

NORME CANADIENNE 24-101 SUR L'APPARIEMENT ET LE RÈGLEMENT DES OPÉRATIONS INSTITUTIONNELLES

PARTIE 1 DÉFINITIONS ET INTERPRÉTATION

1.1 Définitions

Dans la présente règle, on entend par :

« chambre de compensation réglementée » :

- a) en Ontario, une agence de compensation¹ reconnue par l'autorité en valeurs mobilières en vertu de l'article 21.2 de la Loi sur les valeurs mobilières;
- b) au Québec, une chambre de compensation de valeurs mobilières autorisée par l'autorité en valeurs mobilières;
- c) dans tous les autres territoires², une chambre de compensation assujettie à la législation en valeurs mobilières d'un autre territoire du Canada³;

« entité d'autoréglementation » : une entité d'autoréglementation au sens de la Norme canadienne 21-101, *Le fonctionnement du marché*;

« fournisseur de services d'appariement » : une personne qui fournit des installations d'appariement centralisées, à l'exclusion de :

- a) toute chambre de compensation réglementée;
- b) toute bourse ou de tout système de cotation et de déclaration d'opérations qui est reconnu ou autorisé par une autorité en valeurs mobilières⁴ pour exercer l'activité de bourse ou de système de cotation et de déclaration d'opérations ou qui est dispensé par l'autorité en valeurs mobilières de l'obligation, prévue par la législation en valeurs mobilières⁵, d'être reconnu ou autorisé à ce titre;

¹ Le terme « agence de compensation » est défini dans la législation en valeurs mobilières de certains territoires (voir par exemple l'alinéa 1 de l'article 1 de la Loi sur les valeurs mobilières de l'Ontario).

² Le terme « territoire » est défini dans la Norme canadienne 14-101, *Définitions*.

³ La Caisse canadienne de dépôt de valeurs limitée (CDS) est reconnue comme agence de compensation de valeurs mobilières en Ontario et comme organisme d'autoréglementation au Québec. Aucun autre territoire ne réglemente ses activités.

⁴ Le terme « autorité en valeurs mobilières » est défini dans la Norme canadienne 14-101, *Définitions*.

⁵ Le terme « législation en valeurs mobilières » est défini dans la Norme canadienne 14-101, *Définitions*.

« gardien » : la personne⁶ qui détient un titre pour le compte d'une autre personne en vertu d'une convention de garde, à l'exclusion de tout courtier inscrit⁷;

« investisseur institutionnel » : selon le cas

a) une personne morale qui a des placements nets d'au moins 10 millions de dollars, selon ce qui est indiqué dans ses derniers états financiers;

b) une personne qui détient des titres par l'intermédiaire d'un gardien;

« jour de règlement » : le jour où la livraison des titres et les paiements peuvent être faits au moyen des installations d'une chambre de compensation réglementée;

« jour de l'opération » : le jour où une opération est exécutée;

« lendemain de l'opération » : le jour de règlement suivant celui où une opération est exécutée;

« marché » : un marché au sens de la Norme canadienne 21-101, *Le fonctionnement du marché*;

« opération LCP ou RCP » : une opération sur titres dont le règlement est fait selon le mode livraison contre paiement ou réception contre paiement;

« partie à l'appariement » : relativement à une opération exécutée avec un investisseur institutionnel ou pour son compte :

a) tout conseiller inscrit agissant au nom de l'investisseur institutionnel;

b) l'investisseur institutionnel, si aucun conseiller inscrit n'agit en son nom;

c) tout courtier inscrit qui exécute ou compense l'opération;

d) tout gardien de l'investisseur institutionnel qui règle l'opération.

1.2 Interprétation — appariement des opérations et heure normale de l'Est

1) En vertu de la présente règle, l'appariement est le processus selon lequel les modalités et les instructions de règlement d'une opération exécutée sont déclarées, vérifiées, confirmées, affirmées ou convenues entre les parties à l'appariement.

⁶ L'expression « personne ou société » est définie, aux fins de clarification dans certains territoires, dans la Norme canadienne 14-101, *Définitions*.

⁷ Cette définition de « gardien » s'inspire en partie de la définition figurant dans la *Rule 14-501, Définitions*, de la Commission des valeurs mobilières de l'Ontario.

2) Dans la présente règle, toute indication de l'heure correspond à l'heure normale de l'Est.

PARTIE 2 CHAMP D'APPLICATION

2.1 La présente règle ne s'applique pas aux opérations suivantes :

- a) un placement de titres;
- b) une opération sur les titres d'un organisme de placement collectif visé par le Norme canadienne 81-102 sur les organismes de placement collectif;
- c) une opération sur titres qui doit être réglée à l'étranger;
- d) une opération sur une option ou un contrat à terme qui est compensée par l'entremise d'une chambre de compensation.

PARTIE 3 OBLIGATIONS D'APPARIEMENT DES OPÉRATIONS

3.1 Heure limite d'appariement des opérations applicables au courtier inscrit

Le courtier inscrit ne peut exécuter aucune opération LCP ou RCP avec un investisseur institutionnel ou pour son compte à moins d'avoir établi des politiques et procédures raisonnables pour réaliser l'appariement dès que possible après son exécution, mais en aucun cas après :

- a) 19 h 30 le jour de l'opération, si l'opération est exécutée avant 16 h 30;
- b) 19 h 30 le lendemain de l'opération, si l'opération est exécutée après 16 h 30.

3.2 Entente de conformité ou déclaration écrite signée

Le courtier inscrit ne doit pas ouvrir de compte en vue d'exécuter une opération LCP ou RCP pour un investisseur institutionnel, ni accepter l'ordre d'exécuter une opération LCP ou RCP pour le compte d'un investisseur institutionnel, à moins que chaque partie à l'appariement ait, selon le cas :

- a) conclu avec le courtier une entente écrite fixant les rôles et responsabilités des parties en ce qui a trait à l'appariement des opérations, ce qui s'entend notamment de toute stipulation en vertu de laquelle les parties conviennent d'établir des politiques et procédures pour réaliser l'appariement de l'opération dès que possible après son exécution, mais en aucun cas après :

- i)* 19 h 30 le jour de l'opération, si l'opération est exécutée avant 16 h 30;
- ii)* 19 h 30 le lendemain de l'opération, si l'opération est exécutée après 16 h 30.

b) remis au courtier une déclaration écrite signée confirmant qu'elle a établi des politiques et procédures pour réaliser l'appariement de l'opération dès que possible après son exécution, mais en aucun cas après :

- i)* 19 h 30 le jour de l'opération, si l'opération est exécutée avant 16 h 30;
- ii)* 19 h 30 le lendemain de l'opération, si l'opération est exécutée après 16 h 30.

3.3 Heure limite d'appariement des opérations applicables au conseiller inscrit

Le conseiller inscrit ne peut donner à aucun courtier l'ordre d'exécuter une opération LCP ou RCP pour un investisseur institutionnel à moins d'avoir établi des politiques et procédures raisonnables pour réaliser l'appariement dès que possible après son exécution, mais en aucun cas après :

- a)* 19 h 30 le jour de l'opération, si l'opération est exécutée avant 16 h 30;
- b)* 19 h 30 le lendemain de l'opération, si l'opération est exécutée après 16 h 30.

3.4 Entente de conformité ou déclaration écrite signée

Le conseiller inscrit ne doit pas ouvrir de compte en vue d'exécuter une opération LCP ou RCP pour un investisseur institutionnel, ni donner à un courtier l'ordre d'exécuter une opération LCP ou RCP pour le compte d'un investisseur institutionnel, à moins que chaque partie à l'appariement ait, selon le cas :

a) conclu avec le conseiller une entente écrite fixant les rôles et responsabilités des parties en ce qui a trait à l'appariement des opérations, ce qui s'entend notamment de toute stipulation en vertu de laquelle les parties conviennent d'établir des politiques et procédures pour réaliser l'appariement de l'opération dès que possible après son exécution, mais en aucun cas après :

- i)* 19 h 30 le jour de l'opération, si l'opération est exécutée avant 16 h 30;
- ii)* 19 h 30 le lendemain de l'opération, si l'opération est exécutée après 16 h 30.

b) remis au conseiller une déclaration écrite signée confirmant qu'elle a établi des

politiques et procédures pour réaliser l'appariement de l'opération dès que possible après son exécution, mais en aucun cas après :

- i)* 19 h 30 le jour de l'opération, si l'opération est exécutée avant 16 h 30;
- ii)* 19 h 30 le lendemain de l'opération, si l'opération est exécutée après 16 h 30.

PARTIE 4 OBLIGATIONS DE DÉCLARATION APPLICABLES À LA PERSONNE INSCRITE

4.1 Obligations de déclaration applicables à la personne inscrite

1) La personne inscrite dépose le rapport prévu à l'Annexe 24-101A1 au plus tard 45 jours après la fin du trimestre civil si, selon le cas :

a) moins de 98 % des opérations LCP ou RCP exécutées par elle ou pour son compte au cours du trimestre ont été appariées avant l'heure limite prévue à la partie 3;

b) les opérations LCP ou RCP exécutées par elle ou pour son compte au cours du trimestre qui ont été appariées avant l'heure limite prévue à la partie 3 représentent moins de 98 % de la valeur globale des titres achetés ou vendus dans ces opérations.

PARTIE 5 OBLIGATIONS DE DÉCLARATION APPLICABLES À LA CHAMBRE DE COMPENSATION RÉGLEMENTÉE

5.1 La chambre de compensation réglementée dépose le rapport prévu à l'Annexe 24-101A2 au plus tard 30 jours après la fin du trimestre civil.

PARTIE 6 OBLIGATIONS APPLICABLES AU FOURNISSEUR DE SERVICES D'APPARIEMENT

6.1 Dépôt initial

1) Nul ne peut exercer l'activité de fournisseur de services d'appariement à moins d'avoir :

a) déposé l'avis prévu à l'Annexe 24-101A3;

b) attendu l'expiration d'un délai de 90 jours après le dépôt de l'avis prévu à l'Annexe 24-101A3 pour commencer son activité.

2) Au cours du délai de 90 jours prévu à l'alinéa 1, la personne qui a déposé l'avis prévu à l'Annexe 24-101A3 avise immédiatement par écrit l'autorité en valeurs mobilières de tout

changement significatif dans l'information fournie dans cet avis et dépose une modification de celui-ci, de la manière indiquée dans cette annexe, au plus tard sept jours après que le changement est survenu.

6.2 Changements prévus dans l'exploitation

Au moins 45 jours avant de mettre en œuvre un changement significatif sur un point de l'avis prévu à l'Annexe 24-101A3, le fournisseur de services d'appariement dépose une modification de cet avis de la manière indiquée dans l'annexe.

6.3 Cessation d'activité du fournisseur de services d'appariement

- 1) Le fournisseur de services d'appariement qui entend cesser son activité d'appariement dépose l'avis prévu à l'Annexe 24-101A4 au moins 30 jours avant la cessation.
- 2) Le fournisseur de services d'appariement qui cesse son activité involontairement dépose l'avis prévu à l'Annexe 24-101A4 dès que possible après la cessation.

6.4 Obligations de dépôt et de tenue des dossiers

- 1) Le fournisseur de services d'appariement dépose le rapport prévu à l'Annexe 24-101A5 au plus tard 30 jours après la fin du trimestre civil.
- 2) Le fournisseur de services d'appariement tient les dossiers nécessaires pour rendre compte de son activité.

6.5 Obligations relatives aux systèmes

Le fournisseur de services d'appariement doit, en ce qui concerne ses systèmes de base servant à l'appariement des opérations :

- a)* conformément à la pratique commerciale prudente, à une fréquence raisonnable, et au moins une fois par année :
 - i)* effectuer des estimations raisonnables de la capacité actuelle et future;
 - ii)* soumettre les systèmes à des tests avec charge élevée pour déterminer leur capacité de traiter les opérations de manière exacte, rapide et efficace;
 - iii)* mettre en œuvre des procédures raisonnables pour réviser et tenir à jour la méthodologie d'essai de ces systèmes;
 - iv)* examiner la vulnérabilité de ces systèmes et des opérations informatiques du centre de données face aux menaces informatiques provenant tant de l'interne

que de l'externe, y compris les infractions à la sécurité, les risques matériels et les catastrophes naturelles;

v) mettre à jour des plans raisonnables de secours et de continuité des activités;

b) une fois par année, faire effectuer un examen indépendant des objectifs de contrôle interne déclarés de ces systèmes et faire établir un rapport écrit, conformément aux normes de vérification généralement reconnues;

c) aviser sans délai l'autorité en valeurs mobilières :

i) de toute panne importante des systèmes;

ii) de tout changement important apporté aux systèmes.

PARTIE 7 RÈGLEMENT DES OPÉRATIONS

7.1 Règlement des opérations par le courtier inscrit

1) Le courtier inscrit ne peut exécuter aucune opération à moins d'avoir établi des politiques et des procédures raisonnables pour en faciliter le règlement au plus tard à la date de règlement standard prévue par une entité d'autoréglementation pour le type de titre faisant l'objet de l'opération.

2) L'alinéa 1 ne s'applique pas à l'opération dont les modalités de règlement ont été expressément convenues par les parties à l'opération au moment de l'exécution ou avant.

PARTIE 8 OBLIGATIONS ÉQUIVALENTES DES ENTITÉS D'AUTO-RÉGLEMENTATION ET DES AUTRES ENTITÉS

8.1 Les chambres de compensation réglementées, marchés et fournisseurs de services d'appariement se dotent de règles ou de textes favorisant le respect, par leurs membres, adhérents ou utilisateurs, des obligations des parties 3 et 7.

8.2 Tout membre d'une entité d'autoréglementation peut se conformer aux obligations prévues par la présente règle en se conformant aux règles ou textes de l'entité d'autoréglementation portant sur le même sujet qui ont été publiés par celle-ci et approuvés par une autorité en valeurs mobilières.

PARTIE 9 DISPENSE

9.1 Dispense

1) L'agent responsable ou l'autorité en valeurs mobilières peut accorder une dispense

totale ou partielle de l'application de la présente règle, sous réserve des conditions ou restrictions prévues dans la dispense.

- 2) Malgré l'alinéa 1, en Ontario, seul l'agent responsable peut accorder cette dispense.
- 3) Sauf en Ontario, la dispense visée à l'alinéa 1 est accordée en vertu de la loi indiquée à l'Annexe B de la Norme canadienne 14-101, Définitions, vis-à-vis du territoire intéressé.

PARTIE 10 DATE D'ENTRÉE EN VIGUEUR ET DISPOSITIONS TRANSITOIRES

10.1 Date d'entrée en vigueur

La présente règle entre en vigueur le 1^{er} juillet 2006.

10.2 Dispositions transitoires

1) La mention de « 19 h 30 le jour de l'opération » à l'alinéa *a* de l'article 3.1, au sous-alinéa *i* des alinéas *a* et *b* de l'article 3.2, à l'alinéa *a* l'article 3.3 et au sous-alinéa *i* des alinéas *a* et *b* de l'article 3.4 est remplacée par :

a) « 19 h 30 le lendemain de l'opération », si l'opération est exécutée le 31 décembre 2006 ou avant cette date;

b) « 12 h 00 le lendemain de l'opération », si l'opération est exécutée après le 31 décembre 2006, mais avant le 1^{er} juillet 2007.

2) La mention de « 98 % » aux sous-alinéas *a* et *b* de l'alinéa 1 de l'article 4.1 est remplacée par :

a) « 60 % » pour les opérations exécutées le 31 décembre 2006 ou avant cette date;

b) « 70 % » pour les opérations exécutées après le 31 décembre 2006, mais avant le 1^{er} juillet 2007;

c) « 80 % » pour les opérations exécutées après le 30 juin 2007, mais avant le 1^{er} janvier 2008;

d) « 90 % » pour les opérations exécutées après le 31 décembre 2007, mais avant le 1^{er} juillet 2008.

*cours du trimestre qui ont été appariées avant l'heure limite** prévue à la partie 3 représentent moins de 98 %* de la valeur globale des titres achetés ou vendus dans ces opérations.*

Établir les pourcentages ci-dessus séparément pour les opérations LCP ou RCP qui sont réglées par des gardiens pour le compte d'investisseurs institutionnels et pour les opérations LCP ou RCP qui sont réglées par des courtiers inscrits pour le compte d'investisseurs institutionnels.

Dispositions transitoires

* Ce pourcentage prend effet le 1^{er} juillet 2008. Il est mis en œuvre progressivement pour les opérations exécutées après l'entrée en vigueur de la règle (le 1^{er} juillet 2006) et avant le 1^{er} juillet 2008, comme suit :

- a) 60 % pour les opérations exécutées le 31 décembre 2006 ou avant cette date;
- b) 70 % pour les opérations exécutées après le 31 décembre 2006, mais avant le 1^{er} juillet 2007;
- c) 80 % pour les opérations exécutées après le 30 juin 2007, mais avant le 1^{er} janvier 2008;
- d) 90 % pour les opérations exécutées après le 31 décembre 2007, mais avant le 1^{er} juillet 2008.

Voir les dispositions transitoires de la partie 10 de la règle.

** L'heure limite prévue à la partie 3 est :

19 h 30 le jour de l'opération, si l'opération est exécutée avant 16 h 30;

19 h 30 le lendemain de l'opération, si l'opération est exécutée après 16 h 30.

Cette heure limite prend effet le 1^{er} juillet 2007. Pendant la période de transition, certaines prolongations sont autorisées pour les opérations exécutées après l'entrée en vigueur de la règle ([le 1^{er} juillet 2006]) et avant le 1^{er} juillet 2007. Pour les opérations exécutées avant 16 h 30, les heures limites de transition sont les suivantes :

19 h 30 le lendemain de l'opération pour les opérations exécutées le 31 décembre 2006 ou avant cette date;

12 h 00 le lendemain de l'opération, pour les opérations exécutées après le 31 décembre 2006 mais avant le 1^{er} juillet 2007.

Voir les dispositions transitoires de la partie 10 de la règle.

ANNEXES

Annexe A – Raisons du non-respect

Décrire les circonstances ou les causes qui ont empêché d'atteindre le seuil prévu d'opérations LPC ou RCP appariées avant l'heure limite la plus éloignée prévue par la partie 3 de la règle.

Annexe B – Mesures prises pour empêcher les retards

Indiquer les mesures prises pour empêcher les retards dans la déclaration et l'appariement des opérations à l'avenir. Indiquer la date à laquelle ces mesures doivent être mises en œuvre.

ATTESTATION DE LA PERSONNE INSCRITE

Le soussigné atteste que l'information fournie dans le présent rapport au nom de la personne inscrite est exacte.

FAIT à _____ le _____ 20_____

(Dénomination de la personne inscrite en caractères d'imprimerie)

(Nom de l'administrateur, du membre de la direction ou de l'associé en caractères d'imprimerie)

(Signature de l'administrateur, du membre de la direction ou de l'associé)

(Titre officiel en caractères d'imprimerie)

ANNEXE 24-101A2
RAPPORT D'ACTIVITÉ TRIMESTRIEL DE LA CHAMBRE DE
COMPENSATION RÉGLEMENTÉE SUR LA DÉCLARATION ET
L'APPARIEMENT DES OPÉRATIONS INSTITUTIONNELLES

TRIMESTRE CIVIL VISÉ

Du _____ au _____

IDENTIFICATION ET COORDONNÉES DE LA CHAMBRE DE COMPENSATION

1. Dénomination complète :
2. Dénomination sous laquelle l'activité est exercée, si elle est différente de celle indiquée au point 1 :
3. Adresse de l'établissement principal :
4. Adresse postale, si elle est différente de l'adresse de l'établissement principal :
5. Nom de la personne-ressource :
Numéro de téléphone :
Adresse électronique :

INSTRUCTIONS

Déposer ce rapport avec toutes les annexes conformément à l'article 5.1 de la règle, dans les 30 jours de la fin du trimestre civil visé.

Fournir les annexes dans un fichier électronique en format « CSV » (séparateur « point-virgule ») (par exemple, le format produit par le programme Excel de Microsoft).

ANNEXES

1. RAPPORTS SUR LES DONNÉES

Annexe A – Données opérationnelles

Dans les tableaux 1 et 2 ci-dessous, donner pour chaque mois du trimestre l'information relative aux opérations de clients devant être réglées le troisième jour après l'opération. Dans

les deux tableaux, fournir l'information séparément pour les opérations de clients réglées i) par un gardien pour le compte d'un investisseur institutionnel et ii) par un courtier pour le compte d'un investisseur institutionnel. Ces deux tableaux peuvent être intégrés dans un seul rapport. Fournir séparément l'information globale pour les opérations déclarées ou saisies comme appariées par un fournisseur de services d'appariement ou un autre fournisseur de services.

Mois/année : _____ (MMM/AAAA)

Tableau 1 – Opérations saisies

	<u>Titres de participation</u> (\$ CA)		<u>Titres de participation</u> (\$ US)		<u>Titres de créance</u> (\$ CA)		<u>Titres de créance</u> (\$ US)	
	Nbre	\$	Nbre	\$	Nbre	\$	Nbre	\$
Jour de l'op.								
Lendemain								
2 ^e jour après								
3 ^e jour après								
+ de 3 jours								

Tableau 2 – Opérations appariées

	<u>Titres de participation</u> (\$ CA)		<u>Titres de participation</u> (\$ US)		<u>Titres de créance</u> (\$ CA)		<u>Titres de créance</u> (\$ US)	
	Nbre	\$	Nbre	\$	Nbre	\$	Nbre	\$
Jour de l'op.								
Lendemain								
2 ^e jour après								
3 ^e jour après								
+ de 3 jours								

Légende

- « Nbre » : le nombre total d'opérations exécutées au cours du mois;
- « \$ » : la valeur totale des opérations (achats et ventes) exécutées au cours du mois;
- « Jour de l'op. » : le jour où une opération est exécutée;
- « Lendemain » : le jour de règlement tombant le lendemain de l'opération;
- « 2^e jour après » : le jour de règlement tombant le surlendemain de l'opération;
- « 3^e jour après » : le jour de règlement tombant le troisième jour après l'opération.

Annexe B – Anomalies

Dans le format ci-dessous, indiquer pour chaque adhérent de la chambre de compensation réglementée le pourcentage d'opérations de clients saisies et appariées par l'adhérent avant l'heure limite prévue à la partie 3 de la règle. Les pourcentages indiqués doivent être fonction tant du nombre d'opérations de clients appariées avant l'heure limite que de la valeur globale des titres achetés et vendus dans ces opérations.

Indiquer séparément les pourcentages pour les opérations de clients réglées i) par un gardien pour le compte d'un investisseur institutionnel et ii) par un courtier pour le compte d'un investisseur institutionnel.

Pourcentage d'opérations appariées avant l'heure limite		
<u>Adhérent</u>	<u>En nombre d'opérations</u>	<u>En valeur</u>

ATTESTATION DE LA CHAMBRE DE COMPENSATION RÉGLEMENTÉE

Le soussigné atteste que l'information fournie dans le présent rapport au nom de la chambre de compensation réglementée est exacte.

FAIT à _____ le _____ 20_____

(Dénomination de la chambre de compensation réglementée en caractères d'imprimerie)

(Nom de l'administrateur, du membre de la direction ou de l'associé en caractères d'imprimerie)

(Signature de l'administrateur, du membre de la direction ou de l'associé)

(Titre officiel en caractères d'imprimerie)

ANNEXE 24-101A3
AVIS CONCERNANT L'ACTIVITÉ
DE FOURNISSEUR DE SERVICES D'APPARIEMENT

INFORMATION RELATIVE À LA DATE DE COMMENCEMENT

Date de commencement de l'activité : _____ (JJ/MMM/AAAA)

TYPE DE DOCUMENT : AVIS INITIAL MODIFICATION

IDENTIFICATION ET COORDONNÉES DU FOURNISSEUR DE SERVICES D'APPARIEMENT

1. Dénomination complète :

2. Dénomination sous laquelle l'activité est exercée, si elle est différente de celle indiquée au point 1 :

3. Adresse de l'établissement principal :

4. Adresse postale, si elle est différente de l'adresse de l'établissement principal :

5. Nom de la personne-ressource :

 Numéro de téléphone :

 Adresse électronique :

6. Conseiller juridique :

 Dénomination du cabinet :

 Numéro de téléphone :

 Adresse électronique :

INFORMATION GÉNÉRALE

7. Adresse du site Web :
8. Date de clôture de l'exercice : _____ (JJ/MMM/AAAA)
9. Indiquer la forme juridique de la société (p. ex., société par actions, société en commandite ou société en nom collectif), ainsi que la date et le territoire de constitution :

Forme juridique : Société par actions Société de personnes
 Autre (préciser)

a) Date de constitution : _____ (JJ/MMM/AAAA)

b) Territoire et mode de constitution :

10. Sélectionner dans la liste suivante les types de titres dont le fournisseur de services d'appariement recevra et traitera les données en vue de la transmission des opérations appariées à une chambre de compensation réglementée.

a) Titres cotés : Titres canadiens Titres étrangers
 Titres de participation Titres de participation
 Titres de créance Titres de créance

b) Titres hors cote : Titres de participation
 Titres de créance publics
 Titres de créance privés

c) Préciser les autres types de titres :

INSTRUCTIONS

Déposer l'avis avec toutes les annexes conformément à l'article 6.1 de la règle.

Sur chacune des annexes, inscrire le nom du fournisseur de services d'appariement, la date du dépôt de l'annexe et la date à laquelle l'information est arrêtée (si elle est différente de la date du dépôt). Si une annexe est sans application, fournir à la place une déclaration expliquant les motifs.

Le fournisseur de services d'appariement qui dépose, conformément à l'alinéa 2 de l'article

6.1 ou à l'article 6.2 de la règle, une modification du présent avis concernant l'une de ses annexes doit fournir une description de la modification et déposer une annexe à jour. Indiquer brièvement, dans le rapport trimestriel prévu à l'Annexe 24-101A5, les changements significatifs dans l'information figurant dans l'avis.

ANNEXES

1. GOUVERNANCE

Annexe A – Documents constitutifs

Fournir un exemplaire des documents constitutifs, notamment des statuts et autres textes similaires, avec toutes leurs modifications successives.

Annexe B – Propriété

Fournir la liste des personnes qui possèdent 10 % ou plus des actions avec droit de vote du fournisseur de services d'appariement ou qui, directement ou indirectement, par convention ou autrement, peuvent exercer un contrôle sur la direction de celui-ci. Donner leur nom et leur adresse et joindre un exemplaire de la convention ou, en l'absence de convention écrite, décrire brièvement la convention ou le fondement leur permettant d'exercer une emprise.

Annexe C – Responsables

Fournir la liste des associés, membres de la direction, administrateurs ou personnes exerçant des fonctions semblables, qui détiennent ou ont détenu un tel poste, au cours des années civiles en cours et précédente, en indiquant pour chacun d'eux les éléments suivants :

1. Nom.
2. Titre.
3. Dates du début et de la fin du mandat actuel ou poste occupé et depuis combien de temps
4. Type d'activité principale et employeur.
5. Type d'activité principale exercée au cours des cinq dernières années, si elle diffère de celle décrite au point 4.
6. Si la personne est considérée comme administrateur indépendant.

Annexe D – Structure organisationnelle

Fournir un texte ou un schéma présentant la structure organisationnelle du fournisseur de services d'appariement.

Annexe E – Entités faisant partie du même groupe

Donner l'information suivante sur chaque personne faisant partie du même groupe que le fournisseur de services d'appariement :

1. Dénomination et adresse.
2. Forme juridique (p. ex., association, société par actions, société de personnes).
3. Territoire de constitution et loi constitutive.
4. Date de constitution dans la forme actuelle.
5. Brève description de la nature et de la portée de l'affiliation, de l'accord contractuel ou autre avec le fournisseur de services d'appariement.
6. Brève description de l'activité ou des fonctions.
7. Si une personne a cessé de faire partie du même groupe que le fournisseur de services d'appariement ou d'avoir un accord contractuel ou autre relatif au fonctionnement du fournisseur de services d'appariement au cours de l'exercice précédent, indiquer brièvement les raisons de la fin de cette relation.

2. VIABILITÉ FINANCIÈRE

Annexe F – États financiers vérifiés

Fournir les états financiers vérifiés du fournisseur de services d'appariement pour le dernier exercice, accompagnés d'un rapport établi par un vérificateur indépendant.

3. DROITS

Annexe G – Barème des droits

Fournir le barème des droits et autres frais imposés ou à imposer par le fournisseur de services d'appariement pour les services rendus, notamment le coût d'établissement de la connexion avec ses systèmes.

4. ACCÈS

Annexe H – Utilisateurs

Fournir la liste complète des utilisateurs ou abonnés auxquels le fournisseur de services d'appariement se propose d'offrir ses services, en indiquant le ou les types d'activités exercées par chacun d'eux (p. ex., gardien, courtier, conseiller ou autre).

Le cas échéant, indiquer le nom de chaque utilisateur ou abonné à qui l'accès aux services offerts par le fournisseur de services d'appariement a été interdit ou restreint au cours du dernier exercice, ainsi que les raisons de cette décision.

Annexe I – Contrat d'utilisation

Fournir un exemplaire de tout modèle de contrat d'abonnement des utilisateurs ou abonnés aux services du fournisseur de services d'appariement.

5. SYSTÈMES ET FONCTIONNEMENT

Annexe J – Description des systèmes

Décrire le mode de fonctionnement des systèmes du fournisseur de services d'appariement (notamment les systèmes de collecte et de traitement des données sur l'exécution des opérations et des instructions de règlement aux fins d'appariement des opérations). Cette description doit comprendre les éléments suivants :

1. Les heures de fonctionnement des systèmes, y compris la communication avec une chambre de compensation réglementée.
2. L'endroit où les systèmes sont exploités (p. ex., les pays et villes où se trouvent les ordinateurs principaux et de secours).
3. Une brève description de chaque service ou fonction exécuté par le fournisseur de services d'appariement.

6. CONFORMITÉ DES SYSTÈMES

Annexe K – Sécurité

Fournir une brève description des processus et procédures mis en œuvre par le fournisseur de services d'appariement pour assurer la sécurité de tout système utilisé pour offrir ses services.

Annexe L – Planification et mesure de la capacité

1. Fournir une brève description des techniques de planification de la capacité ou de mesure du rendement et des méthodologies d'essai des systèmes et d'essai avec charge élevée.
2. Fournir une brève description des méthodologies d'essai avec les utilisateurs ou les abonnés. Indiquer notamment quand les essais sont utilisés et quelle est leur portée.

Annexe M – Continuité des activités

Fournir une brève description des plans de secours et de continuité des activités en cas de catastrophe.

Annexe N – Pannes et changements de systèmes importants

Fournir une brève description des politiques et procédures permettant de signaler aux autorités en valeurs mobilières les pannes et changements de systèmes importants. Les pannes de systèmes importantes sont notamment les incidents graves qui entraînent l'interruption de l'appariement des opérations pendant plus de trente minutes pendant les heures normales de fonctionnement.

Annexe O – Vérification indépendante des systèmes

1. Décrire brièvement les mesures prises pour exécuter une vérification annuelle indépendante des systèmes.
2. Le cas échéant, fournir un exemplaire du dernier rapport de vérification externe des systèmes.

7. INTEROPÉRABILITÉ

Annexe P – Conventions d'interopérabilité

Fournir la liste complète des autres fournisseurs de services d'appariement avec lesquels le fournisseur de services d'appariement a conclu une convention d'interopérabilité. Joindre un exemplaire de chaque convention.

8. SOUS-TRAITANCE

Annexe Q – Sous-traitants

Fournir les renseignements suivants sur chaque sous-traitant avec lequel le fournisseur de services d'appariement a conclu un contrat ou un arrangement pour la prestation de ses services :

1. Dénomination et adresse.
2. Brève description des services ou fonctions.
3. Brève description des plans de secours ou de continuité des activités en cas de catastrophe.

9. CONFIDENTIALITÉ

Inscrire la mention « **Confidentiel** » sur tous les documents confidentiels. Ne pas fournir d'information de sécurité sensible et détaillée.

ATTESTATION DU FOURNISSEUR DE SERVICES D'APPARIEMENT

Le soussigné atteste que l'information fournie dans le présent avis au nom du fournisseur de services d'appariement est exacte.

FAIT à _____ le _____ 20_____

(Dénomination du fournisseur de services d'appariement en caractères d'imprimerie)

(Nom de l'administrateur, du membre de la direction ou de l'associé en caractères d'imprimerie)

(Signature de l'administrateur, du membre de la direction ou de l'associé)

(Titre officiel en caractères d'imprimerie)

ANNEXE 24-101A4
AVIS DE CESSATION D'ACTIVITÉ
DU FOURNISSEUR DE SERVICES D'APPARIEMENT

INFORMATION RELATIVE À LA DATE DE CESSATION D'ACTIVITÉ

Type de document : CESSATION VOLONTAIRE

CESSATION INVOLONTAIRE

Date de cessation de l'activité : _____ (JJ/MMM/AAAA)

IDENTIFICATION ET COORDONNÉES DU FOURNISSEUR DE SERVICES D'APPARIEMENT

1. Dénomination complète :
2. Dénomination sous laquelle l'activité est exercée, si elle est différente de celle indiquée au point 1 :
3. Adresse de l'établissement principal :
4. Adresse postale, si elle est différente de l'adresse de l'établissement principal :
5. Conseiller juridique :
Dénomination du cabinet :
Numéro de téléphone :
Adresse électronique :

INSTRUCTIONS

Déposer l'avis avec toutes les annexes conformément à l'article 6.3 de la règle.

Sur chacune des annexes, inscrire le nom du fournisseur de services d'appariement, la date du dépôt de l'annexe et la date à laquelle l'information est arrêtée (si elle est différente de la date du dépôt). Si une annexe est sans application, fournir à la place une déclaration expliquant les motifs.

ANNEXES

Annexe A

Indiquer les raisons de la cessation d'activité du fournisseur de services d'appariement.

Annexe B

Fournir la liste complète des utilisateurs ou abonnés auxquels des services ont été fournis au cours des 30 jours précédant la cessation d'activité. Indiquer les types d'activités de chacun d'eux (p. ex., gardien, courtier, conseiller en valeurs ou autre).

Annexe C

Fournir la liste complète des fournisseurs de services d'appariement liés par une convention d'interopérabilité avant la cessation d'activité.

ATTESTATION DU FOURNISSEUR DE SERVICES D'APPARIEMENT

Le soussigné atteste que l'information fournie dans le présent avis au nom du fournisseur de services d'appariement est exacte.

FAIT à _____, le _____ 20 _____

(Dénomination du fournisseur de services d'appariement en caractères d'imprimerie)

(Nom de l'administrateur, du membre de la direction ou de l'associé en caractères d'imprimerie)

(Signature de l'administrateur, du membre de la direction ou de l'associé)

(Titre officiel en caractères d'imprimerie)

ANNEXE 24-101A5
RAPPORT D'ACTIVITÉ TRIMESTRIEL DU
FOURNISSEUR DE SERVICES D'APPARIEMENT SUR LA DÉCLARATION ET
L'APPARIEMENT DES OPÉRATIONS INSTITUTIONNELLES

TRIMESTRE CIVIL VISÉ

Du _____ au _____

IDENTIFICATION ET COORDONNÉES DU FOURNISSEUR DE SERVICES D'APPARIEMENT

1. Dénomination complète :
2. Dénomination sous laquelle l'activité est exercée, si elle est différente de celle indiquée au point 1 :
3. Adresse de l'établissement principal :
4. Adresse postale, si elle est différente de l'adresse de l'établissement principal :
5. Nom de la personne-ressource :
Numéro de téléphone :
Adresse électronique :

INSTRUCTIONS

Déposer ce rapport avec toutes les annexes conformément à l'article 6.4 de la règle, dans les 30 jours de la fin du trimestre civil visé.

Fournir les annexes dans un fichier électronique en format « CSV » (séparateur « point-virgule »), par exemple le format produit par le programme Excel de Microsoft.

Si l'information demandée n'est pas disponible, fournir des explications.

ANNEXES

1. SOMMAIRE DES CHANGEMENTS SIGNIFICATIFS ET AUTRES SURVENUS AU COURS DU TRIMESTRE

Annexe A — Sommaire des changements significatifs

Décrire brièvement les changements importants dans l'information fournie dans l'avis prévu à l'Annexe 24-101A3 à déposer au cours du trimestre conformément à l'article 6.2 de la règle.

2. RAPPORTS SUR LES SYSTÈMES

Annexe B – Vérification externe des systèmes

Fournir un exemplaire de tout rapport établi à l'issue d'une vérification externe des systèmes de base au cours du trimestre.

Annexe C – Pannes et changements de systèmes importants

Fournir la liste complète et un sommaire des pannes et des changements de systèmes importants survenus au cours du trimestre.

3. RAPPORTS SUR LES DONNÉES

Annexe D – Données opérationnelles

Dans les tableaux 1 et 2 ci-dessous, donner pour chaque mois du trimestre l'information relative aux opérations de clients saisies et appariées au moyen des installations du fournisseur de services d'appariement. Ces deux tableaux peuvent être intégrés dans un seul rapport.

Mois/année : _____ (MMM/AAAA)

Tableau 1 – Opérations saisies

	<u>Titres de participation</u> (\$ CA)		<u>Titres de participation</u> (\$ US)		<u>Titres de créance</u> (\$ CA)		<u>Titres de créance</u> (\$ US)	
	Nbre	\$	Nbre	\$	Nbre	\$	Nbre	\$
Jour de l'op.								
Lendemain								
2 ^e jour après								
3 ^e jour après								
+ de 3 jours								

Tableau 2 – Opérations appariées

	<u>Titres de participation</u> (\$ CA)		<u>Titres de participation</u> (\$ US)		<u>Titres de créance</u> (\$ CA)		<u>Titres de créance</u> (\$ US)	
	Nbre	\$	Nbre	\$	Nbre	\$	Nbre	\$
Jour de l'op.								
Lendemain								
2 ^e jour après								
3 ^e jour après								
+ de 3 jours								

Légende

- « Nbre » : le nombre total d'opérations exécutées au cours du mois;
- « \$ » : la valeur totale des opérations (achats et ventes) exécutées au cours du mois;
- « Jour de l'op. » : le jour où une opération est exécutée;
- « Lendemain » : le jour de règlement tombant le lendemain de l'opération;
- « 2^e jour après » : le jour de règlement tombant le surlendemain de l'opération;
- « 3^e jour après » : le jour de règlement tombant trois jours après l'opération.

Annexe E – Anomalies

Dans le format ci-dessous, indiquer pour chaque utilisateur ou abonné le pourcentage d'opérations de clients saisies et appariées avant l'heure limite prévue à la partie 3 de la règle. Les pourcentages indiqués doivent être fonction tant du nombre d'opérations de clients appariées avant l'heure limite que de la valeur globale des titres achetés et vendus dans ces opérations.

<u>Utilisateur</u>	Pourcentage d'opérations appariées avant l'heure limite	
	<u>En nombre d'opérations</u>	<u>En valeur</u>

4. CONFIDENTIALITÉ

Inscrire la mention « **Confidentiel** » sur tous les documents confidentiels. Ne pas fournir d'information de sécurité sensible et détaillée. L'information fournie dans les Annexes D et E ne sera pas confidentielle.

ATTESTATION DU FOURNISSEUR DE SERVICES D'APPARIEMENT

Le soussigné atteste que l'information fournie dans le présent rapport au nom du fournisseur de services d'appariement est exacte.

FAIT à _____ le _____ 20 _____

(Dénomination du fournisseur de services d'appariement en caractères d'imprimerie)

(Nom de l'administrateur, du membre de la direction ou de l'associé en caractères d'imprimerie)

(Signature de l'administrateur, du membre de la direction ou de l'associé)

(Titre officiel en caractères d'imprimerie)