel brut de l'ensemble de ses dérivés en cours à la fin du mois, combiné à celui de chaque entité du même groupe qui n'est ni un fonds d'investissement ni une fiducie et qui est une contrepartie locale dans un territoire du Canada, excède 500 000 000 000 \$, compte non tenu des dérivés auxquels le sous-paragraphe *a* du paragraphe 1 de l'article 7 s'applique;

iv) à un moment quelconque après la date d'entrée en vigueur du présent règlement, le montant notionnel brut de l'ensemble de ses dérivés en cours à la fin du mois excède 1 000 000 000 \$, compte non tenu des dérivés auxquels le sous-paragraphe *a* du paragraphe 1 de l'article 7 s'applique. ».

3. L'article 5 de ce règlement est modifié par la suppression du mot « toutes ».

4. L'article 7 de ce règlement est modifié, dans le paragraphe 1 :

1° par la suppression, dans le texte anglais de ce qui précède le sous-paragraphe *a*, des mots « the application of »;

2° par le remplacement, dans le sous-paragraphe *a*, du mot « si » par le mot « et ».

5. L'article 8 de ce règlement est modifié :

1° par la suppression, dans le texte anglais de ce qui précède le sous-paragraphe *a*, des mots « the application of »;

2° par le remplacement, dans le paragraphe e, du mot « est » par les mots « a été ».

6. L'article 12 de ce règlement est modifié par le remplacement, dans le texte anglais, du mot « offers » par le mot « offered ».

7. L'article 13 de ce règlement est modifié par le remplacement, dans le texte anglais, du mot « paragraphs » par le mot « paragraph » et de « (3)(1)(a) » par « 3(1)(a) ».

8. L'Annexe A de ce règlement est remplacée par la suivante :

**« ANNEXE A
DÉRIVÉS OBLIGATOIREMENT COMPENSABLES
(paragraphe 1 de l'article 1)**

Swaps de taux d'intérêt

Type	Taux variable de référence	Monnaie de règlement	Échéance	Type de monnaie de règlement	Optionalité	Type de notionnel
Fixe-variable	CDOR	CAD	28 jours à 30 ans	Mono-monnaie	Non	Constant ou variable
Fixe-variable	LIBOR	USD	28 jours à 50 ans	Mono-monnaie	Non	Constant ou variable
Fixe-variable	EURIBOR	EUR	28 jours à 50 ans	Mono-monnaie	Non	Constant ou variable
Fixe-variable	LIBOR	GBP	28 jours à 50 ans	Mono-monnaie	Non	Constant ou variable
Variable-variable	LIBOR	USD	28 jours à 50 ans	Mono-monnaie	Non	Constant ou variable
Variable-variable	EURIBOR	EUR	28 jours à 50 ans	Mono-monnaie	Non	Constant ou variable
Variable-variable	LIBOR	GBP	28 jours à 50 ans	Mono-monnaie	Non	Constant ou variable
Swap indexé sur le taux à un jour	CORRA	CAD	7 jours à 2 ans	Mono-monnaie	Non	Constant
Swap indexé sur le taux à un jour	FedFunds	USD	7 jours à 3 ans	Mono-monnaie	Non	Constant
Swap indexé sur le taux à un jour	EONIA	EUR	7 jours à 3 ans	Mono-monnaie	Non	Constant
Swap indexé sur le taux à un jour	SONIA	GBP	7 jours à 3 ans	Mono-monnaie	Non	Constant

Contrats de garantie de taux

Type	Taux variable de référence	Monnaie de règlement	Échéance	Type de monnaie de règlement	Optionalité	Type de notionnel
Contrat de garantie de taux	LIBOR	USD	3 jours à 3 ans	Mono-monnaie	Non	Constant
Contrat de garantie de taux	EURIBOR	EUR	3 jours à 3 ans	Mono-monnaie	Non	Constant
Contrat de garantie de taux	LIBOR	GBP	3 jours à 3 ans	Mono-monnaie	Non	Constant

».

9. Le présent règlement entre en vigueur le (*insérer ici la date d'entrée en vigueur du présent règlement*).