



REFONDUE JUSQU'AU 25 JUILLET 2025

Cette refonte vous est fournie à titre de commodité seulement et ne doit pas être considérée comme un document qui fait autorité.

**NORME MULTILATÉRALE 96-101
SUR LA DÉCLARATION DES OPÉRATIONS SUR DÉRIVÉS**

**CHAPITRE 1
DÉFINITIONS ET INTERPRÉTATION**

Définitions et interprétation

1. (1) Dans la présente règle

« agence de compensation et de dépôt déclarante » : l'une des entités suivantes :

- (a) une personne ou une société reconnue ou dispensée de l'obligation de reconnaissance à titre d'agence de compensation et de dépôt en vertu des lois sur les valeurs mobilières;
- (b) une agence de compensation et de dépôt ayant fourni à l'autorité ou à l'organisme de réglementation des valeurs mobilières un engagement écrit d'agir à titre de contrepartie déclarante relativement aux dérivés qu'elle compense et qui sont assujetties aux obligations de déclaration prévues par la présente règle;

« catégorie d'actifs » : la catégorie d'actifs sous-jacente à un dérivé, notamment un taux d'intérêt, un cours de change, un crédit, des capitaux propres ou une marchandise;

« Comité de surveillance réglementaire du Système d'identifiant international pour les entités juridiques » : le groupe de travail international établi par les ministres des Finances et les gouverneurs des banques centrales des pays du G20 et le Conseil de stabilité financière en vertu de la Charte du Comité de surveillance réglementaire du Système d'identifiant international pour les entités juridiques en date du 5 novembre 2012;

« conseil d'administration » : en plus d'un conseil d'administration, un groupe de personnes physiques qui joue un rôle similaire auprès d'un répertoire des opérations reconnu qui n'a pas de conseil d'administration;

« contrepartie déclarante » : une contrepartie au sens du paragraphe 25(1);

« 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);

« contrepartie locale » : une contrepartie à un dérivé qui, au moment d'une transaction, répond à l'une ou plusieurs des descriptions suivantes :

- (a) la contrepartie est une personne ou une société, qui n'est pas un particulier, à laquelle un ou plusieurs des critères suivants s'appliquent :
 - (i) elle est créée en vertu des lois du territoire intéressé;
 - (ii) son siège social est situé dans le territoire intéressé;
 - (iii) son établissement principal est situé dans le territoire intéressé;
- (b) la contrepartie locale est un courtier en dérivés dans le territoire intéressé;
- (c) elle est membre du même groupe qu'une personne ou une société visée au paragraphe (a) et celle-ci est responsable en totalité ou presque des dettes de la contrepartie;

« 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;

« 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;

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

« 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;

« 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 »;

« 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 dérivés » : toutes les données qui doivent être déclarées en vertu du chapitre 3;

« 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 »;

« 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;

« entreprise ayant une obligation d'information du public » s'entend d'une entreprise telle que définie à la partie 3 de la Norme canadienne 52-107 sur les *principes comptables et normes d'audit acceptables*;

« événement du cycle de vie » : un événement qui entraîne un changement dans les données sur les dérivés déclarées à un répertoire des opérations reconnu au sujet d'une opération;

« 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;

« NAGR américaines de l'AICPA » : les normes d'audit de l'*American Institute of Certified Public Accountants* et leurs modifications;

« NAGR américaines du PCAOB » : les normes d'audit du *Public Company Accounting Oversight Board (United States of America)* et leurs modifications;

« normes d'audit » : les normes d'audit telles qu'elles sont définies dans la Norme canadienne 52-107 sur les *principes comptables et normes d'audit acceptables*;

« participant » : une personne ou une société qui a conclu avec le répertoire des opérations reconnu une convention l'autorisant à avoir accès aux services de ce dernier;

« PCGR américains » : les principes comptables généralement reconnus des États-Unis d'Amérique que la SEC a considérés comme bien établis dans le référentiel comptable et qui sont complétés par le *Regulation S-X* pris en vertu de la Loi de 1934 et leurs modifications;

« période intermédiaire » : s'entend au sens du paragraphe 1.1(1) de la Norme canadienne 51-102 sur les *obligations d'information continue*;

« principes comptables » : les principes comptables tels qu'ils sont définis dans la Norme canadienne 52-107 sur les *principes comptables et normes d'audit acceptables*;

« 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;

« Système LEI international » : le système d'identifiant unique des parties aux transactions financières établi par le Comité de surveillance réglementaire du Système d'identifiant international pour les entités juridiques;

« transaction » : s'entend de l'un des éléments suivants :

- (a) la conclusion, la cession, la vente ou toute autre forme d'acquisition ou d'aliénation d'un dérivé;
- (b) la novation d'un dérivé;

« utilisateur » : à l'égard d'un répertoire des opérations reconnu, une contrepartie à un dérivé déclaré à ce répertoire des opérations reconnu en vertu de la présente règle, y compris un représentant de la contrepartie agissant au nom et pour le compte de cette dernière;

(2) Dans la présente règle, une personne ou une société est considérée comme membre du même groupe qu'une autre personne ou société si l'une contrôle l'autre ou si chacune est contrôlée par la même personne ou société.

(3) Dans la présente règle, une personne ou une société (la première partie) est réputée contrôler une autre personne ou société (la deuxième partie) si l'une des descriptions suivantes s'applique :

- a) la première partie est le propriétaire véritable des valeurs mobilières de la deuxième partie ayant droit de vote ou exerce un contrôle direct ou indirect sur celles-ci et, si le droit de vote était exercé, il permettrait à la première partie d'élire la majorité des directeurs de la deuxième partie, à moins que la première partie ne détienne les valeurs mobilières avec droit de vote que pour remplir une obligation;
- b) la deuxième partie est une société de personnes autre qu'une société en commandite et la première partie détient plus de 50 % des participations dans celle-ci;
- 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;

- (4) Dans la présente règle, le terme « dérivé » signifie un « dérivé désigné » tel qu'il est défini à la Norme multilatérale 91-101 sur la *détermination des dérivés*.
- (5) Dans la présente règle, le terme « répertoire des opérations » signifie :
 - a) à Terre-Neuve-et-Labrador, dans les Territoires du Nord-Ouest, au Nunavut, à l'Île-du-Prince-Édouard et au Yukon, un système de cotation et de déclaration des opérations sur dérivés, et
 - b) en Nouvelle-Écosse, un répertoire des opérations sur dérivés.
- (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*.

CHAPITRE 2 RECONNAISSANCE D'UN RÉPERTOIRE DES OPÉRATIONS ET OBLIGATIONS CONTINUES

Premier dépôt d'information dans le cadre d'une demande de reconnaissance à titre de répertoire des opérations

- 2. (1) Une personne ou une société qui demande une reconnaissance à titre de répertoire des opérations doit déposer avec sa demande le formulaire prévu à l'annexe 96-101A1 *Demande de reconnaissance à titre de répertoire des opérations – Fiche d'information*.
- (2) La personne ou la société qui demande la reconnaissance à titre de répertoire des opérations et dont le siège ou l'établissement principal qui est situé dans un territoire étranger doit déposer avec sa demande le formulaire prévu à l'annexe 96-101A2 *Acte d'acceptation de compétence et reconnaissance d'un mandataire aux fins de signification par le répertoire des opérations*.
- (3) Au plus tard le 7^e jour après avoir eu connaissance d'une inexactitude dans l'information que contient le formulaire prévu à l'annexe 96-101A1 ou avoir modifié cette information, la personne ou la société qui a déposé le formulaire prévu à l'annexe 96-101A1 doit déposer une modification au formulaire prévu à l'annexe 96-101A1, de la façon indiquée dans ce formulaire.

Modification de l'information par un répertoire des opérations reconnu

- 3. (1)** Un répertoire des opérations reconnu ne peut mettre en œuvre un changement significatif touchant l'information fournie au formulaire prévu à l'annexa 96-101A1 *Demande de reconnaissance à titre de répertoire des opérations – Fiche d'information* que s'il a déposé une modification au formulaire prévu à l'annexe 96-101A1 de la façon indiquée au formulaire prévu à l'annexe 96-101A1 au moins 45 jours avant la mise en œuvre du changement.
- (2)** Malgré le paragraphe (1), un répertoire des opérations reconnu ne peut mettre en œuvre un changement de l'information fournie à l'annexe I (Droits) du formulaire prévu à l'annexe 96-101A1 que s'il a déposé une modification de l'information fournie à l'annexe I au moins 15 jours avant de mettre en œuvre tout changement à cette information.
- (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.

Dépôt des premiers états financiers audités

- 4. (1)** La personne ou la société qui demande la reconnaissance à titre de répertoire des opérations dépose les états financiers audités de son dernier exercice dans le cadre de sa demande de reconnaissance.
- (2)** Les états financiers visés au paragraphe (1) remplissent les conditions suivantes :
 - a)** ils sont établis conformément à l'un des ensembles de principes suivants :
 - (i)** les PCGR canadiens applicables aux entreprises ayant une obligation d'information du public;
 - (ii)** les IFRS;
 - (iii)** les PCGR américains, si la personne ou la société est constituée en vertu des lois des États-Unis d'Amérique ou d'un de ses États;
 - b)** ils indiquent dans leurs notes les principes comptables utilisés pour les établir.
 - c)** ils indiquent la monnaie de présentation;
 - d)** ils sont audités conformément aux normes suivantes, selon le cas :
 - (i)** les NAGR canadiennes;
 - (ii)** les Normes d'audit internationales;

- (iii) les NAGR américaines de l'AICPA ou du PCAOB, si la personne ou la société est constituée en vertu des lois des États-Unis d'Amérique ou d'un de ses États.
- (3)** Les états financiers visés au paragraphe (1) sont accompagnés d'un rapport d'audit qui satisfait aux conditions suivantes :
- a) il est établi conformément aux normes d'audit appliquées et :
 - (i) s'il est établi conformément aux NAGR canadiennes ou aux Normes d'audit internationales, il exprime une opinion non modifiée;
 - (ii) s'il est établi conformément aux NAGR américaines de l'AICPA ou du PCAOB, il exprime une opinion sans réserve.
 - b) il indique toutes les périodes comptables présentées pour lesquelles le vérificateur a délivré un rapport de vérification;
 - c) il indique les normes d'audit appliquées pour l'exécution de l'audit;
 - d) il indique les principes comptables appliqués pour l'établissement des états financiers;
 - e) il est établi et signé par une personne ou une société qui est autorisée à signer un rapport d'audit selon les lois d'un territoire du Canada ou d'un territoire étranger et qui respecte les normes professionnelles de ce territoire.

Dépôt par un répertoire des opérations reconnu des états financiers intermédiaires et des états financiers annuels audités

- 5.**
- (1)** Le répertoire des opérations reconnu dépose au plus tard le 90^e jour suivant la fin de son exercice des états financiers annuels audités conformes aux paragraphes 2 et 3 de l'article 4.
 - (2)** Le répertoire des opérations reconnu dépose des états financiers intermédiaires au plus tard le 45^e jour suivant la fin de chaque période intermédiaire.
 - (3)** Les états financiers visés au paragraphe (2) remplissent les conditions suivantes :
 - a) ils sont établis conformément à l'un des ensembles de principes suivants :
 - (i) les PCGR canadiens applicables aux entreprises ayant une obligation d'information du public;
 - (ii) les IFRS;
 - (iii) les PCGR américains, si la personne ou la société est constituée en vertu des lois des États-Unis d'Amérique ou d'un de ses États;

- b) ils indiquent dans leurs notes les principes comptables utilisés pour les établir.

Cessation d'activité

6. (1) Le répertoire des opérations reconnu qui entend cesser son activité dans le territoire intéressé doit déposer le rapport prévu à l'annexe 96-101A3 *Rapport de cessation d'activité du répertoire des opérations* au moins 180 jours avant la date prévue de la cessation de son activité.
- (2) Le répertoire des opérations reconnu qui cesse involontairement son activité à titre de répertoire des opérations dans le territoire intéressé doit déposer le rapport prévu à l'annexe 96-101A3 dès que possible après la cessation de son activité.

Cadre juridique

7. (1) Le répertoire des opérations reconnu établit, met en œuvre et maintient des règles, politiques et procédures écrites claires et transparentes qui sont raisonnablement conçues pour garantir ce qui suit :
- (a) tous les éléments substantiels de ses activités sont conformes aux lois applicables;
 - (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) les droits et les obligations de ses utilisateurs et de ses propriétaires relativement à l'utilisation des données sur les dérivées déclarées au répertoire des opérations reconnu sont clairs et transparents;
 - (d) dans la mesure où une personne raisonnable aurait conclu qu'il est opportun de le faire, toute convention qu'il conclut indique clairement les niveaux de services, les droits d'accès, la protection des renseignements confidentiels, les droits de propriété intellectuelle et la fiabilité opérationnelle du système du répertoire des opérations reconnu, selon le cas.
- (2) Sans que soit limitée la portée générale du paragraphe (1), le répertoire des opérations reconnu met en œuvre des règles, politiques et procédures qui définissent clairement le statut des dossiers des contrats relatifs aux dérivés figurant dans son répertoire et le fait que ces dossiers constituent ou non des contrats juridiques.

Gouvernance

8. (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;
 - d) 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.
- (1)** Le répertoire des opérations reconnu établit et met en œuvre des mécanismes de gouvernance écrits clairs et transparents, et qui sont raisonnablement conçues pour faire ce qui suit :
- a) fournir des mécanismes de contrôle interne;
 - b) assurer sa sécurité;
 - b.1) veiller à ce que les participants puissent accéder efficacement à ses services de communication de données sur les dérivés;
 - c) assurer une surveillance à son égard;
 - d) soutenir la stabilité du système financier et d'autres éléments d'intérêt public pertinents;
 - e) atteindre un équilibre entre les intérêts des parties concernées.
- (2)** Le répertoire des opérations reconnu établit, met en œuvre et maintient des règles, des politiques et des procédures écrites raisonnablement conçues pour relever et gérer les conflits d'intérêts.
- (3)** Le répertoire des opérations reconnu met l'information suivante à la disposition du public sur son site Web, d'une manière qui lui est aisément accessible :
- a) les mécanismes de gouvernance établis conformément au paragraphe (1);
 - b) les règles, politiques et procédures établies conformément au paragraphe (2).

Conseil d'administration

9. **(1)** Le répertoire des opérations reconnu est doté d'un conseil d'administration.

- (2) Le conseil d'administration du répertoire des opérations reconnu remplit les conditions suivantes :
 - a) il se compose de personnes physiques qui ont les compétences et l'expérience nécessaires pour surveiller efficacement la gestion de ses activités conformément aux dispositions législatives applicables;
 - b) il compte une représentation raisonnable de personnes physiques qui sont indépendantes du répertoire des opérations reconnu.
- (3) Le conseil d'administration, en consultation avec le chef de la conformité du répertoire des opérations reconnu, résout les conflits d'intérêts relevés par ce dernier.
- (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.

Direction

- 10. (1) Le répertoire des opérations reconnu établit, met en œuvre et maintient des règles, des politiques et des procédures écrites qui réunissent les conditions suivantes :
 - (a) elles précisent les rôles et les responsabilités des membres de la direction;
 - (b) elles assurent que les membres de la direction possèdent les compétences et l'expérience nécessaires pour s'acquitter efficacement de leurs rôles et de leurs responsabilités.
- (2) Lorsqu'il nomme ou remplace le chef de la conformité, le chef de la direction ou le chef de la gestion du risque, le répertoire des opérations reconnu en avise l'autorité ou l'organisme de réglementation des valeurs mobilières au plus tard le 5^e jour ouvrable suivant la nomination ou le remplacement.

Chef de la conformité

- 11. (1) Le conseil d'administration du répertoire des opérations reconnu nomme un chef de la conformité qui possède les compétences et l'expérience nécessaires pour exercer ces fonctions.
- (2) Le chef de la conformité relève directement du conseil d'administration ou, à l'appréciation du conseil d'administration, du chef de la direction du répertoire des opérations reconnu.
- (3) Le chef de la conformité a les responsabilités suivantes :
 - a) établir, mettre en œuvre et maintenir des règles, des politiques et des procédures écrites conçues pour relever et résoudre les conflits d'intérêts;

- b) établir, mettre en œuvre et maintenir des règles, des politiques et des procédures écrites conçues pour assurer la conformité du répertoire des opérations reconnu au droit des valeurs mobilières;
 - c) veiller constamment au respect des règles, politiques et procédures visées aux alinéas a) et b);
 - d) signaler dès que possible au conseil d'administration du répertoire des opérations reconnu toute situation indiquant que le répertoire des opérations reconnu ou une personne physique agissant en son nom a commis dans n'importe quel territoire du Canada ou territoire étranger où il mène ses activités, un manquement au droit des valeurs mobilières qui présente l'une des caractéristiques suivantes :
 - (i) il risque de causer un préjudice à un utilisateur;
 - (ii) il risque de causer un préjudice aux marchés des capitaux;
 - (iii) il s'agit d'un manquement récurrent;
 - (iv) il peut nuire à la capacité du répertoire des opérations reconnu d'exercer son activité conformément au droit des valeurs mobilières;
 - e) signaler dès que possible au conseil d'administration du répertoire des opérations reconnu tout conflit d'intérêts qui pose un risque de préjudice pour un utilisateur ou les marchés des capitaux;
 - f) établir et attester un rapport annuel sur la conformité au droit des valeurs mobilières du répertoire des opérations reconnu et des personnes physiques qui agissent en son nom et présenter ce rapport au conseil d'administration.
- (4) Concurrément à la présentation du rapport ou au signalement visé à l'alinéa d), e) ou f) du paragraphe (3), le chef de la conformité dépose une copie du rapport ou du signalement auprès de l'autorité ou de l'organisme de réglementation des valeurs mobilières.

Droits exigibles

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.

Accès aux services du répertoire des opérations reconnu

- 13. (1) Le répertoire des opérations reconnu établit, met en œuvre et maintient par écrit des critères de participation objectifs et fondés sur le risque, qui assurent un accès libre et équitable à ses services.
- (2) Le répertoire des opérations reconnu publie sur son site Web de manière aisément accessible au public les critères visés au paragraphe (1).
- (3) Le répertoire des opérations reconnu ne peut faire ce qui suit :
 - a) interdire à une personne ou à une société l'accès à ses services ou lui imposer des conditions d'accès ou d'autres limites à cet égard sans motif valable;
 - b) permettre une discrimination déraisonnable entre les participants;
 - c) imposer à la concurrence un fardeau qui n'est pas raisonnable;
 - d) exiger qu'une personne ou une société utilise ou acquière un autre service pour pouvoir utiliser son service de déclaration d'opérations.

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.

Politiques et normes de communication

- 15. Le répertoire des opérations reconnu doit appliquer des procédures et normes de communication internationalement reconnues pertinentes, ou en permettre l'application, en vue de favoriser l'échange efficient de données entre ses systèmes et ceux des entités suivantes :
 - a) ses participants;
 - b) d'autres répertoires des opérations;
 - c) les agences de compensation, bourses et autres plateformes qui favorisent les opérations sur dérivés;
 - d) les fournisseurs de services.

Application régulière

- 16. (1)** Avant de prendre une décision ayant un effet défavorable direct sur un participant ou sur un candidat à la qualité de participant, le répertoire des opérations reconnu donne au participant ou au candidat l'occasion d'être entendu.
- (2)** Le répertoire des opérations reconnu consigne ses décisions, les motive et en permet la consultation, notamment, pour chaque candidat, les raisons pour lesquelles l'accès a été accordé, limité ou refusé.

Règles, politiques et procédures

- 17. (1)** Le répertoire des opérations reconnu établit des règles, politiques et procédures qui réunissent les conditions suivantes :
- a)* elles permettent à un participant raisonnable de bien comprendre ce qui suit :
 - (i)* ses droits et ses obligations relativement à l'accès aux services du répertoire des opérations reconnu ainsi que les risques substantiels auxquels il s'expose en les utilisant;
 - (ii)* les droits et autres frais qu'il pourrait supporter en utilisant les services du répertoire des opérations reconnu;
 - b)* elles permettent à un utilisateur raisonnable de bien comprendre les conditions relativement à l'accès aux données sur les dérivés pour lesquels il est une contrepartie aux opérations;
 - c)* elles sont raisonnablement conçues de manière à régir tous les aspects des services du répertoire des opérations reconnu qui se rapportent à la collecte et au maintien des données sur les dérivés et des autres renseignements sur les opérations réalisées;
- (2)** Les règles, politiques et procédures du répertoire des opérations reconnu ne sont pas incompatibles avec la législation en valeurs mobilières.
- (3)** Le répertoire des opérations reconnu surveille en permanence la conformité à ses règles, à ses politiques et à ses procédures.
- (4)** Le répertoire des opérations reconnu établit, met en œuvre et maintient des règles, des politiques et des procédures écrites qui prescrivent des sanctions appropriées en cas de violation des règles, politiques et procédures applicables aux participants.
- (5)** Le répertoire des opérations reconnu met l'information suivante à la disposition du public, d'une manière aisément accessible sur son site Web :
- a)* les règles, politiques et procédures visées dans le présent article;

- b) ses procédures d'établissement ou de modification des règles, politiques et procédures.

Dossiers des données déclarées

18. (1) Le répertoire des opérations reconnu établit des procédures de tenue de dossiers raisonnablement conçues de manière à garantir la consignation des données sur les dérivés sans erreur ni omission et en temps opportun.
- (2) Le répertoire des opérations reconnu conserve en lieu sûr et sous une forme durable les dossiers de données sur les dérivés pendant une période de sept ans suivant la date d'expiration ou de fin du dérivé.
- (3) Le répertoire des opérations reconnu crée au moins une copie de chaque dossier de données sur les dérivés à conserver en vertu du paragraphe (2), pour la même période énoncée dans ce paragraphe, et la conserve en lieu sûr et sous une forme durable dans un endroit distinct du dossier original.

Cadre de gestion globale des risques

19. Le répertoire des opérations reconnu établit, met en œuvre et maintient un cadre écrit de gestion globale des risques visant notamment les risques d'entreprise, juridiques et opérationnels.

Risque économique général

20. (1) Le répertoire des opérations reconnu établit, met en œuvre et maintient des procédures, des systèmes et des contrôles adéquats raisonnablement conçus de manière à relever, à surveiller et à gérer son risque économique général.
- (2) Sans que soit limitée la portée générale du paragraphe (1), le répertoire des opérations reconnu souscrit une assurance suffisante et détient suffisamment d'actifs liquides nets financés par capitaux propres pour couvrir ses pertes économiques générales éventuelles afin d'assurer la continuité de ses activités et services et d'assurer la reprise ou la cessation ordonnée des activités si ces pertes se réalisaient.
- (3) Pour l'application du paragraphe (2), le répertoire des opérations reconnu détient des actifs liquides nets financés par capitaux propres représentant au moins six mois de charges opérationnelles courantes.
- (4) Le répertoire des opérations reconnu possède des politiques et des procédures raisonnablement conçues de manière à définir les scénarios qui peuvent empêcher la continuité de ses activités et de ses services essentiels, et à lui permettre d'évaluer l'efficacité d'une grande variété d'options de cessation ordonnée de ses activités.
- (5) Le répertoire des opérations reconnu établit, met en œuvre et maintient des règles, des politiques et des procédures écrites raisonnablement conçues pour permettre la

cessation ordonnée de ses activités selon les résultats de l'évaluation visée au paragraphe (4).

- (6) Le répertoire des opérations établit, met en œuvre et maintient des règles, des politiques et des procédures écrites visant à ce que lui-même et ses ayants droit, notamment un successeur ou un administrateur de faillite, continuent de respecter le paragraphe (2) de l'article 6 et l'article 37 en cas de faillite, d'insolvabilité ou de cessation des activités à titre de répertoire des opérations.

Risques liés aux systèmes et aux autres risques opérationnels

21. (1) Le répertoire des opérations reconnu établit, met en œuvre et maintient des procédures, des systèmes et des contrôles raisonnablement conçus de manière à relever les sources plausibles de risque opérationnel, aussi bien internes qu'externes, notamment les risques liés à l'intégrité et à la sécurité des données, à la continuité des activités et à la gestion de la capacité et de la performance afin d'en atténuer l'incidence autant que possible.
- (2) Les procédures, les systèmes et les contrôles visés au paragraphe (1) sont approuvés par le conseil d'administration du répertoire des opérations reconnu.
- (3) Sans que soit limitée la portée générale du paragraphe (1), le répertoire des opérations reconnu a les obligations suivantes :
- a) élaborer et maintenir les éléments suivants :
- (i) un système adéquat de contrôle interne de ses systèmes;
 - (ii) des contrôles généraux adéquats en matière de technologie de l'information, notamment, sans limitation, en ce qui concerne le fonctionnement des systèmes d'information, la sécurité et l'intégrité de l'information, la gestion du changement, la gestion des problèmes, le soutien du réseau et le soutien du logiciel d'exploitation;
- b) conformément à la pratique commerciale prudente, prendre les mesures suivantes 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 simulations de crise pour déterminer la capacité de ces systèmes de traiter les données sur les dérivés de manière exacte, rapide et efficiente;
- c) aviser rapidement l'autorité ou l'organisme de réglementation des valeurs mobilières des pannes, défauts de fonctionnement, retards ou autres interruptions d'importance des systèmes, de même que de toute atteinte à la sécurité, à l'intégrité ou à la confidentialité des données, et fournir dès que possible un rapport d'incident écrit qui comprend une analyse de la cause

fondamentale de l'incident et toute mesure corrective que le répertoire des opérations reconnu a prise ou a l'intention de prendre.

- (4)** Sans que soit limitée la portée générale du paragraphe (1), le répertoire des opérations reconnu établit, met en œuvre et maintient des plans de continuité des activités, notamment des plans de reprise après sinistre raisonnablement conçus pour ce qui suit :
- a) reprendre rapidement ses activités à la suite d'une interruption des activités;
 - b) permettre la récupération rapide des données, y compris les données sur les dérivés, en cas d'interruption des activités;
 - c) assurer l'exercice des fonctions d'autorité en cas d'urgence.
- (5)** Le répertoire des opérations reconnu met à l'essai ses plans de continuité des activités, notamment ses plans de reprise après sinistre, au moins une fois par année.
- (6)** Le répertoire des opérations reconnu engage chaque année une partie compétente pour effectuer un examen indépendant de chacun de ses systèmes servant à la collecte et au maintien des déclarations sur les dérivés et pour établir un rapport selon les normes d'audit établies afin de garantir sa conformité aux alinéas a) et b) du paragraphe (3) et aux paragraphes 4 et 5.
- (7)** Le répertoire des opérations reconnu présente le rapport visé au paragraphe 6 aux destinataires suivants :
- a) son conseil d'administration ou son comité d'audit, rapidement après l'établissement du rapport;
 - b) l'autorité ou l'organisme de réglementation, au plus tard le 30^e jour suivant la présentation du rapport au conseil d'administration ou comité d'audit.
- (8)** Le répertoire des opérations reconnu met à la disposition du public de manière aisément accessible sur son site Web la version définitive de toutes les prescriptions techniques relatives à l'interfaçage avec ses services ou à l'accès à ceux-ci :
- a) s'il n'est pas encore en activité, suffisamment de temps avant le début de son activité pour donner aux participants un délai raisonnable leur permettant de procéder à des essais et de modifier leurs systèmes;
 - b) s'il est déjà en activité, suffisamment de temps avant de mettre en œuvre une modification importante de ses prescriptions techniques pour donner aux participants un délai raisonnable leur permettant de procéder à des essais et de modifier leurs systèmes.
- (9)** Le répertoire des opérations reconnu permet l'accès à des installations d'essais relativement à l'interfaçage avec ses services et l'accès à ceux-ci dans les délais suivants :

- a)* s'il n'est pas encore en activité, suffisamment de temps avant le début de son activité pour donner aux participants un délai raisonnable leur permettant de procéder à des essais et de modifier leurs systèmes;
 - b)* s'il est déjà en activité, suffisamment de temps avant de mettre en œuvre une modification importante de ses prescriptions techniques pour donner aux participants un délai raisonnable leur permettant de procéder à des essais et de modifier leurs systèmes.
- (10)** Le répertoire des opérations reconnu ne peut entrer en activité dans le territoire intéressé que s'il se conforme à l'alinéa *a)* des paragraphes 8 et 9.
- (11)** L'alinéa *b)* des paragraphes 8 et 9 ne s'applique pas au répertoire des opérations reconnu lorsque les conditions suivantes sont réunies :
 - a)* le répertoire des opérations reconnu doit apporter immédiatement la modification à ses prescriptions techniques afin de remédier à une panne, à un défaut de fonctionnement ou à un retard important touchant ses systèmes ou son matériel;
 - b)* le répertoire des opérations reconnu avise immédiatement l'autorité ou l'organisme de réglementation des valeurs mobilières de son intention d'apporter la modification à ses prescriptions techniques;
 - c)* le répertoire des opérations reconnu met à la disposition du public, dès que possible et de manière aisément accessible sur son site Web, les prescriptions techniques modifiées.

Sécurité et confidentialité des données

- 22.**
 - (1)** Le répertoire des opérations reconnu établit, met en œuvre et maintient des règles, des politiques et des procédures écrites raisonnablement conçues de manière à garantir la sécurité et la confidentialité des données sur les dérivés que le répertoire des opérations reconnu reçoit d'une contrepartie déclarante en vertu de la présente règle.
 - (2)** Le répertoire des opérations reconnu ne peut communiquer de données sur les dérivés à des fins commerciales ou d'affaires que dans les cas suivants :
 - a)* la communication est conforme à l'article 39;
 - b)* les contreparties au dérivé ont expressément consenti par écrit à ce qu'il les utilise ou les communique.

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 dérivés 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.

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.

Impartition

24. Le répertoire des opérations reconnu fait ce qui suit lorsqu'il impartit un service ou un système important à un fournisseur de services, notamment à un membre du même groupe ou à une personne qui a des liens avec lui :
- a) il établit, met en œuvre et maintient des règles, des politiques et des procédures écrites concernant la sélection d'un fournisseur à qui le service ou le système important peut être imparti ainsi que l'évaluation et l'approbation de la convention d'impartition;
 - b) il repère les conflits d'intérêts entre lui et le fournisseur à qui le service ou le système important est imparti et il établit, met en œuvre, maintient et applique des règles, des politiques et des procédures écrites conçues pour les réduire et les gérer, ou les résoudre;
 - c) il conclut avec le fournisseur de services un contrat écrit adapté à l'importance et à la nature de l'activité impartie et qui prévoit des procédures de résiliation adéquates;
 - d) il conserve l'accès aux dossiers du fournisseur de services relativement à l'activité impartie;
 - e) il veille à ce que l'autorité ou l'organisme de réglementation des valeurs mobilières puisse accéder à l'ensemble des données, de l'information et des systèmes maintenus par le fournisseur de services pour le compte du répertoire des opérations reconnu de la même manière qu'elle le pourrait en l'absence de convention d'impartition;
 - f) il veille à ce que toutes les personnes ou sociétés qui effectuent des audits ou des examens indépendants du répertoire des opérations reconnu conformément à la présente règle puissent accéder de façon adéquate à l'ensemble des données, de l'information et des systèmes maintenus par le fournisseur de services pour le compte du répertoire des opérations reconnu de la même manière qu'elles le pourraient en l'absence de convention d'impartition;
 - g) il prend les mesures appropriées pour s'assurer que le fournisseur à qui le service ou le système important est imparti établit, maintient et met à l'essai périodiquement un plan de continuité des activités approprié, notamment un plan de reprise après sinistre, conformément aux exigences énoncées à l'article 21;
 - h) il prend les mesures appropriées pour veiller à ce que le fournisseur de services protège la sécurité et la confidentialité des données sur les dérivés et des renseignements confidentiels des utilisateurs, conformément aux exigences énoncées à l'article 22;

- (i) il établit, met en œuvre, maintient et applique des règles, des politiques et des procédures écrites pour évaluer régulièrement la performance du fournisseur de services en vertu de la convention d'impartition.

CHAPITRE 3 DÉCLARATION DES DONNÉES

Contrepartie déclarante

- 25. (1)** Dans la présente règle, pour ce qui est d'un dérivé qui concerne une contrepartie locale, la contrepartie déclarante est l'une des entités suivantes :
- a)* si le dérivé est compensé par l'intermédiaire d'une agence de compensation et de dépôt déclarante, l'agence de compensation et de dépôt déclarante;
 - b)* si l'alinéa *a)* ne s'applique pas que le dérivé est effectué entre un courtier et une contrepartie qui n'est pas courtier, le courtier;
 - c)* si les alinéas *a)* et *b)* ne s'appliquent pas au dérivé et que, avant ou au moment de la transaction, les contreparties ont convenu par écrit que l'une d'elles serait la contrepartie déclarante, la contrepartie ainsi désignée en vertu des modalités de la convention;
 - d)* tous les autres cas, chacune des contreparties locales du dérivé.
- (2)** Chacune des contreparties locales du dérivé à laquelle l'alinéa *c)* du paragraphe (1) s'applique conserve une copie de la convention écrite qui y est mentionnée pour une période de sept ans suivant la date d'expiration ou de fin du dérivé.
- (3)** Les documents devant être conservés en vertu du paragraphe (2) doivent être conservés :
- a)* en lieu sûr et sous une forme durable;
 - b)* de manière à pouvoir les remettre à l'organisme de réglementation dans un délai raisonnable suivant la demande.
- (4)** Malgré l'article 40, une contrepartie locale qui accepte en vertu de l'alinéa (1)*c)* d'être la contrepartie déclarante d'un dérivé auquel l'article 40 s'applique, doit déclarer les données relatives à ce dérivé conformément à la présente règle.

Obligation de déclaration

- 26. (1)** La contrepartie déclarante relativement à un dérivé avec une contrepartie locale déclare ou fait déclarer à un répertoire des opérations reconnu les données à déclarer conformément à la présente partie.

- (2) Malgré le paragraphe (1), si aucun répertoire des opérations reconnu n'accepte les données à déclarer conformément à la présente partie, la contrepartie déclarante les transmet électroniquement à l'autorité ou à l'organisme de réglementation des valeurs mobilières.
- (3) La contrepartie déclarante remplit l'obligation de déclaration relativement au dérivé à déclarer en vertu du paragraphe (1) lorsque les conditions suivantes sont réunies :
- a) une des conditions suivantes s'applique au dérivé :
 - (i) le dérivé est déclaré du seul fait qu'une contrepartie du dérivé est une contrepartie locale en vertu du sous-alinéa a)(i) de la définition de « contrepartie locale » et que cette contrepartie ne mène pas d'activité dans le territoire intéressé autre que des activités liées à être organisée en vertu des lois du territoire intéressé;
 - (ii) le dérivé se doit d'être déclaré du seul fait qu'une contrepartie du dérivé est une contrepartie locale en vertu de l'alinéa c) de la définition de « contrepartie locale »;
 - b) le dérivé est déclaré à un répertoire des opérations reconnu en vertu d'un des textes réglementaires suivants :
 - (i) la Norme multilatérale 96-101 sur la *déclaration des opérations sur dérivés*, avec ses modifications successives, si elles sont déclarées en application des exigences d'un territoire autre que le territoire local;
 - (ii) la Règle 91-507 de la Commission des valeurs mobilières du Manitoba – Derivatives: Trade Reporting avec ses modifications successives;
 - (iii) la Règle 91-507 de la Commission des valeurs mobilières de l'Ontario – Derivatives: Trade Reporting, avec ses modifications successives;
 - (iv) le Règlement 91-507 de l'Autorité des marchés financiers du Québec – *Référentiels centraux et déclaration de données sur les dérivés*, avec ses modifications successives;
 - (v) la loi sur la déclaration des opérations d'un territoire étranger qui figure à l'annexe B.
 - c) la contrepartie déclarante demande au répertoire des opérations reconnu visé à l'alinéa b) de donner à l'autorité ou à l'autorité de réglementation en valeurs mobilières accès aux données sur les dérivés qu'elle est tenue de déclarer conformément à l'alinéa b) et fait de son mieux pour y donner accès à l'autorité ou à l'autorité de réglementation en valeurs mobilières.

- (4) La contrepartie déclarante déclare toutes les données relatives à un dérivé au même répertoire des opérations reconnu.
- (5) [abrogé]
- (6) [abrogé]
- (7) [abrogé]
- (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;
- (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.

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.

Identifiants – dispositions générales

- 27. (1)** Dans un rapport de données à communiquer à l'exécution en vertu du présent chapitre, une contrepartie déclarante inclut chacun des éléments suivants :

- a) l'identifiant de chaque contrepartie tel qu'il est prévu à l'article 28;
 - b) l'identifiant unique de produit tel qu'il est prévu à l'article 30.
- (2) Dans un rapport de cycle de vie ou de données de validation en vertu du présent chapitre, une contrepartie déclarante inclut IUT pour la transaction tel que l'exige l'article 29.

Identifiants pour les entités juridiques

28. (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;
- (2) Une personne qui a droit de recevoir un identifiant d'entité juridique, de l'avis du Système LEI international, autre qu'un particulier, et qui est une contrepartie locale à un dérivé qui doit être déclaré en application de la présente règle, doit :
- a) avant d'exécuter une transaction, obtenir un identifiant d'entité juridique attribué en conformité avec les normes établies par le Système LEI international;
 - b) aussi longtemps qu'elle est une contrepartie à un dérivé qui doit être déclaré conformément à la présente règle, maintenir et renouveler l'identifiant d'entité juridique visé à l'alinéa a).
- (3) Nonobstant le paragraphe 1, si une contrepartie locale à un dérivé devant être déclaré conformément à la présente règle est un particulier ou n'est pas admissible à recevoir un identifiant d'entité juridique, de l'avis du Système LEI international, la contrepartie déclarante et le répertoire des opérations reconnu identifient la contrepartie à l'aide d'un seul identifiant unique de remplacement.
- (4) [abrogé]

Identifiants uniques de transaction

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.

Identifiants uniques de produit

- 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.
- (3)** [abrogé]
- (4)** [abrogé]

Données à communiquer à l'exécution

- 31.** **(1)** Dès l'exécution d'un dérivé à déclarer conformément à la présente règle, la contrepartie déclarante autorisée déclare à un répertoire des opérations reconnu les données à communiquer à l'exécution de cette opération.
- (2)** Malgré le paragraphe (1), s'il est impossible pour la contrepartie déclarante autorisée de déclarer immédiatement les données à communiquer à l'exécution, elle les déclare dès qu'il est possible de le faire et au plus tard à la fin du jour ouvrable 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.

Données sur les événements du cycle de vie

- 32.** (1) Pour chaque dérivé à déclarer conformément à la présente règle, la contrepartie déclarante autorisée déclare à un répertoire des opérations reconnu toutes les données sur les événements du cycle de vie avant la fin du jour ouvrable où ils se sont produits.
- (2) Malgré le paragraphe (1), s'il est impossible pour la contrepartie déclarante autorisée de déclarer toutes les données sur les événements du cycle de vie avant la fin du jour ouvrable où ils se sont produits, elle les déclare au plus tard à la fin du jour ouvrable suivant.
- (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.

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.

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.

Dérivés préexistants

- 34. (1)** Malgré l'article 31 et sous réserve du paragraphe 44(2), la contrepartie déclarante déclare les données à communiquer à l'exécution d'un dérivé si chacune des conditions suivantes s'applique au plus tard le 1^{er} décembre 2016 :
- a) la contrepartie déclarante est une agence de compensation et de dépôt ou un courtier en dérivés;
 - b) la transaction a été conclue avant le 29 juillet 2016;
 - c) des obligations contractuelles s'appliquaient relativement au dérivé à la date la plus rapprochée à laquelle le dérivé est déclaré ou le 1^{er} décembre 2016.
- (2)** Malgré l'article 31 et sous réserve du paragraphe 44(3), la contrepartie déclarante déclare les données à communiquer à l'exécution d'un dérivé si chacune des conditions suivantes s'applique au plus tard le 1^{er} février 2017 :
- a) la contrepartie déclarante n'est pas une agence de compensation et de dépôt ou un courtier en dérivés;
 - b) la transaction a été conclue avant le 1^{er} novembre 2016;
 - c) des obligations contractuelles s'appliquaient relativement au dérivé à la date la plus rapprochée à laquelle le dérivé est déclaré ou le 1^{er} février 2017.
- (3)** Malgré l'article 31, si le paragraphe (1) ou (2) s'applique au dérivé, seules les données figurant dans la colonne intitulée « Information requise pour les opérations préexistantes » de l'annexe A devront être déclarées pour ces dérivés par la contrepartie déclarante.
- (4)** Malgré l'article 32, si le paragraphe (1) ou (2) s'applique au dérivé, l'obligation de la contrepartie déclarante de déclarer les données sur les événements du cycle de vie commence dès qu'elle a déclaré les données à communiquer à l'exécution conformément au paragraphe (1) ou (2).

- (5) Malgré l'article 33, si le paragraphe (1) ou (2) s'applique au dérivé, l'obligation de la contrepartie déclarante de déclarer les données de valorisation commence dès qu'elle a déclaré les données à communiquer à l'exécution conformément au paragraphe (1) ou (2).

Délai de déclaration des données à un autre répertoire des opérations reconnu

35. Malgré le paragraphe 26(6) et les articles 31 et 33, dans le cas où le répertoire des opérations reconnu cesse son activité ou cesse d'accepter les données sur les dérivés relatives à une certaine catégorie de dérivés, la contrepartie déclarante peut remplir ses obligations de déclaration en vertu de la présente règle en déclarant les données sur les dérivés à un autre répertoire des opérations reconnu ou, à défaut de répertoire des opérations reconnu, à l'autorité ou à l'organisme de réglementation des valeurs mobilières.

Dossiers des données déclarées

36. (1) La contrepartie déclarante conserve des dossiers sur les dérivés à déclarer en vertu de la présente règle, y compris les dossiers des opérations, pendant une période de sept ans suivant la date d'expiration ou de fin du dérivé.
- (2) La contrepartie déclarante conserve les dossiers visés au paragraphe (1) en lieu sûr et sous une forme durable.

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.

CHAPITRE 4 DIFFUSION DES DONNÉES ET ACCÈS AUX DONNÉES

Données mises à la disposition des organismes de réglementation

- 37. (1)** Le répertoire des opérations reconnu fait ce qui suit :
 - a) il fournit à l'autorité ou à l'organisme de réglementation des valeurs mobilières un accès électronique direct, continu et rapide aux données sur les dérivés qu'il

a en sa possession et qui sont déclarées en vertu de la présente règle, ou qui peuvent avoir une incidence sur les marchés financiers;

- b) il communique sous une forme agrégée les données visées à l'alinéa 31(1)a);
- c) il indique à l'autorité ou à l'organisme de réglementation des valeurs mobilières la manière dont les données sur les dérivés fournies conformément à l'alinéa b) ont été regroupées.

- (2) Le répertoire des opérations reconnu établi, met en œuvre et maintient des règlements, des politiques ou des procédés d'exploitation conçus de manière à satisfaire ou à dépasser les normes et les recommandations de l'Organisation internationale des commissions de valeurs (IOSCO) publiées en août 2013 un rapport intitulé *Authorities access to trade repository data*, et leurs modifications.
- (3) La contrepartie déclarante fait de son mieux pour donner à l'autorité ou à l'organisme de réglementation des valeurs mobilières accès rapidement à toutes les données sur les dérivés qu'elle est tenue de déclarer conformément à la présente règle, y compris en demandant à tout répertoire des opérations d'y donner accès à l'autorité ou à l'organisme de réglementation des valeurs mobilières.

Données mises à la disposition des participants

- 38. (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.
- (3) Sous réserve de l'article 22.1, chaque contrepartie d'un dérivé est réputée consentir à la publication de toutes les données sur les dérivés qu'il est obligatoire de déclarer ou de communiquer en vertu de la présente règle.
- (4) Le paragraphe (3) s'applique malgré toute convention à l'effet contraire intervenue entre les contreparties d'un dérivé.

Données mises à la disposition du public

- 39. (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.
- (2) Les données visées par le paragraphe (1) comprennent au moins des ventilations, s'il y a lieu, en fonction de la monnaie de libellé, de la catégorie d'actifs, du type de contrat, de la date d'expiration et du fait que le dérivé est compensé ou non.

- (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.
- (4) Un répertoire des opérations reconnu qui communique les rapports visés au paragraphe (3) ne doit pas ce faisant divulguer l'identité des contreparties au dérivé.
- (5) Un répertoire des opérations reconnu fait en sorte que les données et les rapports visés dans le présent article soient mises à la disposition du public en les publiant dans son site Web ou sur un support similaire, sous une forme conviviale et facilement accessible à titre gratuit 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.
- (6) Malgré les paragraphes 1 à 5, le répertoire des opérations reconnu n'est pas tenu de rendre publiques les données sur un dérivé utilisé par des entités du même groupe, à moins que la loi ne l'exige.

CHAPITRE 5 EXCLUSIONS

Dérivé 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.

Dérivé entre un gouvernement et son entité consolidée

41. Malgré le chapitre 3, une contrepartie déclarante n'est pas obligée de déclarer les données relatives à un dérivé entre :
- a) le gouvernement d'un territoire intéressé; et

- b) une société ou un organisme de la Couronne qui fait partie d'une entité consolidée au sein de ce gouvernement à des fins de comptabilité.

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.

Dérivé entre un courtier en dérivés non résident et une contrepartie non locale

42. (1) Malgré le chapitre 3, une contrepartie déclarante n'est pas obligée de déclarer les données relatives à un dérivé si celui-ci se doit d'être déclaré du seul fait qu'une des contreparties est une contrepartie locale en vertu de l'alinéa b) de la définition de « contrepartie locale ».

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

42.1 [abrogé]

CHAPITRE 6 DISPENSES

Dispense - généralité

- 43. (1)** Sauf en Alberta, l'autorité ou l'organisme de réglementation des valeurs mobilières peut accorder une dispense à la présente règle, conformément à la loi visée à l'annexe B de la Norme canadienne 14-101 sur les *définitions* vis-à-vis du territoire intéressé.
- (2) En Alberta, l'autorité ou l'organisme de réglementation des valeurs mobilières peut accorder une dispense à la présente règle ou d'une partie de celle-ci, sous réserve des conditions, restrictions ou exigences prévues dans la dispense.

CHAPITRE 7 PÉRIODE DE TRANSITION ET DATE D'ENTRÉE EN VIGUEUR

Période de transition

- 44. (1)** Indépendamment de la partie 3, une contrepartie déclarante qui n'est pas une agence de compensation et de dépôt déclarante ni un courtier en dérivés n'est pas tenue de présenter une déclaration en application de cette partie avant le 1^{er} novembre 2016.

- (2)** Indépendamment de la partie 3, une contrepartie déclarante n'est pas tenue de déclarer les données concernant un dérivé si toutes les conditions suivantes sont remplies :
- (a) le dérivé a été conclu avant le 29 juillet 2016;
 - (b) le dérivé expire ou vient à échéance au plus tard le 30 novembre 2016;
 - (c) la contrepartie déclarante est une agence de compensation et de dépôt ou un courtier en dérivés;
- (3)** Indépendamment de la partie 3, une contrepartie déclarante n'est pas tenue de déclarer de données sur le dérivé concernant un dérivé si toutes les conditions suivantes sont remplies :
- (a) le dérivé est conclu avant le 1^{er} novembre 2016;
 - (b) the dérivé expire ou vient à échéance au plus tard le 31 janvier 2017;
 - (c) la contrepartie déclarante n'est pas une agence de compensation et de dépôt déclarante ni un courtier en dérivés.

45. [abrogé]

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
5	Identifiant du vendeur	L'identifiant de la contrepartie qui est le vendeur.	N

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
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 une personne agréée en vertu de l'article 82 de la <i>Loi sur les instruments dérivés</i> (Québec). 	N
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 	N

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
		<p>expression dans les règles sur la déclaration des données sur les dérivés de tout territoire du Canada;</p> <ul style="list-style-type: none"> • 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). 	
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
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

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
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	<p>Montant notionnel à l'égard de chaque branche d'un dérivé :</p> <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>	O
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	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'acheter en vertu d'une option.	
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 la quantité notionnelle.	N
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

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
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			
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

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
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
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	Le prix d'exercice en vigueur à compter de la date indiquée dans l'élément de données n° 62 jusqu'à celle	N

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
	associée	stipulée dans l'élément de données n° 63.	
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 d'exercice.	N
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
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

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
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 (après décote)	La valeur monétaire de la marge de variation collectée par la contrepartie déclarante après l'application d'une décote.	N
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

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
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 à un événement.	O
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	La prochaine date à laquelle le taux variable 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
	référence	référence sera révisé.	
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 : <ul style="list-style-type: none"> a) au moins deux dérivés déclarés séparément par la contrepartie déclarante sont conclus en vertu d'une seule entente; 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. 	O
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	N

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
		exprimé.	
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
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

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
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 négociation de l'actif sous-jacent	Identifie la plateforme sur laquelle est négocié l'élément sous-jacent visé dans l'élément de données n° 128.	N
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

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à disposition du public
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
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

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> <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</p>

Territoire	Loi, règlement ou règle
	<p>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 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>

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

ANNEXE C
de la
NORME MULTILATÉRALE 96-101
SUR LES DÉCLARATION DES OPÉRATIONS SUR DÉRIVÉS

Obligations relatives à la diffusion publique des données par transaction

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).

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	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 : a) Corriger b) Mettre fin c) Erreur d) Relancer e) Modifier si l'indicateur de	Varchar(52)	Jusqu'à 52 caractères alphanumériques

		modification de l'élément de données n° 100 dans l'annexe A est déclaré au répertoire des opérations reconnu comme étant vrai (True).		
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.	

Tableau 2

Catégories d'actif	Identifiant de l'actif sous-jacent
Taux d'intérêt	CAD-BA-CDOR
Taux d'intérêt	USD-LIBOR-BBA
Taux d'intérêt	EUR-EURIBOR-Reuters
Taux d'intérêt	GBP-LIBOR-BBA
Crédit	Tous les indices
Avoir propre	Tous les indices

Exclusions

2. Les dérivés ci-dessous sont exempts des dispositions du point 1 :
 - (a) un dérivé qui nécessite plusieurs opérations de change;
 - (b) un dérivé résultant d'un exercice bilatéral ou multilatéral de compression de portefeuille;
 - (c) un dérivé résultant d'une novation par une agence de compensation et de dépôt.

Arrondissement du montant notionnel

3. Conformément aux conventions d'arrondissement énoncées dans le tableau 3, le répertoire des opérations reconnu arrondit le montant notionnel d'un dérivé sur lequel il met disposition du public des données par transaction en vertu de la règle et du point 1 de cette annexe.

Tableau 3

Montant notionnel déclaré de la branche 1 ou 2	Montant notionnel arrondi
<1 000 \$	Arrondir à la tranche de 5 \$ la plus proche
=>1 000 \$ <10 000 \$	Arrondir à la tranche de 100 \$ la plus proche
=>10 000 \$ <100 000 \$	Arrondir à la tranche de 1 000 \$ la plus proche
=>100 000 \$ <1 million \$	Arrondir à la tranche de 10 000 \$ la plus proche
=>1 million \$ <10 millions \$	Arrondir à la tranche de 100 000 \$ la plus proche
=>10 millions \$ <50 millions \$	Arrondir à la tranche de 1 million \$ la plus proche
=>50 millions \$ <100 millions \$	Arrondir à la tranche de 10 millions \$ la plus proche
=>100 millions \$ <500 millions \$	Arrondir à la tranche de 50 millions \$ la plus proche
=>500 millions \$ <1 milliard \$	Arrondir à la tranche de 100 millions \$ la plus proche
=>1 milliard \$ <100 milliards \$	Arrondir à la tranche de 500 millions \$ la plus proche
>100 milliards \$	Arrondir à la tranche de 50 milliards \$ la plus proche

Plafonnement du montant notionnel

4. Si le montant notionnel arrondi, établi selon les directives du point 3, d'un dérivé mentionné au point 1 est supérieur au montant notionnel arrondi plafonné exprimé en dollars canadiens, selon la catégorie de l'actif et la date d'expiration, moins la date de prise d'effet indiquée dans le tableau 4 pour le dérivé, le répertoire des opérations reconnu met à la disposition du public le montant notionnel arrondi plafonné du dérivé au lieu du montant notionnel arrondi.
5. Quand il met à la disposition du public des données par transaction, conformément au paragraphe 39(3) de la présente règle et du présent annexe, pour un dérivé auquel le point 4 s'applique, le répertoire des opérations reconnu doit déclarer que le montant notionnel du dérivé a été plafonné.
6. Pour chaque dérivé mentionné au point 1 dont le montant notionnel arrondi plafonné est mis à la disposition du public, si les données qui seront mis à la disposition du public comprennent une prime de l'option, un répertoire des opérations reconnu doit rajuster la prime de l'option d'une manière compatible et proportionnée au plafonnement et à l'arrondissement du montant notionnel déclaré du dérivé.

Tableau 4

Catégories d'actif	Date d'expiration moins la date de prise d'effet	Montant notionnel arrondi plafonné en dollars canadiens
Taux d'intérêt	Au plus 2 ans (746 jours)	250 millions \$
Taux d'intérêt	Plus de 2 ans (746 jours) et au plus 10 ans (3 668 jours)	100 millions \$

Taux d'intérêt	Plus de 10 ans (3 668 jours)	50 millions \$
Crédit	Toutes les dates	50 millions \$
Avoir propre	Toutes les dates	50 millions \$

Calendrier

7. Sous réserve des points 2 à 6, le répertoire des opérations reconnu doit mettre à disposition du public l'information visé au point 1 au plus tard 48 heures après l'heure et la date déclarées pour l'élément de données n° 14 de l'annexe A du dérivé.

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.

ANNEXE 96-101A1

DEMANDE DE RECONNAISSANCE À TITRE DE RÉPERTOIRES DES OPÉRATIONS – FICHE D'INFORMATION

Déclarant :

Type de document : INITIAL MODIFICATION

Nom(s) :

Nom complet du répertoire des opérations :

Nom sous lequel les activités sont exercées, s'il est différent de celui indiqué à la rubrique 1 :

Dans le cas d'une modification du nom du répertoire des opérations indiqué à la rubrique 1 ou 2, inscrire le nom antérieur ainsi que le nouveau nom.

Nom antérieur :

Nouveau nom :

Coordonnées :

Siège social

Adresse

Téléphone :

Télécopieur

Adresse postale (si elle est différente) :

6. Autres établissements

Adresse

Téléphone :

Télécopieur

Adresse du site Web :

Personne-ressource

Nom et titre :

Téléphone :

Télécopieur

Courriel :

9. Avocat

Cabinet :
Nom de l'avocat :
Téléphone :
Télécopieur :
Courriel :

Avocat canadien (s'il y a lieu)

Cabinet :
Nom de l'avocat :
Téléphone :
Télécopieur :
Courriel :

ANNEXES

Joindre toutes les annexes au dépôt. Sur chacune des annexes, inscrire le nom du répertoire des opérations, la date du dépôt de l'annexe ainsi que la date à laquelle l'information est arrêtée (si cette date est différente de la date du dépôt). Si une annexe ne s'applique pas, elle doit être remplacée par une déclaration à cet égard.

Sauf indication contraire ci-après, si le déposant dépose une modification de l'information fournie dans le cadre du dépôt et que l'information concerne une annexe déposée avec celui-ci ou une modification ultérieure, il doit, pour se conformer à l'article 3 de la présente règle, donner une description du changement, indiquer la date prévue de sa mise en œuvre et déposer une version à jour complète de l'annexe. Le déposant doit fournir une version propre et une version soulignée montrant les modifications par rapport au dépôt antérieur.

Si le déposant a déposé l'information visée au paragraphe précédent en vertu de l'article 17 de la présente règle, il n'a pas à la déposer de nouveau comme modification d'une annexe. Toutefois, si une annexe contient des renseignements supplémentaires concernant une règle déposée, il doit aussi déposer une modification de l'annexe.

Annexe A – Gouvernance

Statut juridique :

Société par actions

Société de personnes

Autre (préciser) :

2. Indiquer les renseignements suivants :

1. Date (JJ/MM/AAAA) de constitution.

2. Lieu de constitution.
 3. Loi en vertu de laquelle le répertoire des opérations a été constitué.
 4. Statut réglementaire dans d'autres territoires.
3. Fournir un exemplaire des documents constitutifs (y compris les règlements de la société), des conventions entre actionnaires, des conventions de société et des autres documents semblables ainsi que de toutes les modifications apportées ultérieurement.
 4. Fournir les politiques et les procédures de règlement des conflits d'intérêts potentiels découlant du fonctionnement du répertoire des opérations et des services qu'il offre, notamment ceux liés aux intérêts commerciaux du répertoire des opérations, aux intérêts de ses propriétaires et de ses exploitants, aux responsabilités et au bon fonctionnement du répertoire des opérations et ceux pouvant survenir entre les activités du répertoire des opérations et ses responsabilités réglementaires.
 5. Le candidat qui demande la désignation à titre de répertoire des opérations conformément aux lois provinciales sur les valeurs mobilières et qui est situé à l'extérieur du territoire intéressé doit également fournir les documents suivants :
 - (1) un avis juridique indiquant que, en droit, le candidat a le pouvoir de mettre rapidement ses livres et dossiers à la disposition de l'autorité de réglementation des valeurs mobilières et de se soumettre aux inspections et examens effectués sur place par l'autorité de réglementation des valeurs mobilières;
 - (2) Un formulaire prévu à l'annexe 96-101A2 *Acte d'acceptation de compétence et reconnaissance d'un mandataire aux fins de signification par le répertoire des opérations* rempli.

Annexe B – Propriété

1. Fournir une liste des porteurs inscrits ou des propriétaires véritables des titres du répertoire des opérations ou des détenteurs d'autres participations dans celui-ci. Pour chaque personne énumérée dans l'annexe, veuillez fournir les renseignements suivants :
 1. Nom.
 2. Principale activité ou occupation et titre.
 3. Participation.
 4. Nature de la participation, notamment une description du type de titre.
2. Si le répertoire des opérations est une société par actions cotée, fournir une liste indiquant uniquement les actionnaires qui sont directement propriétaires d'au moins cinq pour cent d'une catégorie de ses titres comportant droit de vote.

Annexe C – Constitution

1. Fournir la liste des associés, dirigeants, gouverneurs et membres du conseil d'administration et de ses comités permanents, ou des personnes exerçant des fonctions semblables, qui occupent actuellement ces postes ou qui les ont occupés au cours de l'année précédente, en indiquant pour chacun les éléments suivants :
 1. Nom.
 2. Principale activité ou occupation et titre.
 3. Dates de début et de fin du mandat ou du poste actuel.
 4. Type d'activités principales et employeur actuel.
 5. Type d'activités principales au cours des cinq dernières années, si elles diffèrent de celles indiquées à la rubrique 4.
 6. Le cas échéant, le fait que la personne est considérée comme un administrateur indépendant.
2. Fournir la liste des comités du conseil en indiquant leur mandat.
3. Fournir le nom du chef de la conformité du répertoire des opérations.

Annexe D – Entités du même groupe

1. Fournir le nom et l'adresse du siège de chaque entité du même groupe que le répertoire des opérations et décrire sa principale activité.
2. Pour chaque entité du même groupe que le répertoire des opérations qui remplit l'une des conditions suivantes :
 - a) le répertoire des opérations lui a imparti l'un de ses services ou systèmes clés décrit à l'annexe E – Fonctionnement du répertoire des opérations, notamment la tenue des dossiers relatifs aux activités, la tenue des dossiers de données sur les opérations, la déclaration des données sur les opérations, la comparaison des données sur les opérations ou les listes de données;
 - b) le répertoire des opérations entretient avec lui toute autre relation d'affaires importante, notamment des prêts ou des cautionnements réciproques;

Fournir les renseignements suivants.

- (1) Nom et adresse de l'entité du même groupe.
- (2) Nom et titre des administrateurs et dirigeants de l'entité du même groupe ou des personnes exerçant des fonctions semblables.

- (3) Une description de la nature et de la portée de toute entente contractuelle ou autre conclue avec le répertoire des opérations, et des rôles et responsabilités de l'entité du même groupe en vertu de celle-ci.
- (4) Un exemplaire de chaque contrat important lié à des fonctions imparties ou à d'autres relations importantes.
- (5) Un exemplaire des documents constitutifs (y compris les règlements de la société), des conventions entre actionnaires, des conventions de société et des autres documents semblables.
- (6) Pour le dernier exercice de toute entité du même groupe avec laquelle le répertoire des opérations a conclu des prêts ou des cautionnements réciproques qui sont en cours, des copies des états financiers, qui n'ont pas à être audités, établis conformément aux principes suivants, selon le cas :
 - a) les PCGR canadiens applicables aux entreprises ayant une obligation d'information du public;
 - b) les IFRS;
 - c) les PCGR américains, si l'entité du même groupe est constituée en vertu des lois des États-Unis d'Amérique ou d'un de ses États.

Annexe E – Fonctionnement du répertoire des opérations

1. Veuillez préciser en détail le fonctionnement du répertoire des opérations et ses fonctions connexes, notamment, sans toutefois s'y limiter, une description des éléments suivants :
 - (1) La structure du répertoire des opérations.
 - (2) Les moyens par lesquels les participants du répertoire des opérations et, s'il y a lieu, leurs clients accèdent aux installations et aux services du répertoire des opérations.
 - (3) Les heures d'exploitation.
 - (4) Les installations et les services offerts par le répertoire des opérations, notamment la collecte et la mise à jour des données sur les dérivés.
 - (5) La liste des types de dérivés pour lesquels des dossiers de données sont conservés, qui décrit notamment les caractéristiques des dérivés.
 - (6) Les procédures concernant la saisie, l'affichage et la déclaration des données sur les dérivés.
 - (7) Les procédures de tenue de dossiers qui permettent de consigner les données sur les dérivés sans erreur ou omission et en temps opportun.

- (8) Les mesures de protection et les procédures mises en place pour protéger les données sur les dérivés des participants du répertoire des opérations, notamment les politiques et les procédures qui permettent raisonnablement de protéger les renseignements personnels et de préserver la confidentialité des données.
 - (9) La formation offerte aux participants et un exemplaire de la documentation qui leur est remise concernant les systèmes, les règles et les autres exigences du répertoire des opérations.
 - (10) Les mesures prises pour s'assurer que les participants du répertoire des opérations sont informés des exigences du répertoire des opérations et s'y conforment.
 - (11) Le cadre de gestion globale des risques du répertoire des opérations, notamment les risques d'entreprise, juridiques et opérationnels.
2. Le déposant doit fournir toutes les politiques et procédures ainsi que tous les manuels relatifs au fonctionnement du répertoire des opérations.

Annexe F – Impartition

1. Le répertoire des opérations a imparti à un tiers sans lien de dépendance l'exploitation de services ou de systèmes clés dont il est question à l'annexe E – Fonctionnement du répertoire des opérations, notamment la collecte et la mise à jour des données sur les dérivés, fournir les renseignements suivants :
 - (1) Le nom et l'adresse de la personne ou de la société (y compris toute entité du même groupe que le répertoire des opérations) à qui la fonction a été impartie.
 - (2) Une description de la nature et de la portée de toute entente contractuelle ou autre conclue avec le répertoire des opérations, et des rôles et responsabilités du tiers sans lien de dépendance en vertu de celle-ci.
 - (3) Un exemplaire de chaque contrat important relatif à toute fonction impartie.

Annexe G – Systèmes et élaboration de plans de secours

1. Pour chacun des systèmes servant à la collecte et au maintien des déclarations sur les dérivés, décrire ce qui suit :
 - (1) Les estimations de la capacité actuelle et future.
 - (2) Les procédures d'examen de la capacité du système.
 - (3) Les procédures d'examen de la sécurité du système.
 - (4) Les procédures pour effectuer des simulations de crise.

- (5) Les plans de continuité des activités et de reprise après sinistre du déposant, notamment toute documentation pertinente.
- (6) Les procédures de mise à l'essai des plans de continuité des activités et de reprise après sinistre.
- (7) La liste des données à déclarer par tous les types de participants.
- (8) Le ou des formats de données qui seront mis à la disposition de l'autorité de réglementation des valeurs mobilières et des autres personnes qui reçoivent des données sur les opérations.

Annexe H – Accès aux services

1. Fournir un ensemble complet de tous les formulaires, accords ou autres documents relatifs à l'accès aux services du répertoire des opérations tels que décrits à l'article 1 (4) à l'annexe E – Fonctionnement du répertoire des opérations.
2. Décrire les types de participants du répertoire des opérations.
3. Décrire les critères établis par le répertoire des opérations pour accéder à ses services.
4. Décrire les différences en ce qui a trait à l'accès aux services offerts par le répertoire des opérations à différents groupes ou types de participants.
5. Décrire les conditions aux termes desquelles les participants du répertoire des opérations peuvent être suspendus ou exclus en ce qui concerne l'accès aux services du répertoire des opérations.
6. Décrire les procédures suivies en cas de suspension ou d'exclusion d'un participant.
7. Décrire les dispositions prises par le répertoire des opérations pour permettre aux clients des participants d'accéder à celui-ci. Fournir un exemplaire des ententes ou documents relatifs à ces dispositions.

Annexe I – Droits

1. Fournir une description du barème de droits et de tous les droits exigés par le répertoire des opérations ou par une partie à qui des services ont été impartis directement ou indirectement, notamment les droits relatifs à l'accès, à la collecte et à la mise à jour des données sur les dérivés, la façon dont ces droits sont établis, ainsi que tout rabais sur les droits et la façon dont les rabais sont établis.

ATTESTATION DU RÉPERTOIRE DES OPÉRATIONS

Le soussigné atteste que les renseignements fournis dans le présent rapport sont exacts.

FAIT à _____ le _____ 20 ____.

(Nom du répertoire des opérations)

(Nom de l'administrateur, du dirigeant ou de l'associé – en caractères d'imprimerie)

(Signature de l'administrateur, du dirigeant ou de l'associé)

(Titre officiel – en caractères d'imprimerie)

**SI APPLICABLE, ATTESTATION SUPPLÉMENTAIRE
DU RÉPERTOIRE DES OPÉRATIONS QUI EST SITUÉ À L'EXTÉRIEUR DE [indiqué le nom du territoire
intéressé]**

Le soussigné atteste ce qui suit :

1. il mettra ses livres et dossiers à la disposition de l'autorité de réglementation des valeurs mobilières et se soumettra aux inspections et examens effectués sur place par l'autorité de réglementation des valeurs mobilières;
2. en droit, il a le pouvoir :
 - a) de mettre ses livres et dossiers à la disposition de l'autorité de réglementation des valeurs mobilières;
 - b) de se soumettre aux inspections et examens effectués sur place par l'autorité de réglementation des valeurs mobilières.

FAIT à _____ le _____ 20_____.

(Nom du répertoire des opérations)

(Nom de l'administrateur, du dirigeant ou de l'associé – en caractères d'imprimerie)

(Signature de l'administrateur, du dirigeant ou de l'associé)

(Titre officiel – en caractères d'imprimerie)

ANNEXE 96-101A2
ACTE D'ACCEPTATION DE COMPÉTENCE PAR UN RÉPERTOIRE DES OPÉRATIONS
ET RECONNAISSANCE D'UN MANDATAIRE AUX FINS DE SIGNIFICATION

1. Nom du répertoire des opérations (le « répertoire des opérations ») :

2. Entité administrative de constitution, ou équivalent, du répertoire des opérations :

3. Adresse de l'établissement principal du répertoire des opérations :

4. Nom du mandataire aux fins de signification du répertoire des opérations (le « mandataire ») :

5. Adresse du mandataire au [insérer le territoire intéressé] :

6. Le répertoire des opérations reconnaît et nomme le mandataire comme mandataire à qui signifier tout avis, acte de procédure, citation à comparaître, sommation ou autre acte dans toute action, enquête ou instance administrative, criminelle, quasi criminelle ou autre découlant de ses activités au [insérer le territoire intéressé]. Il renonce irrévocablement à tout droit de contester la signification à son mandataire au motif qu'elle ne le lie pas.
7. Le répertoire des opérations accepte sans condition la compétence non exclusive : i. des tribunaux judiciaires et administratifs du [insérer le territoire intéressé] et ii. de toute instance intentée dans une province ou un territoire et découlant de la réglementation et de la supervision des activités du répertoire des opérations au [insérer le territoire intéressé] ou s'y rattachant.
8. Le répertoire des opérations s'engage à déposer, au moins 30 jours avant de cesser d'être reconnu ou dispensé par la Commission, un nouvel acte d'acceptation de compétence et de reconnaissance d'un mandataire aux fins de signification établi conformément à la présente annexe qui restera en vigueur pendant six ans après qu'il aura cessé d'être reconnu ou dispensé, sauf modification conforme au point 9.
9. Le répertoire des opérations s'engage à déposer une version modifiée du présent acte d'acceptation de compétence et de reconnaissance d'un mandataire aux fins de signification établi conformément à la présente annexe au moins 30 jours avant tout changement du nom ou de l'adresse ci-dessus du mandataire, pendant six ans après qu'il aura cessé d'être reconnu ou dispensé par la Commission de la reconnaissance prévue au droit des valeurs mobilières du [insérer le territoire intéressé].

10. Le présent acte d'acceptation de compétence et de reconnaissance d'un mandataire aux fins de signification est régi par les lois du [insérer le territoire intéressé] et s'interprète conformément à ces lois.

Date : _____

Signature du répertoire des opérations

Nom et titre de l'administrateur du
répertoire des opérations
(en lettres moulées)

MANDATAIRE

CONSETEMENT À AGIR COMME MANDATAIRE AUX FINS DE SIGNIFICATION

Je, _____ (nom complet du mandataire), résidant au
_____ (adresse), accepte la reconnaissance comme mandataire aux
fins de signification de _____ (insérer le nom du répertoire des
opérations) et consens à agir en cette qualité selon les modalités de l'acte de reconnaissance signé par
_____ (insérer le nom du répertoire des opérations) le
_____ (date).

Signature du mandataire

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

ANNEXE 96-101A3
RAPPORT DE CESSATION D'ACTIVITÉ DU RÉPERTOIRE DES OPÉRATIONS

1. Identification :
 - (1) Nom complet du répertoire des opérations reconnu :
 - (2) Nom sous lequel l'activité est exercée, s'il est différent du nom indiqué à la rubrique 1 (1) :
2. Date probable de cessation d'activité du répertoire des opérations reconnu :
3. Si la cessation d'activité a été involontaire, date à laquelle le répertoire des opérations reconnu a cessé son activité :

ANNEXES

Déposer toutes les annexes avec le rapport de cessation d'activité. Sur chacune des annexes, inscrire le nom du répertoire des opérations reconnu, la date du dépôt de l'annexe ainsi que la date à laquelle l'information est arrêtée (si cette date est différente de la date du dépôt). Si une annexe ne s'applique pas, elle doit être remplacée par une déclaration à cet égard.

Annexe A

Donner les raisons de la cessation d'activité du répertoire des opérations reconnu.

Annexe B

Fournir la liste de tous les dérivés pour lesquels des dossiers de données sont conservés au cours des 30 jours précédant la cessation d'activité du répertoire des opérations.

Annexe C

Fournir la liste de tous les participants qui sont des contreparties à des dérivés dont les données sont à déclarer en vertu de la présente règle et auxquels le répertoire des opérations reconnu a fourni des services au cours des 30 jours précédant la cessation de son activité.

ATTESTATION DU RÉPERTOIRE DES OPÉRATIONS RECONNU

Le soussigné atteste que les renseignements fournis dans le présent rapport sont exacts.

FAIT à _____ le _____ 20_____.

(Nom du répertoire des opérations)

(Nom de l'administrateur, du dirigeant ou de l'associé – en caractères d'imprimerie)

(Signature de l'administrateur, du dirigeant ou de l'associé)

(Titre officiel – en caractères d'imprimerie)