

**MODIFICATIONS À
LA NORME MULTILATÉRALE 96-101 SUR LES RÉPERTOIRES DES OPÉRATIONS ET LA
DÉCLARATION DE DONNÉES SUR LES DÉRIVÉS**

- 1. La présente modifie la Norme multilatérale 96-101 sur les répertoires des opérations et la déclaration de données sur les dérivés.**
- 2. Sauf en Colombie-Britannique, le titre « déclaration des opérations sur dérivés » remplace « répertoire des opérations et la déclaration de données sur les dérivés ».**
- 3. Le paragraphe 1(1) est modifié**

a) en ajoutant les définitions suivantes :

« contrepartie déclarante autorisée » : une contrepartie déclarante qui est l'une des entités suivantes :

- a) un courtier en dérivés;
- b) une agence de compensation et de dépôt déclarante;
- c) un membre du même groupe d'une personne ou d'une société visée aux alinéas a) ou b);

« courtier en dérivés visé par le plafonnement du montant notionnel » : le courtier en dérivés auquel s'applique le paragraphe 44(1) ou 44(2) de la Norme canadienne 93-101 sur la *conduite commerciale en dérivés*;

« Derivatives Service Bureau » : la filiale de l'Association of National Numbering Agencies constituée sous le nom The Derivatives Service Bureau (DSB) Limited et reconnue par le Conseil de stabilité financière comme le prestataire de services à l'égard du système d'identifiants uniques de produit pour les dérivés et comme l'exploitant de la bibliothèque de données de référence sur ces identifiants, ou encore ses remplaçants;

« données par position » : les données sur les événements du cycle de vie, les données de valorisation et les données sur les sûretés et les marges, toutes déclarées sous forme globale;

« données sur les sûretés et les marges » : les données relatives aux sûretés et aux marges déposées ou recueillies à la date de la déclaration qui se rapportent aux éléments de données des rubriques « Éléments de données relatifs aux sûretés et aux marges » et « Éléments de données relatifs aux actions et aux événements » de l'annexe A;

« dérivé sur marchandises » : un dérivé dont l'élément sous-jacent est une marchandise autre que de la trésorerie ou une monnaie;

« installation d'opérations sur dérivés » : l'une des entités suivantes :

- a) un marché tel qu'il est défini dans la Norme canadienne 21-101 *sur le fonctionnement du marché*;
- b) une installation d'exécution de swaps au sens où ce terme est défini dans la *Commodity Exchange Act*, 7 U.S.C. §1a(50) (États-Unis d'Amérique), avec ses modifications;
- c) une installation d'exécution de swaps de valeurs mobilières au sens où ce terme est défini dans la Loi de 1934;
- d) un système de négociation multilatérale au sens où ce terme est défini à l'article 4, paragraphe 1 et alinéa 22 de la Directive 2014/65/UE du Parlement européen et ses modifications;
- e) un système organisé de négociation au sens où ce terme est défini à l'article 4, paragraphe 1, alinéa 23 de la Directive 2014/65/UE du Parlement européen et ses modifications;
- f) une personne ou une société qui est semblable à une personne ou une société décrite dans n'importe lequel des alinéas a) à e), notamment, sans toutefois s'y limiter, une personne ou une société dans un territoire étranger;

« IUT » : un identifiant unique de transaction;

« procédure de validation » : une règle, une politique ou une procédure écrite raisonnablement conçue pour veiller à ce que les données sur les dérivés déclarées en vertu de la présente règle satisfont aux éléments de données énumérés à l'annexe A;;

b) en remplaçant la définition de « données à communiquer à l'exécution » par ce qui suit :

« données à communiquer à l'exécution » : les données relatives aux éléments de données énumérés à l'annexe A, autres que les éléments de données relatifs aux sûretés et aux marges ainsi que les éléments de données relatifs à la valorisation;;

c) en remplaçant la définition de « courtier en dérivés » par ce qui suit :

« courtier en dérivés » : l'une ou l'autre des entités suivantes :

a) une personne ou une société s'engageant à titre de directeur ou de mandataire dans des opérations sur dérivés ou se considérant engagée dans pareilles opérations;

b) toute autre personne ou société qui est tenue de s'inscrire à titre de courtier en dérivés en vertu de la législation en valeurs mobilières;

d) dans la définition de « période intermédiaire », en remplaçant « l'article 1.1 » par « le paragraphe 1.1(1) »;

e) sans objet dans la version française;

f) sans objet dans la version française;

g) en remplaçant la définition de « données sur les événements du cycle de vie » par ce qui suit :

« données sur les événements du cycle de vie » : les modifications apportées aux données à communiquer à l'exécution découlant d'un événement du cycle de vie et aux données relatives aux éléments de données énumérés à l'annexe A sous la rubrique Éléments de données relatifs aux actions et aux événements »;

h) dans la définition de « contrepartie locale », en remplaçant « la » par « d'une » avant « transaction »;

i) en remplaçant la définition de « données de valorisation » par ce qui suit :

« données de valorisation » : les données relatives aux éléments de données énumérés à l'annexe A sous les rubriques « Éléments de données relatifs à la valorisation » et « Éléments de données relatifs aux actions et aux événements ».

4. L'alinéa 1(5)a) est modifié en supprimant « en Colombie-Britannique, ».

5. L'article 1 est modifié

a) en supprimant et en remplaçant les alinéas (3)c) et (3)d) par ce qui suit :

c) tous les éléments suivants s'appliquent :

- (i) la deuxième partie est une société en commandite;
- (ii) la première partie est un associé commandité de la société en commandite visée au sous-alinéa i);
- (iii) la première partie a le pouvoir de diriger la gestion et les politiques de la deuxième partie du fait de sa qualité d'associé commandité de cette dernière;

d) tous les éléments suivants s'appliquent :

- (i) la deuxième partie est une fiducie;
- (ii) la première partie est un fiduciaire de la fiducie visée au sous-alinéa i);
- (iii) la première partie a le pouvoir de diriger la gestion et les politiques de la deuxième partie en vertu de son statut de fiduciaire de cette dernière;

b) en ajoutant les paragraphes suivants :

- (6)** Nonobstant les paragraphes (2) et (3), un fonds d'investissement n'est pas une entité du même groupe d'une autre personne ou société pour les besoins de la présente règle.
- (7)** Pour l'application du paragraphe (6), « fonds d'investissement » a le sens qui lui est attribué dans la Norme canadienne 81-106 sur *l'information continue des fonds d'investissement*..

6. Le paragraphe 3(3) est abrogé et remplacé par ce qui suit :

- (3)** En cas de modification d'un élément figurant dans l'annexe 96-101A1, autre que celle visée aux paragraphes (1) ou (2), le répertoire des opérations reconnu dépose une modification des renseignements fournis dans l'annexe 96-101A1 au moins une fois l'an..

7. Le paragraphe 7(1) est modifié

a) sauf en Colombie-Britannique, en supprimant « qui ne sont pas contraires à l'intérêt du public et » **après** « politiques et procédures claires et transparentes »;

b) en abrogeant et remplaçant l'alinéa b) par l'alinéa suivant :

b) que ses règles, politiques, procédures et contrats sont conformes aux lois applicables et que tout risque important découlant d'un conflit entre les lois du territoire intéressé et les lois d'une autre province ou d'un autre territoire du Canada ou d'un territoire étranger qui s'appliquent à un contrat avec ses utilisateurs est raisonnablement atténué;;

c) sauf en Colombie-Britannique, à l'alinéa c), en ajoutant « reconnu », **après** « répertoire des opérations »;

d) sauf en Colombie-Britannique, à l'alinéa d), en remplaçant « les conventions qu'il conclut indiquent » **par** « toute convention qu'il conclut indique »; **autres modifications sans objet dans la version française.**

8. L'article 8 est modifié en ajoutant le paragraphe suivant :

(0.1) Le répertoire des opérations central reconnu établit :

a) une structure organisationnelle qui comprend les responsabilités et les voies hiérarchiques directes, y compris, pour plus de certitude, les rôles et les responsabilités en matière de détermination, de mesure, de surveillance et de gestion des risques matériels;

b) un cadre de gestion des risques qui comprend les niveaux de tolérance aux risques déterminés du répertoire des opérations reconnu;

c) un processus de prise de décision, y compris, pour plus de certitude, les décisions relatives aux crises et aux situations d'urgence;

d) les règles de responsabilité en ce qui concerne les décisions relatives aux risques..

9. Le paragraphe 8(1) est modifié

a) en remplaçant « établit, met en œuvre et maintient des mécanismes de gouvernance écrits clairs et transparents, qui comprennent une structure organisationnelle claire avec une hiérarchisation des responsabilités

cohérente, » **par** « établit et met en œuvre des mécanismes de gouvernance écrits clairs et transparents, »;

b) en ajoutant le paragraphe (b.1) « veiller à ce que les participants puissent accéder efficacement à ses services de communication de données sur les dérivés; ».

10. L'article 9 est modifié en ajoutant le paragraphe suivant :

(4) Le répertoire des opérations reconnu établit, met en œuvre et maintient des politiques et des procédures pour examiner régulièrement le rendement global du conseil d'administration et le rendement de chacun des membres de ce dernier.

11. L'article 12 est abrogé et remplacé par le texte suivant :

12. Le répertoire des opérations reconnu

- a) n'impose pas à ses participants des droits ou d'autres frais importants qui ne sont répartis de façon équitable entre eux;
- b) publie sur son site Web, à tout moment, les droits et autres frais importants qu'il fait porter à ses participants pour chacun des services qu'il offre en ce qui a trait à la collecte et à la mise à jour des données sur les dérivés;
- c) revoit régulièrement les droits et autres frais importants, au moins une fois toutes les deux années civiles..

12. L'article 14 est remplacé par le texte suivant :

Réception de données sur les dérivés

14. Le répertoire des opérations reconnu ne peut refuser les données sur les dérivés qui lui sont déclarées par les participants à l'égard des opérations sur dérivés des catégories d'actifs visés dans sa décision de reconnaissance et pour tous les éléments de données énumérés à l'appendice A..

13. Sauf en Colombie-Britannique, le titre de l'article 15 est modifié en supprimant « , procédures, » après « Politiques ».

14. L'article 18 est modifié

a) au paragraphe 1, en remplaçant les mots « de façon exacte et complète » par les mots « sans erreur ni omission »;

b) au paragraphe 2, en supprimant « devant être déclarés en vertu de la présente règle, » **après** « données sur les dérivés ».

15. L'article 21 est modifié

a) sauf en Colombie-Britannique, dans le titre, en remplaçant « Obligations relatives aux systèmes et aux » **par** « Risques liés aux systèmes »;

b) au paragraphe (3)c), en ajoutant « dès que possible » **après** « fournir », **en ajoutant** « écrit » **après** « rapport d'incident » **et en ajoutant** « et toute mesure correctrice que le répertoire des opérations reconnu a prise ou a l'intention de prendre. » **après** « analyse de la cause fondamentale de l'incident. ».

16. La règle est modifiée en ajoutant ce qui suit :

Transactions exécutées de façon anonyme dans une installation d'opérations sur dérivés

22.1 Le répertoire des opérations reconnu ne divulgue ni l'identité ni l'identifiant pour les entités juridiques d'une contrepartie à une autre contrepartie dans le cadre d'une transaction concernant la contrepartie locale qui

- (a) est exécutée de façon anonyme dans une installation d'opérations sur dérivés;
- (b) donne lieu à un dérivé qui est compensé par une agence de compensation et de dépôt déclarante.

Validation des données

22.2. (1) Le répertoire des opérations reconnu établit, met en œuvre et maintient une procédure de validation.

(2) Dès que technologiquement possible après avoir reçu des données sur les dérivés, le répertoire des opérations reconnu indique à l'installation (y compris le mandataire agissant en son nom) si les données sur les dérivées qu'il a reçues de cette dernière satisfont à sa procédure de validation.

(3) Le répertoire des opérations reconnu accepte les données sur les dérivés qui satisfont à sa procédure de validation.

- (4) Le répertoire des opérations reconnu crée et maintient des dossiers de toutes les données déclarées sur les dérivés qui ne satisfont pas à sa procédure de validation.
- (5) Pour tous les dérivés devant être déclarés en vertu de la règle, y compris, pour plus de certitude, les dérivés expirés ou résiliés, le répertoire des opérations reconnu accepte une correction de la part d'un participant concernant une erreur ou une omission dans les données sur dérivés que ce dernier a déclarées si les données corrigées sur les dérivés satisfont à sa procédure de validation..

17. La règle est modifiée en abrogeant et en remplaçant l'article 23 par ce qui suit :

Vérification des données

23. (1) Aux fins du présent article :

- a) « participant à la vérification » : un participant qui est une contrepartie déclarante à un dérivé, ou qui agit pour cette dernière, et qui est soumis à des obligations de vérification;
- b) « obligations en matière de vérification » : les obligations énoncées aux alinéas 26.1b) ou 26.1c).

- (2) Le répertoire des opérations reconnu établit, met en œuvre et maintient des règles, politiques et procédures écrites qui permettent à un participant de remplir ses obligations de vérification..

18. Le paragraphe 25(1) est modifié, à l'alinéa c), en remplaçant « avant ou au moment de opération » par « avant ou au moment de la transaction, ».

19. L'article 26 est modifié

- a) **au paragraphe (1), en remplaçant « d'un » avant « dérivé » par « relativement à un »;**
- b) **sauf en Colombie-Britannique, aux sous-alinéas i), ii) et iii) de l'alinéa (3)b), en remplaçant « répertoire des opérations et la déclaration de données sur les dérivés » par « déclaration des opérations sur dérivés »;**
- c) **en abrogeant les paragraphes (5), (6) et (7);**
- d) **en abrogeant et en remplaçant le paragraphe (8) par ce qui suit :**

(8) Si la contrepartie locale, autre qu'une agence de déclaration et de dépôt déclarante, désigne un répertoire des opérations reconnu auquel déclarer un dérivé soumis à l'obligation de déclaration en vertu de la présente règle et qui est compensé par une agence de compensation et de dépôt, l'agence de compensation et de dépôt déclarante

a) déclare les données sur les dérivés au répertoire des opérations reconnu désigné;

b) ne déclare pas les données sur les dérivés à un autre répertoire des opérations sans avoir obtenu le consentement de la contrepartie locale;

e) en ajoutant le paragraphe suivant :

(9) La contrepartie déclarante s'assure que toutes les données relatives à un dérivé déclaré satisfont à la procédure de validation du répertoire des opérations reconnu auquel le dérivé est déclaré..

20. La règle est modifiée en ajoutant les articles suivants :

Vérification des données

26.1. La contrepartie déclarante :

a) veille à ce que les données sur les dérivés déclarées ne comportent aucune erreur ou omission;

b) dans le cas d'une contrepartie déclarante qui est un courtier en dérivés visé par le plafonnement du montant notionnel, vérifie au moins une fois par trimestre civil, mais à des intervalles d'au moins deux mois civils que les données sur les dérivés déclarées ne comportent aucune erreur;

c) dans le cas d'une contrepartie déclarante qui est une agence de compensation et de dépôt déclarante ou d'un courtier en dérivés qui n'est pas courtier en dérivés visé par le plafonnement du montant notionnel, vérifie au moins tous les 30 jours que les données sur les dérivés déclarées ne comportent aucune erreur ou omission.

Dérivés déclarés par erreur

26.2. La contrepartie déclarante qui déclare un dérivé par erreur le signale au répertoire des opérations reconnu ou, si les données sur les dérivés ont été déclarées en vertu du paragraphe 26(2), à l'autorité ou à l'organisme de réglementation en

valeurs mobilières, dès qu'il est possible de le faire, mais en aucun cas après la fin du jour ouvrable suivant le jour de la découverte de l'erreur.

Avis d'erreurs et d'omissions concernant les données sur les dérivés

- 26.3. (1)** La contrepartie locale qui n'est pas la contrepartie déclarante avise cette dernière de toute erreur ou omission dans les données sur les dérivés relatives au dérivé auquel elle est la contrepartie, dès que possible de le faire, mais en aucun cas après la fin du jour ouvrable suivant le jour de découverte de l'erreur ou de l'omission.
- (2)** La contrepartie déclarante avise l'autorité ou l'organisme de réglementation des valeurs mobilières toute erreur ou omission importante concernant les données relatives sur les dérivés dès qu'il est possible de le faire suivant sa découverte.

Transfert d'un dérivé à un autre répertoire des opérations reconnu

- 26.4.(1)** La contrepartie déclarante ne change pas le répertoire des opérations reconnu auquel sont déclarées les données relatives à un dérivé, sauf si elle se conforme aux paragraphes (2) et (3).
- (2)** Au moins cinq jours ouvrables avant que la contrepartie déclarante effectue une modification visée au paragraphe (1), elle en informe les entités suivantes :
- (a)** l'autre contrepartie au dérivé;
 - (b)** le répertoire des opérations reconnu auquel les données sur les dérivés sont déclarées avant la modification;
 - (c)** le répertoire des opérations reconnu auquel les données sur les dérivés sont déclarées après la modification.
- (3)** La contrepartie déclarante inclut dans l'avis visé au paragraphe (2) l'IUT du dérivé et la date à laquelle la contrepartie déclarante commencera à déclarer les données sur les dérivés au répertoire des opérations reconnu visé à l'alinéa (2)c).
- (4)** Après avoir donné l'avis visé au paragraphe (2), la contrepartie déclarante déclare le changement de répertoire des opérations reconnu le même jour comme s'il s'agissait d'un événement du cycle de vie en vertu de l'article 32, au répertoire des opérations reconnu visé à l'alinéa (2)b) et au répertoire des opérations reconnu visé à l'alinéa (2)c), et utilise le même IUT pour identifier le dérivé dans la déclaration à chaque répertoire des opérations reconnu.

- (5) Après avoir changé de répertoire des opérations reconnu, la contrepartie déclarante déclare toutes les données relatives à un dérivé au répertoire des opérations visé à l'alinéa (2)c), à moins que la contrepartie déclarante ne change ultérieurement de répertoire des opérations reconnu en vertu du présent article.

21. Le paragraphe 27(2) est modifié en remplaçant « identifiant unique de transaction » par « IUT ».

22. L'article 28 est modifié

a) en abrogeant et en remplaçant le paragraphe (1) par ce qui suit :

- (1) Dans l'ensemble des dossiers et déclarations prévus par la présente règle, le répertoire des opérations reconnu et la contrepartie déclarante identifie chaque contrepartie à un dérivé au moyen d'un seul identifiant pour les entités juridiques unique qui est un code d'identification unique attribué à la contrepartie en conformité avec les normes établies par le Système LEI international;;

b) dans le paragraphe 3, en remplaçant « Si » par « Nonobstant le paragraphe 1, si », en ajoutant « et le répertoire des opérations reconnu » avant « doit identifier », en remplaçant « doit identifier » par « identifiant » et en ajoutant « seul » après « d'un »;

c) en abrogeant le paragraphe 4.

23. L'article 29 est abrogé et remplacé par ce qui suit :

29. (1) Dans l'ensemble des dossiers et des déclarations prévus par la présente règle, le répertoire des opérations reconnu et la contrepartie déclarante identifient chaque dérivé et chaque position en vertu de l'article 33.1 par un seul IUT.

(2) Pour chaque dérivé qui doit être déclaré conformément à la présente règle, la personne ou la société suivante attribue l'IUT au dérivé :

- a) si le dérivé doit aussi être déclaré conformément à la législation des valeurs mobilières d'une province ou d'un territoire du Canada, autre que le territoire intéressé, ou conformément à la législation d'un territoire étranger en vertu de laquelle un dérivé doit être déclaré avant d'être déclaré conformément à la présente règle, la personne ou la société est tenue d'attribuer l'IUT conformément à la législation des valeurs mobilières de ce territoire ou des lois de ce territoire étranger;

- b) si l'alinéa a) ne s'applique pas au dérivé et que celui-ci est compensé par l'intermédiaire d'une agence de compensation et de dépôt déclarante, l'agence de compensation et de dépôt déclarante;
 - c) si les alinéas a) et b) ne s'appliquent pas au dérivé et que la transaction relative au dérivé est exécutée dans une installation de négociation de dérivés qui a attribué un IUT au dérivé, l'installation de négociations de dérivés;
 - d) si les alinéas a) à c) ne s'appliquent pas au dérivé, la contrepartie déclarante ou, s'il y a deux contreparties déclarantes, la contrepartie déclarante ayant le premier identifiant d'entité juridique déterminé en triant les identifiants d'entité juridique par ordre alphanumérique, les caractères des identifiants d'entité juridique étant inversés.
- (3)** Nonobstant l'alinéa (2)d), si les alinéas (2) a) à c) ne s'appliquent pas au dérivé et que les contreparties au dérivé ont convenu par écrit que l'une d'entre elles sera la personne ou la société responsable d'attribuer l'IUT au dérivé, la contrepartie responsable de l'attribution en vertu de cette convention est tenue d'attribuer l'IUT.
- (4)** Nonobstant le paragraphe (2), une personne ou une société qui est tenue d'attribuer un IUT en vertu du paragraphe (2) peut demander qu'un répertoire des opérations reconnu attribue l'IUT si la personne ou la société répond à l'une ou l'autre des exigences suivantes :
- a. un courtier en dérivés visé par le plafonnement du montant notionnel;
 - b. n'est pas une agence de compensation et de dépôt déclarante, une installation d'opérations sur dérivés ou un courtier en dérivés.
- (5)** Si une personne ou une société en fait la demande en vertu du paragraphe (4), le répertoire des opérations reconnu attribue l'IUT dès qu'il est technologiquement possible de le faire après réception de la demande.
- (6)** La personne ou la société visée au paragraphe (2) attribue l'IUT dès que possible après l'exécution de la transaction relative au dérivé, mais pas plus tard que le moment où le dérivé doit être déclaré à un répertoire des opérations reconnu en vertu de la présente règle.
- (7)** Si une installation d'opérations sur dérivés est tenue d'attribuer l'IUT en vertu du paragraphe (2), elle le fournit dès qu'il est technologiquement possible de le faire aux entités suivantes :
- a) chaque contrepartie au dérivé;

- b) si le dérivé est soumis à la compensation, l'agence de compensation et de dépôt déclarante à laquelle le dérivé est soumis à la compensation.
- (8)** Sous réserve du paragraphe (4), si l'une des contreparties à un dérivé non compensé est tenue d'attribuer un IUT en vertu des paragraphes (2) ou (3), elle doit fournir l'IUT dès qu'il est possible de le faire aux entités suivantes :
- a) l'autre contrepartie au dérivé;
 - b) si le dérivé est soumis à la compensation, l'agence de compensation et de dépôt déclarante à laquelle le dérivé est soumis à la compensation.
- (9)** Si le répertoire des opérations reconnu attribue l'IUT en vertu du paragraphe (4), il doit le fournir dès qu'il est technologiquement possible de le faire aux entités suivantes :
- a) chaque contrepartie au dérivé;
 - b) si le dérivé est soumis à la compensation, l'agence de compensation et de dépôt déclarante à laquelle le dérivé est soumis à la compensation.

24. L'article 30 est modifié

- a) en abrogeant et en remplaçant les paragraphes (1) et (2) par ce qui suit :**

30. (1) Dans le présent article, l'« identifiant unique de produit » s'entend d'un code qui identifie de manière unique un type de dérivé et qui est attribué par le Derivatives Service Bureau.

(2) Dans l'ensemble des dossiers et des déclarations prévus par la présente règle, le répertoire des opérations reconnu et une contrepartie déclarante identifient chaque type de dérivé au moyen d'un seul identifiant de produit unique;

- (b) en abrogeant les paragraphes 3 et 4.**

25. L'article 31 est modifié

- a. au paragraphe (1), en ajoutant « autorisée » après « contrepartie déclarante »;**
- b. au paragraphe (2), en ajoutant « autorisée » après « contrepartie déclarante »;**
- c. en ajoutant le paragraphe suivant :**

- (3) La contrepartie déclarante qui n'est pas la contrepartie déclarante autorisée relative au dérivé déclare les données à communiquer à l'exécution au plus tard à la fin du deuxième jour ouvrable suivant la date d'exécution de la transaction..

26. L'article 32 est modifié

- a. sans objet dans la version française;**
- b. au paragraphe (1), en ajoutant « autorisée » après « contrepartie déclarante »;**
- c. au paragraphe 2, en ajoutant « autorisée » après « contrepartie déclarante » et en ajoutant « toutes » avant « les données sur les événements de cycle de vie »;**
- d. en ajoutant les paragraphes suivants :**

- (3) La contrepartie déclarante qui n'est pas la contrepartie déclarante autorisée relativement à un dérivé déclare toutes les données relatives aux événements du cycle de vie au plus tard à la fin du jour ouvrable suivant le jour où l'événement du cycle de vie s'est produit.
- (4) Nonobstant les paragraphes (1) à (3), l'agence de compensation et de dépôt déclarante par l'intermédiaire de laquelle un dérivé est compensé déclare la résiliation du dérivé initial au répertoire des opérations reconnu auquel les données sur les dérivés relatives à ce dérivé initial ont été déclarées, au plus tard à la fin du jour ouvrable suivant le jour où le dérivé initial est résilié.

27. L'article 33 est abrogé et remplacé par ce qui suit :

Données de valorisation et données sur les sûretés et les marges

- 33. (1)** Dans le cas d'un dérivé qu'il faut déclarer conformément à la présente règle, la contrepartie déclarante qui est un courtier en dérivés ou une agence de compensation et de dépôt déclarante déclare, chaque jour ouvrable, au répertoire des opérations reconnu :
- a) les données de valorisation;
- b) les données sur les sûretés et les marges.
- (2) Si des données par position liées à des dérivés ont été déclarées conformément à l'article 33.1, la contrepartie déclarante calcule et déclare le montant net des achats et ventes déclarés comme données par position pour de tels dérivés..

28. La règle est modifiée en ajoutant l'article suivant :

Données par position

33.1.(1) Aux fins de l'article 32, la contrepartie déclarante peut déclarer les données sur les événements de cycle de vie comme données par position à l'égard de chaque dérivé pour lequel les données sur les événements de cycle de vie ont été regroupées

a) fait partie d'une catégorie de dérivés au sein de laquelle chaque dérivé est fongible avec tous les autres dérivés de la catégorie;

b) ne comporte pas de date d'expiration fixe ou est un dérivé sur marchandises.

(2) Aux fins du paragraphe 33(1), la contrepartie déclarante qui est un courtier en dérivés ou une agence de compensation et de dépôt déclarante peut déclarer les données de valorisation ainsi que les données sur les sûretés et les marges comme données par position à l'égard de chaque dérivé pour lequel les données de valorisation et les données sur les sûretés et les marges sont regroupées :

a) fait partie d'une catégorie de dérivés au sein de laquelle chaque dérivé est fongible avec tous les autres dérivés de la catégorie;

b) ne comporte pas de date d'expiration fixe ou est un dérivé sur marchandise..

29. L'article 35 est modifié remplaçant « 34 » par « 33 ».

30. La règle est modifiée en ajoutant l'article suivant :

Installation d'opérations sur dérivés

36.1.(1) Dans le présent article, « dérivé anonyme » s'entend d'un dérivé pour lequel la transaction est exécutée de façon anonyme dans une installation d'opérations sur dérivés et qui, au moment de l'exécution de la transaction, est destiné à être compensé.

(2) L'article 25 ne s'applique pas aux dérivés anonymes.

(3) Nonobstant le paragraphe (2), en ce qui concerne un dérivé anonyme :

a) tout renvoi à une « contrepartie déclarante » dans les dispositions suivantes signifie une « installation d'opérations sur dérivés » : paragraphes 22.2(2), 26(1), 26(2), 26(4) et 26(9); alinéa 26.1a); article 26.2; paragraphes 26.3(1), 26.3(2) et 26.4(1); article 27; paragraphes 28(1), 28(3), 29(1), 30(2) et 31(1);

articles 35 et 36; paragraphe 37(3); articles 41 et 42;

b) tout renvoi à une « contrepartie déclarante autorisée » à l'article 31 signifie une « installation d'opérations sur dérivés ».

(4) Nonobstant le paragraphe (2), en ce qui concerne un instrument dérivé anonyme, une installation d'opérations sur dérivés :

(a) peut déclarer l'identifiant pour les entités juridiques d'un mandataire d'une contrepartie en ce qui concerne l'élément de données n° 1 « Contrepartie 1 (contrepartie déclarante) » et l'élément de données n° 2 « Contrepartie 2 » (contrepartie non déclarante) identifiés à l'annexe A si une transaction relative au dérivé est exécutée avant que le dérivé ne soit réparti entre les contreparties pour le compte desquelles le mandataire agit;

(b) n'est pas tenu de déclarer les éléments de données suivants figurant à l'annexe A :

(i) Élément de données n° 20 « Indicateur intragroupe » ;

(ii) Élément de données n° 24 « Type d'accord-cadre »;

(iii) Élément de données n° 25 « Version de l'accord-cadre »;

(iv) Élément de données n° 77 « Exceptions et dispenses de compensation – contrepartie 1 »;

(v) Élément de données n° 78 « Exceptions et dispenses de compensation – contrepartie »;

(vi) Élément de données n° 96 « Niveau »;

(vii) Élément de données n° 121 « Indicateur de cryptoactif sous-jacent ».

(5) Nonobstant le paragraphe (2), à l'égard d'un dérivé anonyme, lorsque l'installation d'opérations sur dérivés, en dépit de ses efforts diligents et raisonnablement fréquents, n'a pas encore déterminé si l'un de ses participants, ou le client de celui-ci, est une contrepartie locale conformément à l'alinéa c) de la définition de « contrepartie locale » dans une province ou un territoire du Canada, le participant, ou son client, n'est pas une contrepartie locale au sens de cet alinéa aux fins de déclaration par l'installation en vertu de la présente règle jusqu'à la première des dates suivantes :

- (a) la date à laquelle l'installation détermine que le participant, ou son client, est une contrepartie locale en vertu de cet alinéa;
- (b) le 31 juillet 2029..

31. L'article 38 est modifié

- a. dans le titre, en remplaçant « contreparties » par « participants »;**
- b. en abrogeant et en remplaçant les paragraphes (1) et (2) par ce qui suit :**
 - (1) Sous réserve de l'article 22.1, le répertoire des opérations reconnu fournit en temps opportun à un participant qui est la contrepartie à un dérivé, ou qui agit pour le compte de cette dernière, l'accès intégral aux données qui lui ont été communiquées.
 - (2) Le répertoire des opérations reconnu se dote de procédures d'autorisation adéquates pour encadrer l'accès, fourni en application du paragraphe (1) au participant qui est la contrepartie non déclarante ou qui agit en son nom;
- c. dans le paragraphe (3), en remplaçant « Chaque » par « Sous réserve de l'article 22.1, chaque » avant « contrepartie d'un dérivé »..**

32. L'article 39 est modifié

- a. en abrogeant et en remplaçant le paragraphe (1) par ce qui suit :**
 - (1) Le répertoire des opérations reconnu crée avec une fréquence raisonnable des données globales sur les positions ouvertes, le volume et le nombre relativement aux dérivés qui lui sont déclarés conformément à la présente règle.;
- b. au paragraphe 2, en remplaçant « mises à la disposition du public conformément au » par « visées par le » après « Les données », en supprimant « du territoire de l'entité ou de l'actif de référence, » après « la monnaie de libellé » et en remplaçant « d'échéance » par « d'expiration » après « du type de contrat, »;**
- c. en abrogeant et en remplaçant le paragraphe (3) par ce qui suit :**
 - (3) Pour chaque dérivé déclaré en vertu de la présente règle, le répertoire des opérations reconnu met à la disposition du public les rapports sur les

transactions conformément aux exigences de l'annexe C, pendant au moins un an après la première publication de chaque rapport.;

- d. au paragraphe (5), en remplaçant** « les données visées » **par** « les données et les rapports visés » **et en ajoutant** « et, dans le cas des rapports sur les transactions visés au paragraphe (3), pendant au moins un an après la première publication de chaque rapport » **après** « à titre gratuit. ».

33. L'article 40 est abrogé et remplacé par le texte suivant :

Dérivés sur marchandises

40. (1) Malgré le chapitre 3, et sous réserve du paragraphes 25(4) et du paragraphe (2) du présent article, la contrepartie locale n'est pas tenue de déclarer les données sur les dérivés relatif à un dérivé sur marchandises si les conditions suivantes sont réunies :

- a) cette contrepartie n'est pas une contrepartie déclarante autorisée;
- b) le montant notionnel brut global de l'ensemble des dérivés sur marchandises de la contrepartie locale et de ceux de chaque entité du même groupe qui est une contrepartie locale dans toute province ou tout territoire du Canada, sauf conformément à l'alinéa b) de la définition de « contrepartie locale », qui étaient en cours à la fin du mois, à l'exclusion de ceux conclus avec des entités du même groupe, n'a pas excédé 250 000 000 \$ au cours des 12 mois civils précédents.

(2) La contrepartie locale qui cesse de remplir la condition prévue au sous-alinéa (1)a) ou b) commence à déclarer les données sur les dérivés 180 jours après la date à laquelle elle ne la remplit plus, sauf si elle y satisfait de nouveau pendant cette période..

34. L'article 41 est modifié par l'ajout de « déclarante » après « contrepartie ».

35. L'article 41.1 est abrogé et remplacé par ce qui suit :

Dérivés entre entités du même groupe

41.1. Malgré le chapitre 3, la contrepartie déclarante n'est pas tenue de déclarer les données relatives à un dérivé si, au moment de l'exécution de la transaction, les conditions suivantes sont réunies :

- (a) les contreparties du dérivé sont des entités du même groupe;

- (b) aucune contrepartie n'est une contrepartie déclarante autorisée..

36. L'article 42 est modifié

a) en le renumérotant comme paragraphe 42(1) et ajouter « déclarante » après « contrepartie », et

b) en ajoutant le paragraphe suivant :

- (2) Le paragraphe (1) ne s'applique pas si le dérivé concerne une contrepartie qui est un particulier résidant dans le territoire intéressé..

37. L'article 42.1 est abrogé.

38. L'article 45 est abrogé.

39. Le texte de l'annexe A est remplacé par ce qui suit :

ANNEXE A
de la
NORME MULTILATÉRALE 96-101
SUR LA DÉCLARATION DES OPÉRATIONS SUR DÉRIVÉS

Éléments de données minimaux à déclaration au répertoire des opérations reconnu

Conformément au chapitre 3 de la présente règle, la contrepartie déclarante est tenue de fournir tous les éléments de données, sauf ceux qui ne sont pas pertinents.

La présente annexe renferme tous les éléments de données et leur description et indique s'ils doivent être rendus publics ou non, conformément au chapitre 4 et à l'annexe C de la règle.

Dans la présente annexe A, on entend par « installation d'opérations » une « installation d'opérations sur dérivés » et par « règles sur la déclaration de données sur les dérivés de tout territoire du Canada » désigne le Rule 91-507 *Derivatives: Trade Reporting* de la Commission des valeurs mobilières du Manitoba intitulée, le Rule 91-507 *Derivatives: Trade Reporting Regulation* de la Commission des valeurs mobilières de l'Ontario, le Règlement 91-507 sur la *sur les référentiels centraux et la déclaration de données sur les dérivés* du Québec, ou la Norme multilatérale 96-101 sur la *déclaration des opérations sur dérivés*.

Le Manuel technique des données sur les dérivés des ACVM, qui constitue l'annexe A de l'Instruction complémentaire, offre des spécifications techniques détaillées concernant les éléments de données qui doivent être déclarés en vertu de la présente règle. Cet encadré ne fait pas partie de la règle et n'a pas de statut officiel.

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
Éléments de données relatifs aux contreparties			
1	Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)	L'identifiant de la contrepartie déclarante.	N
2	Contrepartie 2 (contrepartie non déclarante)	L'identifiant de la contrepartie non déclarante.	N
3	Source d'identification de la contrepartie 2	Le type d'identifiant de la contrepartie 2.	N
4	Identifiant de l'acheteur	L'identifiant de la contrepartie qui est l'acheteur.	N

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
5	Identifiant du vendeur	L'identifiant de la contrepartie qui est le vendeur.	N
6	Identifiant du payeur	L'identifiant de la contrepartie de la branche du payeur.	N
7	Identifiant du receveur	L'identifiant de la contrepartie de la branche receveuse.	N
8	Identifiant du courtier	L'identifiant d'un courtier qui agit comme intermédiaire pour la contrepartie 1 sans devenir lui-même une contrepartie.	N
9	Pays et province ou territoire du particulier (contrepartie non déclarante)	Si le particulier est une contrepartie non déclarante, son pays de résidence, et si elle réside au Canada, la province ou le territoire.	N
10	Territoire de la contrepartie 1	<p>Chaque territoire dans lequel la contrepartie correspond à l'un ou l'autre des éléments suivants :</p> <ul style="list-style-type: none"> • une contrepartie locale conformément à l'alinéa a) ou c) de la définition de cette expression dans les règles sur la déclaration des données sur les dérivés de tout territoire du Canada; • une contrepartie locale conformément à l'alinéa b) de la définition de cette expression dans les règles sur la déclaration des données sur les dérivés de tout territoire du Canada, si la contrepartie non déclarante est un particulier résidant dans le territoire; • une contrepartie locale conformément à l'alinéa b) de la définition de cette expression dans le Règlement 91-507 <i>sur les référentiels centraux et la déclaration de données sur les dérivés</i>(Québec) qui est 	N

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
		une personne agréée en vertu de l'article 82 de la <i>Loi sur les instruments dérivés</i> (Québec).	
11	Territoire de la contrepartie 2	<p>Chaque territoire dans lequel la contrepartie correspond à l'un ou l'autre des éléments suivants :</p> <ul style="list-style-type: none"> • une contrepartie locale conformément à l'alinéa a) ou c) de la définition de cette expression dans les règles sur la déclaration des données sur les dérivés de tout territoire du Canada; • une contrepartie locale conformément à l'alinéa b) de la définition de cette expression dans le Règlement 91-507 <i>sur les référentiels centraux et la déclaration de données sur les dérivés</i>(Québec) qui est une personne agréée en vertu de l'article 82 de la <i>Loi sur les instruments dérivés</i> (Québec). 	N
Éléments de données relatifs aux dérivés			
12	Date d'entrée en vigueur	La date non ajustée, indiquée dans la confirmation, à laquelle les obligations relatives au dérivé entrent en vigueur.	O
13	Date d'expiration	La date non ajustée, indiquée dans la confirmation, à laquelle les obligations relatives au dérivé cessent d'avoir effet.	O
14	Horodatage de l'exécution	La date et l'heure de l'exécution d'une transaction.	O
15	Horodatage de la déclaration	La date et l'heure de soumission de la déclaration au répertoire des opérations.	N

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
16	Identifiant unique de transaction (IUT)	L'identifiant unique qui identifie un dérivé ou une position pendant tout son cycle de vie.	N
17	IUT antérieur (pour les relations d'une à une et d'une à plusieurs entre les transactions)	L'IUT attribué à un dérivé avant la survenance d'un événement du cycle de vie ayant donné lieu au dérivé actuel.	N
18	IUT de la position subséquente	L'IUT de la position dans laquelle le dérivé est inclus.	N
19	IUS antérieur (pour les relations d'une à une et d'une à plusieurs entre les transactions)	L'identifiant unique de swap (IUS) attribué à un dérivé avant la survenance d'un événement du cycle de vie ayant donné lieu au dérivé actuel.	N
20	Indicateur intragroupe	L'indication que le dérivé est conclu ou non entre deux entités du même groupe.	N
21	Identifiant de l'initiateur	L'identifiant de l'entité soumettant les données sur les dérivés au répertoire des opérations.	N
22	Identifiant de l'installation	L'identifiant de l'installation sur laquelle la transaction a été exécutée.	O
23	Indicateur d'exécution anonyme sur l'installation	Indicateur permettant de savoir si la transaction a été exécutée de manière anonyme sur un système de négociation.	N
24	Type d'accord-cadre	Le type d'accord-cadre.	N
25	Version de l'accord-cadre	L'année de la version de l'accord-cadre.	N
Éléments de données relatifs aux montants et aux quantités notionnels			
26	Montant notionnel	Montant notionnel à l'égard de chaque branche d'un dérivé :	O

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
		<ul style="list-style-type: none"> • si le dérivé est négocié en montant monétaire, le montant qui y est stipulé; • si le dérivé est négocié en montant non monétaire, le convertir en montant monétaire. <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>Consulter l'annexe 3.1 du <i>Manuel technique des données sur les dérivés des ACVM</i> pour convertir un montant notionnel en un montant non monétaire. Cet encadré ne fait pas partie de la règle et n'a pas de statut officiel.</p> </div>	
27	Monnaie notionnelle	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, la monnaie du montant notionnel.	O
28	Montant d'achat	Le montant monétaire qu'une personne a le droit d'acheter en vertu d'une option.	N
29	Monnaie d'achat	La monnaie du montant d'achat d'une option.	N
30	Monnaie de vente	Le montant monétaire qu'une personne a le droit de vendre en vertu d'une option.	N
31	Monnaie de vente	La monnaie du montant de vente d'une option.	N
32	Quantité notionnelle	À l'égard de chaque branche d'un dérivé négocié en montant non monétaire, la quantité notionnelle fixe pour chaque période du tableau.	N
33	Fréquence de cotation de la quantité	La période pour laquelle la quantité est cotée.	N
34	Fréquence de cotation de la quantité – multiplicateur	Le nombre de périodes de la fréquence de la cotation de la quantité.	N
35	Unité de mesure de la quantité	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, l'unité de mesure de la quantité notionnelle totale et de	N

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
		la quantité notionnelle.	
36	Quantité notionnelle totale	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, la quantité notionnelle globale de l'élément sous-jacent pendant la durée du dérivé.	N
37	Tableau de la quantité notionnelle – date non ajustée de prise d'effet de la quantité notionnelle associée	Pour chaque quantité notionnelle indiquée dans le tableau, la date de prise d'effet (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) de la quantité notionnelle.	N
38	Tableau de la quantité notionnelle – date de fin non ajustée de la quantité notionnelle	Pour chaque quantité notionnelle indiquée dans le tableau, la date de fin (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) de la quantité notionnelle.	N
39	Tableau de la quantité notionnelle – quantité notionnelle en vigueur à la date de prise d'effet associée	Chaque quantité notionnelle, indiquée dans un tableau, à compter de la date précisée dans l'élément de données n° 37 jusqu'à celle stipulée dans l'élément de données n° 38.	N
40	Tableau de montants notionnels – montant notionnel en vigueur à la date de prise d'effet associée	Chaque montant notionnel, indiqué dans un tableau, en vigueur à compter de la date précisée dans l'élément de données n° 41 jusqu'à celle stipulée dans l'élément de données n° 42.	N
41	Tableau de montants notionnels – date de prise d'effet non ajustée du montant notionnel	Pour chaque montant notionnel indiqué dans un tableau, la date de prise d'effet (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du montant notionnel.	N
42	Tableau de montants notionnels – date de fin non ajustée du montant notionnel	Pour chaque montant notionnel indiqué dans le tableau, la date de fin (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du montant notionnel.	N
Éléments de données relatifs aux prix			

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
43	Taux de change	Le taux de change de deux monnaies stipulées au dérivé.	N
44	Base du taux de change	La paire et l'ordre des monnaies dans lesquelles le taux de change est libellé.	N
45	Taux fixe	À l'égard de chaque branche d'un dérivé prévoyant des paiements périodiques, le taux annuel de la branche fixe.	O
46	Prix	Le prix indiqué dans le dérivé.	O
47	Monnaie du prix	La monnaie dans laquelle le prix est libellé.	O
48	Notation du prix	La manière dont le prix est exprimé.	O
49	Unité de mesure du prix	L'unité de mesure dans laquelle le prix est exprimé.	N
50	Tableau de prix – date de prise d'effet non ajustée du prix	Pour chaque prix indiqué dans un tableau, la date de prise d'effet (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix.	N
51	Tableau de prix – date de fin non ajustée du prix	Pour chaque prix indiqué dans un tableau, la date de fin (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix.	N
52	Tableau de prix – prix	Chaque prix, indiqué dans un tableau, en vigueur à compter de la date précisée dans l'élément de données n° 50 jusqu'à celle stipulée dans l'élément de données n° 51.	N
53	Écart	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, l'écart précisé sur le prix de référence.	O
54	Monnaie de l'écart	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, la monnaie dans laquelle un écart est libellé.	O

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
55	Notation de l'écart	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, la manière dont est exprimé un écart.	O
56	Prix d'exercice	Pour le dérivé qui est une option, le prix auquel son titulaire peut acheter ou vendre l'élément sous-jacent.	O
57	Monnaie du prix d'exercice et de la paire de monnaies	La monnaie ou la paire et l'ordre des monnaies dans lesquelles le prix d'exercice est libellé.	N
58	Notation du prix d'exercice	La manière dont le prix d'exercice est exprimé.	O
59	Date de prise d'effet non ajustée du prix	La date de prise d'effet (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix.	N
60	Date de fin non ajustée du prix	La date de fin (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix.	N
61	Prix en vigueur entre la date de prise d'effet non ajustée et la date de fin non ajustée	Le prix en vigueur à compter de la date indiquée dans l'élément de données n° 59 jusqu'à celle stipulée dans l'élément de données n° 60.	N
62	Date de prise d'effet du prix d'exercice	La date de prise d'effet (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix d'exercice.	N
63	Date de fin du prix d'exercice	La date de fin (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix d'exercice.	N
64	Prix d'exercice en vigueur à la date de prise d'effet associée	Le prix d'exercice en vigueur à compter de la date indiquée dans l'élément de données n° 62 jusqu'à celle stipulée dans l'élément de données n° 63.	N
65	Tableau de prix d'exercice – date de prise d'effet non ajustée du prix d'exercice	Pour chaque prix d'exercice indiqué dans un tableau, la date de prise d'effet (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix	N

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
		d'exercice.	
66	Tableau de prix d'exercice – date de fin non ajustée du prix d'exercice	Pour chaque prix d'exercice indiqué dans un tableau, la date de fin (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix d'exercice.	N
67	Tableau de prix d'exercice – prix d'exercice	Chaque prix d'exercice, indiqué dans un tableau, en vigueur à compter de la date précisée dans l'élément de données n° 65 jusqu'à celle stipulée dans l'élément de données n° 66.	N
68	Indicateur de modalités non normalisées	L'indication que le dérivé comporte ou non au moins une disposition qui influe considérablement sur son prix, et qu'elle n'a pas été diffusée dans le public.	O
69	Convention de calcul des jours	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, la convention de calcul des jours utilisée pour établir le mode de calcul des paiements d'intérêts.	O
70	Fréquence de révision du taux variable – unité de temps	À l'égard de chaque branche variable d'un dérivé, l'unité de temps de la fréquence des révisions.	O
71	Fréquence de révision du taux variable – multiplicateur	À l'égard de chaque branche variable d'un dérivé, le nombre par lequel est multiplié l'unité de temps de la fréquence de révision du taux variable afin de déterminer la fréquence des dates de révision du taux des paiements périodiques.	O
Éléments de données relatifs à la compensation			
72	Compensé	Indique si un dérivé a été ou sera compensé par une agence de compensation et de dépôt.	O
73	Identifiant de la contrepartie centrale	Identifie l'agence de compensation et de dépôt qui a compensé le dérivé.	N

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
74	Origine du compte de compensation	Indique si le membre compensateur agit comme contrepartiste ou comme mandataire.	N
75	Identifiant du membre compensateur	Identifie le membre compensateur qui fait compenser le dérivé auprès d'une agence de compensation et de dépôt.	N
76	Horodatage de la réception pour compensation	La date et l'heure, exprimées en temps universel coordonné, auxquelles le dérivé initial a été enregistré comme reçu par l'agence de compensation et de dépôt aux fins de compensation.	N
77	Exceptions et dispenses de compensation – contrepartie 1	Le type de dispense ou d'exception de compensation applicable à la contrepartie 1.	N
78	Exceptions et dispenses de compensation – contrepartie 2	Le type de dispense ou d'exception de compensation applicable à la contrepartie 2.	N
Éléments de données relatifs aux sûretés et aux marges			
79	Catégorie de sûreté	Indique s'il existe une convention de sûreté entre les contreparties et précise la nature de la sûreté.	N
80	Portefeuille contenant un indicateur de composante à ne pas déclarer	Dans le cas où les sûretés sont déclarées au niveau du portefeuille, indique si ce portefeuille inclut des dérivés visés par une dispense ou une exception de déclaration	N
81	Marge initiale déposée par la contrepartie déclarante (avant décote)	La valeur monétaire de la marge initiale déposée par la contrepartie déclarante avant l'application d'une décote.	N

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
82	Marge initiale déposée par la contrepartie déclarante (après décote)	La valeur monétaire de la marge initiale déposée par la contrepartie déclarante après l'application d'une décote.	N
83	Monnaie de la marge initiale déposée	La monnaie dans laquelle la marge initiale déposée est libellée.	N
84	Marge initiale collectée par la contrepartie déclarante (avant décote)	La valeur monétaire de la marge initiale collectée par la contrepartie déclarante avant l'application d'une décote.	N
85	Marge initiale collectée par la contrepartie déclarante (après décote)	La valeur monétaire de la marge initiale collectée par la contrepartie déclarante après l'application d'une décote.	N
86	Monnaie de la marge initiale collectée	La monnaie dans laquelle la marge initiale collectée est libellée.	N
87	Marge de variation déposée par la contrepartie déclarante (avant décote)	La valeur monétaire de la marge de variation déposée par la contrepartie déclarante avant l'application d'une décote.	N
88	Marge de variation déposée par la contrepartie déclarante (après décote)	La valeur monétaire de la marge de variation déposée par la contrepartie déclarante après l'application d'une décote.	N
89	Monnaie de la marge de variation déposée	La monnaie dans laquelle la marge de variation déposée est libellée.	N
90	Marge de variation collectée par la contrepartie déclarante (avant décote)	La valeur monétaire de la marge de variation collectée par la contrepartie déclarante avant l'application d'une décote.	N
91	Marge de variation collectée par la contrepartie déclarante	La valeur monétaire de la marge de variation collectée par la contrepartie déclarante après	N

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
	(après décote)	l'application d'une décote.	
92	Monnaie de la marge de variation collectée	La monnaie dans laquelle la marge de variation collectée est libellée.	N
93	Code du portefeuille de sûretés – marge de variation	Si les sûretés sont déclarées au niveau du portefeuille, le code unique attribué par la contrepartie déclarante qui identifie la marge de variation relative aux transactions ouvertes incluses dans le portefeuille.	N
94	Code du portefeuille de sûretés – marge initiale	Si les sûretés sont déclarées au niveau du portefeuille, le code unique attribué par la contrepartie déclarante qui identifie la marge initiale relative aux transactions ouvertes incluses dans le portefeuille.	N
Éléments de données relatifs aux actions et aux événements			
95	Horodatage de l'événement	La date et l'heure de l'événement relatif à un dérivé.	O
96	Niveau	Indique si la déclaration se rapporte au dérivé ou à la position.	N
97	Identifiant d'événement	L'identifiant unique qui lie les dérivés se rapportant à un événement.	N
98	Type d'action	Indique le type d'action ou de déclaration qui se rapporte au dérivé ou à la position.	O
99	Type d'événement	Indique le type d'événement du cycle de vie ou le motif de l'action dont il est question à l'élément de données n° 98.	O
100	Indicateur de modification	Indique si une modification du dérivé se rapporte	O

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
		à un événement.	
Éléments de données relatifs à la valorisation			
101	Montant de valorisation	La valeur du dérivé.	N
102	Monnaie de valorisation	La monnaie dans laquelle le montant de valorisation est libellé.	N
103	Méthode de valorisation	La source et la méthode utilisées pour valoriser le dérivé.	N
104	Horodatage de la valorisation	La date et l'heure auxquelles a été établie la valeur du dérivé visé dans l'élément de données n° 101.	N
105	Prochaine date de révision du taux variable de référence	La prochaine date à laquelle le taux variable de référence sera révisé.	N
106	Dernière valeur du taux variable de référence	La valeur du taux variable de référence à la date visée dans l'élément de données n° 107.	N
107	Dernière date de révision du taux variable de référence	La date la plus récente de la révision du taux variable de référence.	N
108	Delta	Le coefficient exprimant le rapport entre la variation du prix du dérivé et la variation du prix de l'élément sous-jacent du dérivé.	N
Éléments de données relatifs aux paquets			
109	Indicateur de paquet de dérivés	L'indication que le dérivé est ou non une composante d'un paquet qui inclut l'un des éléments suivants : a) au moins deux dérivés déclarés séparément par la contrepartie déclarante sont conclus en vertu d'une seule entente;	O

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
		b) au moins deux déclarations relatives au même dérivé si une seule ne peut suffire en raison des obligations de déclaration d'au moins un territoire du Canada ou étranger.	
110	Identifiant de paquet de dérivés	Identifie le paquet visé à l'élément de données n° 109.	N
111	Prix du paquet de dérivés	Le prix du paquet visé à l'élément de données n° 109.	N
112	Monnaie du prix du paquet de dérivés	La monnaie dans laquelle le prix du paquet de dérivés est libellé.	N
113	Écart du paquet de dérivés	Le prix du paquet visé à l'élément de données n° 109, exprimé sous forme d'écart.	N
114	Monnaie de l'écart du paquet de dérivés	La monnaie dans laquelle l'écart du paquet de dérivés est libellé.	N
115	Notation de l'écart du paquet de dérivés	La manière dont l'écart du paquet de dérivés est exprimé.	N
116	Notation du prix du paquet de dérivés	La manière dont le prix du paquet de dérivés est exprimé.	N
Éléments de données relatifs au produit			
117	Identifiant unique de produit	Un code unique attribué par le Derivatives Service Bureau qui identifie un type de dérivé.	O
118	Point d'attachement de l'indice de swaps sur défaillance	Le point auquel le niveau de pertes du portefeuille sous-jacent d'un swap sur défaillance réduit le notionnel d'une tranche.	N

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
119	Point de détachement de l'indice de swaps sur défaillance	Le point au-delà duquel les pertes du portefeuille sous-jacent d'un swap sur défaillance ne réduisent plus le notionnel d'une tranche.	N
120	Facteur d'indice	Le facteur de la version de l'indice ou le pourcentage utilisé pour établir le montant notionnel d'un swap sur défaillance.	O
121	Indicateur de cryptoactif sous-jacent	L'indication que l'élément sous-jacent du dérivé est ou non un cryptoactif.	N
122	Code du panier sur mesure	Un identifiant unique pour le panier sur mesure de l'actif de référence.	N
123	Indicateur de panier sur mesure	L'indication que l'élément sous-jacent du dérivé est ou non un panier sur mesure.	O
124	Identifiant des composantes du panier	Identifie un actif de référence composant le panier sur mesure.	N
125	Source de l'identifiant des composantes du panier	La source de l'identifiant des composantes du panier visé à l'élément de données n°124.	N
126	Nombre d'unités des composantes du panier	Le nombre d'unités de chaque actif de référence composant le panier sur mesure.	N
127	Unité de mesure des composantes du panier	L'unité de mesure dans laquelle est exprimé le nombre d'unités visé dans l'élément de données n° 126.	N
128	Identifiant du sous-jacent (Autre)	Identifie chaque élément sous-jacent du dérivé.	N
129	Source de l'identifiant du sous-jacent (Autre)	La source de l'identifiant du sous-jacent (Autre) visé dans l'élément de données n° 128.	N
130	Identifiant de la plateforme de	Identifie la plateforme sur laquelle est négocié l'élément sous-jacent visé dans l'élément de	N

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
	négociation de l'actif sous-jacent	données n° 128.	
131	Source du prix de l'actif sous-jacent	La source du prix utilisé pour établir la valeur ou le niveau de l'élément sous-jacent visé dans l'élément de données n° 128.	N
132	Type d'option incorporée	Le type de disposition facultative dans un dérivé.	O
Éléments de données relatifs aux paiements et au règlement			
133	Date contractuelle de règlement définitif	La date précisée dans la convention à laquelle il faut avoir rempli toutes les obligations prévues par le dérivé.	N
134	Lieu de règlement	Le lieu de règlement du dérivé.	N
135	Monnaie de règlement	À l'égard de chaque branche du dérivé, la monnaie dans laquelle le règlement en espèces est libellé.	O
136	Montant de l'autre paiement	Le montant de chaque paiement prévu par un dérivé, à l'exception du montant de la prime de l'option visé dans l'élément de données n° 144.	O
137	Monnaie de l'autre paiement	La monnaie dans laquelle le montant de l'autre paiement visé dans l'élément de données n° 136 est libellé.	O
138	Date de l'autre paiement	La date à laquelle le montant de l'autre paiement visé dans l'élément de données n° 136 sera payé.	N
139	Payeur de l'autre paiement	Identifie le payeur du montant de l'autre paiement visé dans l'élément de données n° 136.	N
140	Receveur de l'autre paiement	Identifie le receveur du montant de l'autre paiement visé dans l'élément de données n° 136.	N

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
141	Type de l'autre paiement	Le motif du paiement visé dans l'élément de données n° 136.	O
142	Fréquence des paiements – unité de temps	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, l'unité de temps de la fréquence des paiements.	O
143	Fréquence des paiements – multiplicateur	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, le nombre par lequel les unités de temps de la fréquence des paiements sont multipliées afin d'établir la fréquence des dates des paiements périodiques.	O
144	Montant de la prime de l'option	La prime payée par l'acheteur d'une option ou d'une swaption.	O
145	Monnaie de la prime de l'option	La monnaie dans laquelle la prime visée dans l'élément de données n° 144 est libellée.	O
146	Date de paiement de la prime de l'option	La date à laquelle la prime visée dans l'élément de données n° 144 est payée.	N
147	Première date d'exercice	La première date à laquelle une option peut être exercée.	O
148	Date de fixation	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, la date à laquelle le taux de référence est établi.	N

40. L'annexe B est remplacée par ce qui suit :

ANNEXE B

de la
NORME MULTILATÉRALE 96-101
SUR LA DÉCLARATION DES OPÉRATIONS SUR DÉRIVÉS

Lois équivalentes de territoires étrangers relatives à la déclaration de données sur les dérivés et assujetties à une présomption de conformité en vertu du sous-alinéa 26(3)b)(v) de la règle

Les autorités et organismes de réglementation des valeurs mobilières ont déterminé que les lois et règlements des territoires à l'extérieur des territoires intéressés sont équivalents pour les besoins de présomption de conformité aux dispositions du sous-alinéa 26(3)b)(v).

Territoire	Loi, règlement ou règle
Union européenne	<p>Règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil du 4 juillet 2012 sur les produits dérivés de gré à gré, les contreparties centrales et les référentiels centraux.</p> <p>Règlement délégué (UE) n° 2017/979 de la Commission du 2 mars 2017 modifiant le règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil sur les produits dérivés de gré à gré, les contreparties centrales et les référentiels centraux en ce qui concerne la liste des entités exemptées.</p> <p>Règlement délégué (UE) 2019/460 de la Commission du 30 janvier 2019 modifiant le règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil en ce qui concerne la liste des entités exemptées.</p> <p>Règlement délégué (UE) n°2019/834 du Parlement européen et du Conseil du 20 mai 2019 modifiant le règlement (UE) n° 648/2012 en ce qui concerne l'obligation de compensation, la suspension de l'obligation de compensation, les obligations de déclaration, les techniques d'atténuation des risques pour les contrats dérivés de gré à gré non compensés par une contrepartie centrale, l'enregistrement et la surveillance des référentiels centraux et les exigences applicables aux référentiels centraux.</p> <p>Règlement délégué (UE) n° 148/2013 de la Commission du 19 décembre 2012 complétant le règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil sur les produits dérivés de gré à gré, les contreparties centrales et les référentiels centraux en ce qui concerne les normes techniques de réglementation sur les informations minimales à déclarer aux référentiels centraux.</p>

Territoire	Loi, règlement ou règle
	<p>Règlement délégué (UE) 2017/104 de la Commission du 19 octobre 2016 modifiant le règlement délégué (UE) n° 148/2013 complétant le règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil sur les produits dérivés de gré à gré, les contreparties centrales et les référentiels centraux en ce qui concerne les normes techniques de réglementation sur les informations minimales à déclarer aux référentiels centraux.</p> <p>Règlement délégué (UE) n° 151/2013 de la Commission du 19 décembre 2012 complétant le règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil sur les produits dérivés de gré à gré, les contreparties centrales et les référentiels centraux par des normes techniques de réglementation précisant les informations à publier et à mettre à disposition par les référentiels centraux, ainsi que les normes opérationnelles à respecter pour l'agrégation, la comparaison et l'accessibilité des données.</p> <p>Règlement délégué (UE) 2017/1800 de la Commission du 29 juin 2017 modifiant le règlement délégué (UE) n° 151/2013 complétant le règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil.</p> <p>Règlement délégué (UE) 2019/361 de la Commission du 13 décembre 2018 modifiant le règlement délégué (UE) n° 151/2013 en ce qui concerne l'accès aux données détenues dans les référentiels centraux.</p> <p>Règlement d'exécution (UE) n° 1247/2012 de la Commission du 19 décembre 2012 définissant les normes techniques d'exécution en ce qui concerne le format et la fréquence des déclarations de transactions aux référentiels centraux conformément au règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil sur les produits dérivés de gré à gré, les contreparties centrales et les référentiels centraux.</p> <p>Règlement d'exécution (UE) 2017/105 de la Commission du 19 octobre 2016 modifiant le règlement d'exécution (UE) n° 1247/2012 définissant les normes techniques d'exécution en ce qui concerne le format et la fréquence des déclarations de transactions aux référentiels centraux conformément au règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du</p>

Territoire	Loi, règlement ou règle
	<p>Conseil sur les produits dérivés de gré à gré, les contreparties centrales et les référentiels centraux.</p> <p>Règlement d'exécution (UE) 2019/363 de la Commission du 13 décembre 2018 définissant les normes techniques d'exécution en ce qui concerne le format et la fréquence des déclarations des éléments des opérations de financement sur titres aux référentiels centraux conformément au règlement (UE) 2015/2365 du Parlement européen et du Conseil, et modifiant le règlement d'exécution (UE) n° 1247/2012 de la Commission en ce qui concerne les codes utilisés pour la déclaration des contrats dérivés.</p>
<p>Royaume-Uni de Grande-Bretagne et Irlande du Nord</p>	<p>The Over the Counter Derivatives, Central Counterparties and Trade Repositories (Amendment, etc., and Transitional Provision) (EU Exit) Regulations 2019</p> <p>The Over the Counter Derivatives, Central Counterparties and Trade Repositories (Amendment, etc., and Transitional Provision) (EU Exit) (No. 2) Regulations 2019</p> <p>The Over the Counter Derivatives, Central Counterparties and Trade Repositories (Amendment, etc., and Transitional Provision) (EU Exit) Regulations 2020</p> <p>The Trade Repositories (Amendment and Transitional Provision) (EU Exit) Regulations 2018</p> <p>The Technical Standards (European Market Infrastructure Regulation) (EU Exit) (No 1) Instrument 2019</p> <p>The Technical Standards (European Market Infrastructure Regulation) (EU Exit) (No 2) Instrument 2019</p> <p>The Technical Standards (European Market Infrastructure Regulation) (EU Exit) (No 3) Instrument 2019</p> <p>The Technical Standards (European Market Infrastructure Regulation) (EU Exit) (No 4) Instrument 2019</p> <p>The Technical Standards (Miscellaneous Amendments) (EU Exit) Instrument 2020</p>

Territoire	Loi, règlement ou règle
États-Unis d'Amérique	CFTC Real-Time Public Reporting of Swap Transaction Data, 17 C.F.R. Part 43 CFTC Swap Data Recordkeeping and Reporting Requirements, 17 C.F.R. Part 45 CFTC Swap Data Recordkeeping and Reporting Requirements: Pre-Enactment and Transition Swaps, 17 C.F.R. Part 46

41. L'annexe C est modifiée

a. dans le titre, en remplaçant « RÉPERTOIRES DES OPÉRATIONS ET LA DÉCLARATION DE DONNÉES SUR LES DÉRIVÉS » par « DÉCLARATION DES OPÉRATIONS SUR DÉRIVÉS »;

b. en supprimant « Directives : »;

c. en abrogeant et en remplaçant l'article 1 par ce qui suit :

1. Sous réserve des points 2 à 6, un répertoire des opérations reconnu met à la disposition du public, sans frais, pour chaque élément de données figurant à l'annexe A vis-à-vis un « O » est affiché dans la colonne intitulée « Mis à la disposition du public », les éléments de données compris dans le tableau 1 relatifs à chaque catégorie d'actifs et identifiant de l'actif sous-jacent indiqué dans le tableau 2 dans les cas suivants :
 - a) tout dérivé déclaré au répertoire des opérations reconnu en vertu de la présente règle;
 - b) tout événement du cycle de vie qui modifie le prix d'un dérivé existant déclaré au répertoire des opérations reconnu en vertu de la présente règle;
 - c) toute annulation d'une transaction déclarée ou la correction de toute donnée concernant une transaction ayant été déjà mise à la disposition du public, donnant lieu dans chaque cas à un dérivé mentionné à l'alinéa a) ou à un événement du cycle de vie mentionné à l'alinéa b).;

d. en abrogeant et en remplaçant le tableau 1 par ce qui suit :

Tableau 1

N°	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Format de l'élément de données	Valeurs admissibles pour l'élément de données
D1	Identifiant de diffusion	L'identifiant unique et aléatoire attribué par un répertoire des opérations reconnu pour chaque message de données mis à la disposition du public.	Varchar(52)	Jusqu'à 52 caractères alphanumériques
D2	Identifiant de diffusion initiale	<p>Pour les types d'action suivants déclarés au répertoire des opérations reconnu conformément à l'élément de données n° 98 de l'annexe A, l'identifiant de diffusion attribué conformément à l'élément de données n° D1 :</p> <p>a) Corriger</p> <p>b) Mettre fin</p> <p>c) Erreur</p> <p>d) Relancer</p> <p>e) Modifier si l'indicateur de modification de l'élément de données n° 100 dans l'annexe A est déclaré au répertoire des opérations reconnu comme étant vrai (True).</p>	Varchar(52)	Jusqu'à 52 caractères alphanumériques
D3	Horodatage de la diffusion	La date et l'heure, à la seconde près, auxquelles un répertoire des opérations reconnu met des données à la disposition du public.	YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ, exprimé en temps universel coordonné	Toute représentation valide de la date et de l'heure selon le format de la norme ISO 8601.

D4	Nom abrégé de l'identifiant unique de produit	Une description lisible par l'humain que fournit le r le Derivatives Service Bureau et qui correspond à l'identifiant unique de produit.	Le Derivatives Service Bureau publiera une liste contenant les valeurs admissibles et leur format.
----	---	--	--

- e. à l'article 4, en remplaçant « la date d'échéance, moins la date de prise d'effet » par « la date d'expiration, moins la date de prise d'effet »;*
- f. dans l'article 6, en remplaçant « le » avant « répertoire des opérations reconnu » par « un » et en remplaçant « la transaction » avant le point par « le dérivé »;*
- g. dans le tableau 4, en remplaçant l'intitulé de la colonne 2 « Date d'échéance moins la date de prise d'effet » par « Date d'expiration moins la date de prise d'effet »;*
- h. à l'article 7, en remplaçant « que contient le tableau 1 » par « visé au point 1 » et en remplaçant « dans le champ de l'horodatage de l'exécution » par « pour l'élément de données n° 14 de l'annexe A »;*
- i. en ajoutant la section suivante :*
 - 8.** S'il est technologiquement impossible au répertoire des opérations reconnu de diffuser l'information requise 48 heures après l'heure et la date indiquées dans le champ « Horodatage de l'exécution » du dérivé en raison des périodes d'interruption nécessaires pour l'entretien opérationnel, les mises à niveau et réparations des systèmes, les exercices de reprise après sinistre ou tout autre exercice relatif à son exploitation conformément au présent règlement et à sa décision de reconnaissance, il la diffuse dès que technologiquement possible après la conclusion de la période d'interruption..

42. Le formulaire 96-101A1 DEMANDE DE RECONNAISSANCE À TITRE DE RÉPERTOIRES DES OPÉRATIONS – FICHE D'INFORMATION est modifié à l'annexe E – Fonctionnement du répertoire des opérations à l'article (7), en remplaçant « de façon exacte et complète » par « sans erreur ou omission ».

43. Le formulaire 96-101A2 Acte d'acceptation de compétence par un répertoire des opérations et reconnaissance d'un mandataire aux fins de signification est modifié en remplaçant des lignes de signature pour le mandataire – Consentement à agir comme mandataire aux fins de signification par ce qui suit :

Signature du mandataire

Nom du signataire en caractères d'imprimerie et, si le mandataire n'est pas un particulier, son titre..

44. La présente règle entre en vigueur le 25 juillet 2025.