



Déclaration d'opérations sur titres de créance Guide de l'utilisateur du SEROM 2.0

Version 1.4
1er mai 2015

Tous droits réservés. Aucune partie du présent document ne peut être photocopiée, reproduite, stockée dans un système d'extraction quelconque ou transmise, sous quelque forme ou par quelque moyen que ce soit, électronique, mécanique ou autre, sans l'autorisation écrite préalable de l'OCRCVM.

Historique des modifications

Version	Description de la modification	Date
1.1	<ul style="list-style-type: none"> Première version soumise à l'examen des distributeurs de titres d'État 	25 juin 2014
1.2	<ul style="list-style-type: none"> Version définitive 	30 octobre 2014
1.3	<ul style="list-style-type: none"> Mise à jour des références au Guide d'adhésion et d'attestation pour le SEROM 2.0 Section 5.3.3 : Ajout d'une note concernant la correction des erreurs relevées dans le reçu de fichier avant que le fichier puisse être traité Section 5.6, tableau 3 : Conditions régissant la déclaration du LEI <ul style="list-style-type: none"> Mise à jour de l'identifiant de la contrepartie afin d'exiger la déclaration du LEI lorsque la contrepartie est un courtier membre qui est distributeur de titres d'État. Si la contrepartie est un courtier membre qui n'est pas distributeur de titres d'État et si le LEI n'est pas connu, fournir l'identifiant de remplacement. Section 10.1 : Suppression de la section contenant les détails relatifs à l'adhésion qui seront inclus dans le Guide d'adhésion et d'attestation pour le SEROM 2.0 Annexe B : Spécifications de message pour les opérations de pension sur titres <ul style="list-style-type: none"> Ajout des champs SETTLEMENT_DATE, RELATED_PTY et NON_RESIDENT Mise à jour du champ CLEARING_HOUSE = RC (requis à titre conditionnel) Mise à jour du champ TRANS_TYPE: 3 = Mise à jour (du taux) Ajout de l'annexe D : Exemples d'opérations de pension sur titres Annexe E : Modification du modèle de formulaire d'adhésion 	19 février 2015
1.4	<ul style="list-style-type: none"> Section 5.6.1 : Remplacer «noms abrégés de quatre lettres» par «LEI fictif» Annexe A : Spécifications de message pour les opérations sur titres de créance: <ul style="list-style-type: none"> Mise à jour du champ YIELD = R (requis) Annexe B : Spécifications de message pour les opérations de pension sur titres <ul style="list-style-type: none"> Mise à jour du champ REPO_RATE = R (requis) Mise à jour du champ REPO_HAIRCUT = R (requis) Annexe C: Exemples d'opérations sur titres de créance: <ul style="list-style-type: none"> Exemple 3 : 19-Side=2 [vente] 14 Customer LEI = Exemple 5 : 13-Customer Acc Type=2 [institutionnel] Exemple 11: Reporting Dealer ID=PT3QB789TSUIDF371261[Courtier déclarant B] Exemple 13: Le courtier membre déclarant A vend pour 4 millions de dollars d'obligations à 1,75 % du gouvernement du Canada échéant le 1^{er} mars 2019 à un client institutionnel 	1er mai 2015

Table des matières

1. AU SUJET DU PRÉSENT DOCUMENT.....	5
1.1. INTRODUCTION.....	5
1.1.1. <i>Déclaration d'opérations sur titres de créance à l'OCRCVM</i>	5
1.1.2. <i>Banque du Canada et relevés SEROM</i>	5
1.2. PUBLIC VISÉ.....	5
1.3. DOCUMENTS CONNEXES.....	5
2. UTILISATION ET DIFFUSION DES DONNÉES	6
2.1. OCRCVM.....	6
2.2. BANQUE DU CANADA.....	6
3. ADHÉSION	7
4. OBLIGATIONS DE DÉCLARATION IMPOSÉES PAR LA RÉGLEMENTATION	7
4.1. PHASES DE MISE EN ŒUVRE.....	7
4.2. OPÉRATIONS ET TITRES VISÉS PAR L'OBLIGATION DE DÉCLARATION.....	8
4.3. OPÉRATIONS ET TITRES NON VISÉS PAR L'OBLIGATION DE DÉCLARATION.....	9
5. DÉCLARATIONS D'OPÉRATIONS – EXIGENCES GÉNÉRALES.....	10
5.1. DÉLAIS DE DÉCLARATION.....	10
5.1.1. <i>Déclarations tardives</i>	10
5.2. ANNULATIONS ET CORRECTIONS D'OPÉRATIONS	10
5.2.1. <i>Annulations et corrections d'opérations traitées avant l'expiration du délai de déclaration</i>	10
5.2.2. <i>Annulations et corrections d'opérations traitées après l'expiration du délai de déclaration</i>	10
5.3. TRANSMISSION DES FICHIERS D'OPÉRATIONS.....	11
5.3.1. <i>Fichiers distincts pour les opérations sur titres de créance et les opérations de pension sur titres</i> ..	11
5.3.2. <i>Transmission de fichiers supplémentaires</i>	12
5.3.3. <i>Transmission de fichiers modifiés avant l'expiration du délai de déclaration</i>	12
5.4. ABSENCE D'OPÉRATIONS À DÉCLARER	12
5.5. REÇUS DE FICHIER ET TENUE DE DOSSIERS.....	12
5.6. RECOURS AUX IDENTIFIANTS POUR ENTITÉS JURIDIQUES	12
5.6.1. <i>Accès aux LEI et aux identifiants pour entités de remplacement</i>	13
5.7. RECOURS À UN MANDATAIRE AUTORISÉ	13
5.8. OBLIGATIONS DES PARTIES DÉCLARANTES DANS LE CADRE D'OPÉRATIONS COURANTES.....	14
6. CONSEILS POUR LA DÉCLARATION D'OPÉRATIONS SUR TITRES DE CRÉANCE.....	14
6.1. ATTRIBUTIONS.....	14
6.2. IDENTIFIANT DE RÉFÉRENCE	14
6.3. COMMISSION	15
6.4. TYPE DE CONTREPARTIE	15
6.5. IDENTIFIANT DE CONTREPARTIE	15
6.6. IDENTIFIANT DE COMPTE CLIENT	15
6.7. INDICATEUR D'EXÉCUTION ÉLECTRONIQUE.....	15
6.8. DATE D'EXÉCUTION.....	16
6.9. HEURE D'EXÉCUTION.....	16

6.10.	SOCIÉTÉS ÉTRANGÈRES DU MÊME GROUPE.....	16
6.11.	CODE ISIN/NUMÉRO CUSIP.....	16
6.12.	IDENTIFIANT D'OPÉRATION INITIALE	16
6.13.	MARCHÉ PRIMAIRE.....	16
6.14.	SENS (DU POINT DE VUE DE LA CONTREPARTIE).....	16
6.15.	IDENTIFIANT DE PLATEFORME DE NÉGOCIATION	17
6.16.	RENDEMENT	17
7.	CONSEILS POUR LA DÉCLARATION D'OPÉRATIONS DE PENSION SUR TITRES	17
7.1.	DEVISE.....	17
7.2.	PRIX	17
7.3.	TAUX DE PENSION SUR TITRES	17
7.4.	IDENTIFIANT DE GARANTIE DE PENSION SUR TITRES.....	17
7.5.	TYPE DE GARANTIE DE PENSION SUR TITRES.....	17
7.6.	TYPE D'OPÉRATION.....	17
8.	ATTESTATION ET GESTION DU CHANGEMENT	18
8.1.	DEMANDES DE MODIFICATION DE LA PART DE L'OCRCVM.....	18
8.2.	DEMANDES DE MODIFICATION DE LA PART DES COURTIER MEMBRES	18
9.	RENSEIGNEMENTS CONCERNANT LE SOUTIEN	19
10.	SYSTÈME DE DÉCLARATION DES OPÉRATIONS SEROM 2.0	19
11.	ANNEXES.....	20
11.1.	ANNEXE A – SPÉCIFICATIONS DE MESSAGE DES FICHIERS D'OPÉRATIONS DU SEROM 2.0 – OPÉRATIONS SUR TITRES DE CRÉANCE	20
11.2.	ANNEXE B – SPÉCIFICATIONS DE MESSAGE DES FICHIERS D'OPÉRATIONS DU SEROM 2.0 – OPÉRATIONS DE PENSION SUR TITRES	25
11.3.	ANNEXE C – EXEMPLES D'OPÉRATIONS SUR TITRES DE CRÉANCE.....	30
11.4.	ANNEXE D – EXEMPLES D'OPÉRATIONS DE PENSION SUR TITRES.....	54
11.5.	ANNEXE E – FORMULAIRE D'ADHÉSION AU SEROM 2.0	65
11.6.	ANNEXE F – IDENTIFIANTS POUR ENTITÉS JURIDIQUES (LEI) – RENSEIGNEMENTS ET INSCRIPTION.....	66
11.7.	ANNEXE G – FIGURES	67

1. Au sujet du présent document

1.1. Introduction

1.1.1. *Déclaration d'opérations sur titres de créance à l'OCRCVM*

La Règle 2800C instaure un cadre de travail selon lequel les courtiers membres sont tenus de déclarer les opérations sur titres de créance à l'OCRCVM au moyen du Système d'établissement de relevés des opérations sur le marché 2.0 (SEROM 2.0). Les opérations sur titres de créance exécutées par un courtier membre sur les marchés hors cote, y compris au moyen d'un système de négociation parallèle (SNP) ou par l'entremise d'un courtier intermédiaire en obligations (CIEO), doivent être déclarées à l'OCRCVM après l'opération. L'information sur les opérations déclarée conformément à la Règle 2800C permettra à l'OCRCVM de surveiller et d'encadrer la négociation sur les marchés hors cote des titres de créance. Pour obtenir plus de détails, veuillez vous reporter à l'*Avis de l'OCRCVM 14-0250 – Avis sur les règles – Déclaration d'opérations sur titres de créance*.

1.1.2. *Banque du Canada et relevés SEROM*

À ce jour, les distributeurs de titres d'État transmettent des déclarations standardisées visant l'activité sur les marchés de titres de créance au Canada à la Banque du Canada sous forme de rapports statistiques hebdomadaires transmis au moyen du SEROM. Le système de l'OCRCVM servant à déclarer les opérations sur titres de créance, appelé SEROM 2.0, remplacera le SEROM. La Règle 2800C exige que tous les distributeurs de titres d'État commencent à déclarer les opérations sur titres de créance au moyen du SEROM 2.0¹.

1.2. Public visé

Le présent document s'adresse aux courtiers membres qui sont tenus de déclarer les opérations sur titres de créance à l'OCRCVM. Il intéressera particulièrement les développeurs, les analystes des systèmes de gestion ainsi que le personnel de la conformité et de l'assurance de la qualité.

1.3. Documents connexes

Le présent guide de l'utilisateur est complété par les documents connexes dont la liste figure ci-dessous. L'OCRCVM avisera les courtiers membres lorsque des documents nouveaux ou mis à jour seront publiés.

Guide du système de déclaration des opérations SEROM 2.0

Guide d'adhésion et d'attestation pour le SEROM 2.0

Avis de l'OCRCVM 14-0250 - Avis sur les règles – Déclaration d'opérations sur titres de créance

¹ Le SEROM et le SEROM 2.0 fonctionneront en parallèle pendant une période de transition restant à définir, pendant laquelle les courtiers membres continueront d'envoyer des relevés hebdomadaires globaux à la Banque du Canada. Cette période de transition sera annoncée dans un avis de l'OCRCVM.

2. Utilisation et diffusion des données

2.1. OCRCVM

L'OCRCVM utilise les données sur les opérations sur titres de créance soumises par les courtiers membres pour s'acquitter de ses attributions de surveillance et d'encadrement de la négociation sur les marchés hors cote des titres de créance, en recourant à des alertes et des rapports conçus pour détecter les pratiques de négociation potentiellement abusives².

L'OCRCVM partage les données sur les opérations sur titres de créance effectuées par les distributeurs de titres d'État avec la Banque du Canada (se reporter à la section 2.2, « Banque du Canada »).

L'OCRCVM publie des statistiques globales sur les opérations sur titres de créance et produit des rapports de courtiers périodiques qui remplacent les relevés trimestriels établis par la Banque du Canada à partir des relevés hebdomadaires globaux que les courtiers lui soumettaient antérieurement au moyen du SEROM³.

L'OCRCVM peut communiquer les données à des organismes gouvernementaux ou à d'autres organismes de réglementation si ses ordonnances de reconnaissance, les dispositions d'un protocole d'entente ou les lois applicables l'exigent.

2.2. Banque du Canada

La Banque du Canada utilise les données sur les opérations sur titres de créance à diverses fins liées à sa gestion des adjudications de titres d'État, y compris pour le calcul des limites de soumission imposées aux distributeurs de titres d'État et l'analyse des tendances et de l'évolution des marchés monétaires et des titres de créance.

Le SEROM 2.0 saisit des éléments de données supplémentaires concernant les pensions sur titres pour permettre à la Banque du Canada de surveiller l'activité et les éventuels risques liés à la stabilité financière sur ce marché de financement de base. Cette responsabilité de surveillance s'inscrit dans la logique des dernières recommandations du Conseil de stabilité financière, que les dirigeants du G20 ont avalisées, selon lesquelles il faudrait que les autorités nationales ou régionales fassent la collecte de données sur les opérations et procèdent à des analyses sélectives périodiques des positions en cours sur les marchés de pension sur titres.

La Banque du Canada continue de publier des données globales dans ses Statistiques bancaires et financières. La Banque du Canada s'est engagée (par écrit) à préserver la confidentialité de toutes les données qui lui sont transmises par l'OCRCVM et ne divulguera ces données que si la loi l'y oblige. L'OCRCVM s'attend à ce que les autres organismes gouvernementaux (y compris les autorités de réglementation des valeurs mobilières compétentes) traitent de la même façon les informations qu'il leur fournira.

² La base de données des opérations sur titres de créance de l'OCRCVM ne contient pas de données historiques (soit les données globales que les courtiers transmettent au moyen du SEROM).

³ La disponibilité, le contenu et la périodicité des nouveaux rapports de courtiers seront déterminés après consultation des participants du secteur. Pour obtenir plus de détails, se reporter au Manuel de classification des opérations pour le SEROM 2.0.

3. Adhésion

Avant de soumettre des déclarations d'opérations sur titres de créance au moyen du SEROM 2.0, le courtier membre doit envoyer un formulaire d'adhésion rempli à l'OCRCVM et adhérer effectivement au SEROM 2.0 pour recevoir un justificatif d'identité pour soumission de fichiers pour lui-même et ses mandataires autorisés. Un modèle de formulaire d'adhésion est fourni à l'annexe E.

L'adhésion est une condition préalable à la coordination des activités de configuration des comptes et d'attestation par l'intermédiaire du Service des opérations de l'OCRCVM. Le courtier membre doit mener à bien toutes les tâches d'attestation avant d'être autorisé à soumettre les fichiers d'opérations de production à l'OCRCVM. Le courtier membre doit prévoir au moins une à deux semaines pour exécuter l'attestation initiale, laquelle comprend plusieurs tâches consistant à vérifier sa capacité de transmettre au SEROM 2.0 des fichiers d'opérations conformes aux spécifications. Pour obtenir plus de détails, se reporter au Guide d'adhésion et d'attestation pour le SEROM 2.0 et au Guide du système de déclaration des opérations SEROM 2.0.

Une fois que son adhésion a été confirmée, le courtier membre est tenu d'informer l'OCRCVM de tout changement touchant les renseignements présentés dans le formulaire d'adhésion. Pour que leur adhésion reste valide, un courtier membre et ses mandataires autorisés peuvent être tenus d'attester de nouveau leur capacité de transmettre les fichiers d'opérations à l'OCRCVM lorsque des modifications sont apportées aux spécifications de message des fichiers d'opérations du SEROM 2.0 ou lorsque le courtier membre procède lui-même à des modifications (par exemple lorsqu'il recourt à un nouveau mandataire autorisé).

4. Obligations de déclaration imposées par la réglementation

4.1. Phases de mise en œuvre

Pour faciliter la mise en œuvre initiale de la déclaration d'opérations sur titres de créance, les responsabilités du courtier membre prévues au Projet de règle seront progressivement mises en place en fonction i) de la participation du courtier membre au SEROM de la Banque du Canada, ii) des types de titres de créance négociés et iii) des types d'opérations. L'application progressive se fera de la manière suivante :

Au cours de la phase 1, les courtiers membres qui, à compter de la date de prise d'effet, à savoir le 1^{er} novembre 2015 :

- sont distributeurs de titres d'État et participants au SEROM doivent se conformer à la Règle 2800C et déclarer leurs opérations sur titres de créance (y compris les pensions sur titres) libellés en dollars canadiens et celles des membres de leur groupe qui sont distributeurs de titres d'État;
- comptent dans leur groupe des distributeurs de titres d'État et participants au SEROM doivent se conformer à la Règle 2800C et déclarer les opérations sur titres de créance (y compris les pensions sur titres) libellés en dollars canadiens effectuées par ces membres de leur groupe.

La déclaration des autres opérations sur titres de créance exécutées par des courtiers membres, qu'ils soient distributeurs de titres d'État ou non, s'appliquera à la prise d'effet de la phase 2, dont la date est prévue pour le 1^{er} novembre 2016.

Au cours de la phase 2, les courtiers membres qui, à compter de la date de prise d'effet de la phase 2 :

- sont distributeurs de titres d'État et participants au SEROM doivent se conformer à la Règle 2800C et déclarer leurs opérations sur titres de créance (y compris les pensions sur titres), même ceux qui ne sont pas libellés en dollars canadiens, et celles des membres de leur groupe qui sont distributeurs de titres d'État;
- comptent dans leur groupe des distributeurs de titres d'État et participants au SEROM doivent se conformer à la Règle 2800C et déclarer les opérations sur titres de créance (y compris les pensions sur titres), même ceux qui ne sont pas libellés en dollars canadiens, effectuées par ces membres de leur groupe.

Les autres courtiers membres doivent se conformer à la Règle 2800C à l'égard de toutes leurs opérations sur titres de créance (sauf les pensions sur titres), même ceux qui ne sont pas libellés en dollars canadiens.

4.2. Opérations et titres visés par l'obligation de déclaration

La Règle obligera le courtier membre de l'OCRCVM à déclarer, après leur exécution, les opérations sur titres de créance que lui-même ou une société de son groupe qui est distributeur de titres d'État a exécutées⁴, y compris celles exécutées au moyen d'un SNP ou par l'entremise d'un CIEO. L'information exacte concernant les opérations doit être produite dans les délais et selon le format prescrits aux présentes.

Aux termes de la Règle, « titre de créance » s'entend d'un titre qui confère à son détenteur le droit, dans des cas précis, d'exiger le paiement de la somme due et qui comporte une relation débiteur-créancier. Le fait qu'un titre a été émis dans un autre pays ou qu'il est libellé dans une monnaie étrangère ne lui retire pas pour autant sa qualité de titre de créance. L'expression englobe les titres assortis d'échéances à court terme ou d'un délai de dépôt prescrit, comme le papier commercial et les billets à taux variable ainsi que les obligations et les billets classiques.

Les opérations sur les titres de créance suivants (y compris les pensions sur titres) doivent être déclarées :

- Obligations et bons du Trésor du gouvernement du Canada
- Titres de sociétés d'État fédérales
- Obligations et bons du Trésor provinciaux
- Obligations de sociétés
- Obligations municipales
- Titres et papier émis par des banques, des sociétés de fiducie et des sociétés de prêts hypothécaires
- Titres et papier adossés à des créances (de n'importe quel type)
- Titres hypothécaires
- Obligations Maple
- Obligations à coupons détachés
- Obligations à rendement réel

⁴ Se reporter à la section 4.3 pour connaître les opérations et titres non visés par l'obligation de déclaration.

- Produits structurés (titres à taux variable différé, obligations à prime de refinancement progressive)
- Titres de créance souverains étrangers
- Euro-obligations
- Acceptations bancaires
- Papier émis par une société ou une société de financement
- Billets de dépôt
- Opérations à règlement différé (à l'exception des contrats à terme sur obligations qui sont des opérations sur dérivés à déclarer aux termes d'un contrat dérivé)

4.3. Opérations et titres non visés par l'obligation de déclaration

Les opérations et titres indiqués ci-après ne doivent pas être déclarés dans le SEROM 2.0 :

- Titres de créance auxquels aucun code ISIN ou numéro CUSIP n'a été attribué** : Une opération sur titres de créance auxquels aucun code ISIN ou numéro CUSIP n'a été attribué à la date de l'exécution de l'opération n'a pas à être déclarée. S'il s'agit d'une opération visant une nouvelle émission d'un titre de créance, elle doit être déclarée une fois qu'un code ISIN ou un numéro CUSIP a été attribué et au plus tard à 18 h, heure de l'Est, le jour ouvrable suivant la date d'attribution de ce code ou numéro, et l'opération est antidatée de façon que sa date d'exécution corresponde au jour civil où elle a été exécutée.
- Opérations sur titres de créance cotés en bourse** : Les opérations sur les titres de créance cotés en bourse exécutées sur un marché n'ont pas à être déclarées.
- Opérations internes** : Les opérations entre deux unités d'exploitation ou centres de profit distincts relevant du courtier membre déclarant, sans qu'il y ait de changement de propriété véritable (par exemple les opérations entre le pupitre des titres du marché monétaire et le pupitre des obligations), n'ont pas à être déclarées.
- Opérations de pension sur titres exécutées par d'autres personnes que des distributeurs de titres d'État** : Les opérations de pension sur titres exécutées par des courtiers membres qui ne sont pas distributeurs de titres d'État n'ont pas à être déclarées.
- Opérations avec la Banque du Canada** : Les opérations pour lesquelles la Banque du Canada – ou la Banque du Canada au nom du gouvernement du Canada – est partie n'ont pas à être déclarées.
- Certaines opérations exécutées par une société du groupe du courtier qui est distributeur de titres d'État à l'égard des bons du Trésor seulement**
Les opérations exécutées par une société du groupe du courtier qui est distributeur de titres d'État à l'égard des bons du Trésor seulement, sur un titre de créance ayant une durée à l'échéance initiale de plus d'un an.

5. Déclarations d'opérations – Exigences générales

5.1. Délais de déclaration

Tableau 1 : Délais de déclaration

Date et heure d'exécution	Délais de déclaration
T+0, avant 18 h HNE	T+1, 14 h HNE
T+0, après 18 h HNE	T+2, 14 h HNE
Opérations exécutées un samedi, un dimanche ou un jour férié fédéral ou provincial Lorsqu'un jour férié tombe un jour différent en Ontario et dans la province d'un courtier membre (p. ex., le Family Day), le système de déclaration de l'OCRCVM reste disponible pour la transmission de fichiers.	T+2, 14 h HNE
Nouvelles émissions (si le code ISIN ou le numéro CUSIP est attribué après 18 h)	Après l'attribution du code ISIN ou du numéro CUSIP, 14 h HNE

5.1.1. Déclarations tardives

Si un courtier membre qui exécute un volume de négociation important et qui transmet des fichiers quotidiennement omet de transmettre ces fichiers dans les délais de déclaration prescrits sans en aviser l'OCRCVM, l'OCRCVM peut effectuer un suivi auprès du courtier membre. En cas de déclarations tardives répétées de la part du courtier membre, l'OCRCVM peut prendre des mesures de mise en application.

Nota : Les courtiers membres qui exécutent un faible volume de négociation ne sont pas tenus d'aviser l'OCRCVM lorsqu'ils prévoient qu'ils ne pourront transmettre leurs fichiers.

5.2. Annulations et corrections d'opérations

5.2.1. Annulations et corrections d'opérations traitées avant l'expiration du délai de déclaration

Si une opération est annulée avant la transmission des fichiers, ne pas déclarer l'opération initiale à l'OCRCVM et l'annuler. Si une opération est corrigée avant la transmission des fichiers, déclarer uniquement l'opération définitive (c.-à-d. sa dernière version) en tant que nouvelle opération. Si une opération est annulée ou corrigée après la transmission des fichiers mais avant l'expiration du délai de déclaration, transmettre un fichier modifié pour remplacer l'ancien.

5.2.2. Annulations et corrections d'opérations traitées après l'expiration du délai de déclaration

Lorsqu'une opération est annulée ou corrigée après l'expiration du délai de déclaration, les valeurs indiquées dans le tableau ci-dessous doivent être utilisées dans les champs des opérations (se reporter également à l'annexe C, scénarios 14 à 16). Advenant qu'une opération soit annulée et remplacée par une nouvelle opération, l'OCRCVM comprend qu'il puisse être difficile de lier la nouvelle opération à l'opération initiale (qui a ensuite été annulée). Afin de tenir compte de ce cas de figure, l'OCRCVM exige

d'antidater la nouvelle opération de façon que la date et l'heure de son exécution correspondent à celles de l'opération initiale; si l'opération n'est pas antidatée, cela pourrait déclencher un « faux positif » relatif à la fixation d'un juste prix et obliger le personnel de l'OCRCVM et du courtier membre à effectuer un suivi inutile.

Tableau 2 : Annulations et corrections d'opérations après l'expiration du délai de déclaration

Mesure	Opération déclarée	Valeurs à entrer dans les champs
1. Annulation d'une opération après l'expiration du délai de déclaration	Annulation	TRADE_ID = attribution d'un nouvel identifiant d'opération TRANS_TYPE = annulation ORIG_TRADE_ID = identifiant d'opération initiale EXECUTION_DATE = date d'annulation EXECUTION_TIME = heure d'annulation
2. Annulation d'une opération et remplacement par une nouvelle opération après l'expiration du délai de déclaration (ex. : contrepartie différente)	Annulation	TRADE_ID = attribution d'un nouvel identifiant d'opération TRANS_TYPE = annulation ORIG_TRADE_ID = identifiant d'opération initiale EXECUTION_DATE = date d'annulation EXECUTION_TIME = heure d'annulation
	Nouvelle opération	TRADE_ID = attribution d'un nouvel identifiant d'opération TRANS_TYPE = nouvelle opération EXECUTION_DATE = antidatée de façon à correspondre à celle de l'opération remplacée EXECUTION_TIME = heure d'exécution de l'opération remplacée
3. Correction d'une opération après l'expiration du délai de déclaration (ex. : correction de la quantité)	Correction	TRADE_ID = attribution d'un nouvel identifiant d'opération TRANS_TYPE = correction ORIG_TRADE_ID = identifiant d'opération initiale EXECUTION_DATE = date de correction EXECUTION_TIME = heure de correction

5.3. Transmission des fichiers d'opérations

5.3.1. Fichiers distincts pour les opérations sur titres de créance et les opérations de pension sur titres

Le courtier membre est tenu de transmettre des fichiers distincts pour les opérations sur titres de créance et les opérations de pension sur titres. Chaque déclaration d'opérations doit contenir les éléments de données se rapportant aux opérations sur titres de créance ou de pension sur titres, selon le cas. (Se reporter au Guide du système de déclaration des opérations SEROM 2.0 pour plus de détails.)

5.3.2. Transmission de fichiers supplémentaires

Le courtier membre peut transmettre des fichiers supplémentaires, selon les besoins des différents pupitres ou sources (ex. : opérations sur le marché monétaire, opération de détail soumise par l'entremise d'un mandataire autorisé). Le nom du fichier doit comprendre l'identificateur associé au fichier. (Se reporter au Guide du système de déclaration des opérations SEROM 2.0 pour plus de détails.)

5.3.3. Transmission de fichiers modifiés avant l'expiration du délai de déclaration

Le courtier membre ou son mandataire autorisé peut envoyer des versions modifiées de tout fichier jusqu'à l'expiration du délai de déclaration, soit pour corriger les erreurs indiquées dans le reçu de fichier, soit pour corriger les autres erreurs relevées, le cas échéant, par le courtier membre. Lorsque le courtier membre a transmis plusieurs fichiers comportant le même identificateur, l'OCRCVM traite uniquement le dernier fichier reçu en date de l'expiration du délai de déclaration. (Se reporter au Guide du système de déclaration des opérations SEROM 2.0 pour plus de détails.)

Nota : Si le dernier reçu de fichier transmis contient des erreurs relevées durant la validation des dossiers d'opérations, l'OCRCVM ne traite pas les fichiers. Les fichiers corrigés et transmis après l'expiration du délai de déclaration sont considérés comme des déclarations tardives.

5.4. Absence d'opérations à déclarer

Si le courtier membre n'a pas d'opérations à déclarer au cours d'une séance de négociation donnée, il n'est pas tenu de transmettre un fichier vide ou d'aviser l'OCRCVM⁵. L'OCRCVM vérifie les fichiers transmis par les courtiers membres et effectue un suivi en cas d'omission de déclaration présumée.

5.5. Reçus de fichier et tenue de dossiers

Un reçu de fichier est envoyé par voie électronique à l'entité déclarante afin d'accuser réception d'un fichier d'opérations dans le SEROM 2.0. Le reçu de fichier contient également des détails concernant toute erreur relevée durant la validation des dossiers d'opérations (p. ex. champs obligatoires non remplis, format des champs invalide) qui doit être corrigée avant que le fichier soit traité (se reporter à la section 5.3.3). Le courtier membre doit conserver les reçus de fichier conformément aux modalités de tenue de dossiers énoncées dans la Règle⁶. (Se reporter au Guide du système de déclaration des opérations SEROM 2.0 pour plus de détails.)

5.6. Recours aux identifiants pour entités juridiques

Un identifiant pour entités juridiques (**LEI**, pour *Legal Entity Identifier*) est un code de 20 caractères servant à identifier une entité qui conclut des opérations financières.

Tous les courtiers membres qui exécutent des opérations sur titres de créance assujetties à la règle de déclaration doivent obtenir un LEI, qu'ils soient des courtiers déclarants ou des contreparties (se reporter au tableau 3).

Pour plus de détails sur les LEI et le processus d'inscription permettant d'obtenir un LEI, se reporter à l'annexe F.

⁵ Le courtier peut, s'il le souhaite, transmettre un fichier vide pour recevoir un reçu de fichier à des fins d'audit.

⁶ Se reporter à l'alinéa 2.5(b) de l'Avis de l'OCRCVM 14-0250.

Tableau 3 : Conditions régissant la déclaration du LEI dans le cadre des opérations sur titres de créance

Champ de la déclaration d'opérations sur titres de créance	Recours au LEI
Identifiant du courtier déclarant	Le LEI du courtier membre déclarant doit être fourni.
Identifiant de la contrepartie	Le LEI de la contrepartie doit être fourni lorsqu'il s'agit d'un courtier membre qui est distributeur de titres d'État ou d'une banque. Si la contrepartie est un courtier membre qui n'est pas distributeur de titres d'État et si le LEI n'est pas connu, fournir l'identifiant de remplacement (se reporter à la section 5.6.1). Le LEI du CIEO ou du SNP doit être fourni lorsqu'il est connu. Dans le cas contraire, fournir l'identifiant de remplacement (se reporter à la section 5.6.1). Le LEI de l'émetteur doit être fourni lorsqu'il est connu.
LEI du client [facultatif]	Le LEI d'un client institutionnel peut être déclaré, lorsqu'il est connu.
Identifiant de la plateforme de négociation	Le LEI doit être fourni lorsqu'il est connu. Lorsque le LEI n'est pas connu, fournir l'identifiant de remplacement de la plateforme de négociation électronique au moyen de laquelle l'opération a été exécutée (se reporter à la section 5.6.1).
Chambre de compensation (pension sur titres)	Le LEI doit être fourni.

5.6.1. Accès aux LEI et aux identifiants pour entités de remplacement

L'OCRCVM tient une liste des LEI attribués aux courtiers membres, aux banques, aux SNP et aux CIEO. Il tient également une liste des identifiants de remplacement (LEI fictif) qu'il attribue lorsque le LEI n'est pas connu. Les listes de LEI et d'identifiants de remplacement peuvent être téléchargées à partir du sous-répertoire « Données de référence » du portail du système de déclaration SEROM 2.0.

5.7. Recours à un mandataire autorisé

« Mandataire autorisé » s'entend d'un courtier membre ou d'une autre entité commerciale ayant adhéré au SEROM 2.0 pour soumettre au nom de courtiers membres des déclarations d'opérations sur titres de créance. Le courtier membre ayant recours à un mandataire autorisé pour déclarer les opérations demeure tenu de respecter les dispositions de la Règle et répond des actes de son mandataire autorisé que celui-ci pose en son nom ainsi que des omissions du mandataire autorisé d'agir selon les dispositions prévues dans la Règle. L'OCRCVM oblige le courtier membre à se doter de contrôles appropriés concernant les ententes conclues avec un tiers mandataire déclarant.⁷

Les fichiers transmis par un mandataire autorisé au nom d'un courtier membre doivent être séparés selon le courtier membre (autrement dit, si un mandataire autorisé déclare des opérations au nom de plusieurs courtiers membres, il doit transmettre un fichier par courtier membre).

⁷ Se reporter à l'Avis de l'OCRCVM 14-0012 – Avis sur les règles – Note d'orientation – Entente d'impartition

5.8. Obligations des parties déclarantes dans le cadre d'opérations courantes

Le tableau ci-dessous précise les obligations des parties déclarantes dans les situations les plus courantes. Les annexes C et D fournissent des renseignements détaillés concernant le contenu des déclarations à fournir dans divers exemples d'opérations sur titres de créance et d'opérations de pension sur titres.

Tableau 4 : Obligations des parties déclarantes

Opération entre	Personne dont relève la déclaration
un courtier membre et un client ou un non-client	le courtier membre
un courtier membre et un CIEO ou un émetteur	le courtier membre
un courtier membre et un SNP, lorsque le SNP agit comme contrepartie	le courtier membre et le SNP
un SNP (lorsque le SNP agit comme contrepartie) et un adhérent	le SNP
deux courtiers membres	chaque courtier membre
un courtier membre et un émetteur	le courtier membre

6. Conseils pour la déclaration d'opérations sur titres de créance

La présente section contient des renseignements qui complètent ceux figurant dans les spécifications de message des fichiers d'opérations du SEROM 2.0 (se reporter aux annexes A et B).

6.1. Attributions

Les attributions aux clients qui ont lieu après l'expiration du délai de déclaration et qui ne modifient aucun élément de données autre que les renseignements sur le compte du client n'ont pas à être déclarées. Par exemple, advenant qu'une opération importante soit exécutée et que les attributions aux sous-comptes aient lieu après l'expiration du délai de déclaration, il n'est nécessaire de déclarer que l'opération initiale (principale)⁸.

6.2. Identifiant de référence

Les courtiers membres sont censés fournir le numéro CUSIP ou code ISIN utilisé comme référence, sauf dans le cas où une opération porte sur un titre de créance du gouvernement du Canada et qu'aucun identifiant de référence n'a été utilisé, et pour les autres catégories d'opérations dont le prix n'est habituellement pas fixé d'après un identifiant de référence. Si le champ de l'identifiant de référence est vide pour une opération portant sur un titre de créance autre que du gouvernement du Canada, l'OCRCVM peut communiquer avec le courtier membre pour obtenir plus de renseignements sur le mécanisme de fixation du prix utilisé.

⁸ Cela suppose que la quantité totale d'attributions soit égale à la quantité totale sur laquelle porte l'ordre principal. Si les attributions entraînent des changements dans les autres champs obligatoires, le courtier membre doit les déclarer en tant que correction.

6.3. Commission

Ce champ ne doit être rempli que lorsque la commission est indiquée dans l'avis d'exécution transmis au client.

6.4. Type de contrepartie

Si le courtier membre qui agit comme contrepartie est un SNP d'obligations inscrit, il doit être déclaré en tant que SNP et non en tant que courtier.

Si le courtier membre qui agit comme contrepartie est une banque de l'annexe I ou l'établissement canadien d'une banque de l'annexe II, il doit être déclaré en tant que banque et non en tant que client.

Le type de contrepartie choisi doit être « non-client » lorsque l'opération est exécutée pour un compte dans lequel un associé, administrateur, dirigeant ou employé d'un courtier membre détient une participation.

Le type de contrepartie choisi doit être « émetteur » lorsque la contrepartie est l'émetteur du titre négocié.

6.5. Identifiant de contrepartie

L'identifiant de contrepartie n'est pas fourni si la contrepartie est un client ou un non-client.

Si le LEI du courtier membre qui n'est pas distributeur de titres d'État, du SNP ou du CIEO n'est pas connu, fournir l'identifiant de remplacement qui figure dans le sous-répertoire « Données de référence » du portail du système de déclaration SEROM 2.0. Dans le cas d'un émetteur, fournir le LEI s'il est connu; dans le cas contraire, fournir le nom de l'émetteur (se reporter également à la section 5.6, « Recours aux identifiants pour entités juridiques »).

6.6. Identifiant de compte client

L'identifiant de compte client est un champ facultatif qui contient l'identifiant unique attribué au client par le courtier membre mais n'identifie pas nommément le client. Les courtiers membres sont invités à fournir ce renseignement pour aider l'OCRCVM à repérer les activités douteuses ou manipulatrices comme les opérations fictives et à réduire la fréquence des « faux positifs » et le fardeau connexe imposé au personnel des courtiers membres de fournir les renseignements de clients en réponse à une enquête d'ordre réglementaire.

6.7. Indicateur d'exécution électronique

L'indicateur d'exécution électronique doit être « Y » (oui) lorsque l'opération est exécutée ou facilitée au moyen d'une plateforme de négociation électronique, y compris un SNP, un CIEO ou une plateforme de courtier unique. C'est notamment le cas lorsqu'une opération est exécutée sur le marché hors cote puis déclarée dans une plateforme de négociation comme CanDeal.

L'indicateur d'exécution électronique doit être « N » (non) lorsqu'une opération est confirmée par téléphone puis déclarée directement dans le système de déclaration d'opérations du courtier membre en vue d'être traitée par les services administratifs.

6.8. Date d'exécution

La date d'exécution est le jour civil au cours duquel l'opération a été exécutée. Dans le cas d'une opération annulée et remplacée, l'opération est antidatée de façon que sa date d'exécution corresponde à la date de l'opération initiale. (Se reporter au tableau de la section 5.2 et à l'exemple 15 de l'annexe C.)

6.9. Heure d'exécution

L'heure d'exécution est l'heure à laquelle l'opération a été exécutée, soit celle inscrite par un système d'exécution électronique, soit, dans le cas d'une opération non électronique, celle à laquelle l'opération est saisie dans le système de déclaration du courtier membre. (En ce qui concerne les annulations et les corrections d'opérations, se reporter au tableau de la section 5.2 et aux scénarios 14 à 16 de l'annexe C.)

6.10. Sociétés étrangères du même groupe

Supposons qu'un courtier membre canadien vende des obligations du gouvernement du Canada à une société étrangère de son groupe et que cette dernière vende elle-même les obligations à un de ses clients étrangers. La vente des obligations par le pupitre canadien (de Toronto) à la société étrangère du même groupe est déclarée comme une opération avec une « société du même groupe » (partie liée = « Y » [oui]) assortie de la désignation pour « non-résident ». L'opération suivante (soit la vente des obligations par la société étrangère du même groupe à un de ses clients étrangers) n'est pas déclarée. Dans le cas où un pupitre canadien vend directement des obligations à un client étranger, cette opération est déclarée mais assortie de la désignation pour « non-résident ». Se reporter au scénario 6 de l'annexe C.

6.11. Code ISIN/numéro CUSIP

Le code ISIN *ou* le numéro CUSIP doivent être indiqués pour chaque opération. Une combinaison de codes ISIN et de numéros CUSIP peut être envoyée dans le même fichier d'opérations.

6.12. Identifiant d'opération initiale

L'identifiant d'opération initiale est fourni pour les annulations ou les corrections d'opérations. Seules les annulations et corrections d'opérations qui ont lieu après l'expiration du délai de déclaration doivent être déclarées à l'OCRCVM. Se reporter également à la section 5.2, Annulations et corrections d'opérations.

6.13. Marché primaire

Toutes les nouvelles émissions (y compris les réouvertures d'émissions) de titres de créance provinciaux, municipaux et de sociétés doivent être déclarées et assorties de la désignation pour le marché primaire. Ces opérations comprennent les retraits effectués par les émetteurs et les opérations pour compte de tiers.

6.14. Sens (du point de vue de la contrepartie)

Toutes les opérations doivent être déclarées du point de vue de la contrepartie. Par exemple, lorsqu'un courtier membre vend des titres à un client qui agit comme contrepartie, le courtier membre déclarant déclare l'opération comme un achat.

6.15. Identifiant de plateforme de négociation

Si le LEI de la plateforme de négociation n'est pas connu, l'OCRCVM fournit des identifiants de remplacement. Les identifiants de plateforme de négociation figurent dans le sous-répertoire « Données de référence » du portail du système de déclaration de l'OCRCVM.

Lorsque le type de contrepartie est « CIEO », le LEI qui lui est associé doit être indiqué tant dans le champ du type de contrepartie que dans celui de l'identifiant de plateforme de négociation.

6.16. Rendement

Les conventions du marché doivent être observées; autrement dit, si un courtier membre déclarant déclare une opération portant sur une obligation remboursable par anticipation, le rendement jusqu'à la date du remboursement anticipé doit être indiqué dans ce champ.

7. Conseils pour la déclaration d'opérations de pension sur titres

7.1. Devise

Déclarer la devise de l'opération de pension sur titres en utilisant les codes de devise standard (ISO 4217).

7.2. Prix

Déclarer le prix de l'opération de pension sur titres en excluant les intérêts courus.

7.3. Taux de pension sur titres

S'il s'agit d'une opération de pension sur titres à taux variable, le taux doit être indiqué sous forme de chaîne (ex. : CORRA+5 pb).

7.4. Identifiant de garantie de pension sur titres

Ce champ est obligatoire lorsqu'un code ISIN ou un numéro CUSIP est indiqué dans le champ « Type de garantie de pension sur titres ».

7.5. Type de garantie de pension sur titres

Ce champ indique si la pension sur titres constitue :

- une garantie sous forme de titres d'un gouvernement autre que le gouvernement fédéral (indiquer le code ISIN ou le numéro CUSIP);
- une garantie générale sous forme de titres du gouvernement fédéral (indiquer « GC » [*general collateral*]);
- une garantie portant sur plusieurs titres (indiquer « Multi » [*Multiple*]).

7.6. Type d'opération

Une nouvelle convention de pension sur titres doit être déclarée par la mention « Nouveau » comme type d'opération. Lorsqu'une convention de pension sur titres antérieurement déclarée par la mention

« Nouveau » est par la suite annulée, elle doit être déclarée à nouveau, cette fois par la mention « Annulation » comme type d'opération, et le champ de l'identifiant de pension sur titres initiale doit contenir l'identifiant de la pension sur titres annulée. Lorsqu'une correction est apportée à une déclaration antérieure, elle doit être déclarée par la mention « Correction » comme type d'opération, les modalités doivent être mises à jour en fonction de la correction, et l'identifiant de pension sur titres initiale doit contenir l'identifiant de la pension sur titres incorrecte. Lorsque les modalités (par exemple le taux) d'une pension sur titres ayant une durée ouverte sont modifiées, la mise à jour doit être déclarée par la mention « Mise à jour » comme type d'opération. Les scénarios 6, 7 et 8 de l'annexe D donnent des exemples de mises à jour d'opérations de pension sur titres.

Si, à la date d'échéance d'une convention de pension sur titres, l'une ou l'autre des contreparties omet de livrer soit les espèces, soit les titres, cette omission doit être déclarée par la mention « Échec » comme type d'opération, les modalités doivent être mises à jour pour inclure toute modification négociée ou prévue, par exemple une nouvelle date d'échéance, et l'identifiant de pension sur titres initiale doit contenir l'identifiant de la pension sur titres dont le dernier volet a échoué.

Exemple : La contrepartie A et la contrepartie B concluent une convention de pension sur titres à un jour en vertu de laquelle B vend un titre à A et le reprend le lendemain. Il peut arriver que la contrepartie A omette de restituer le titre le lendemain. En pareil cas, la convention-cadre générale de pension sur titres peut prévoir une modification des modalités, les contreparties peuvent négocier une modification des modalités ou les contreparties peuvent résilier la convention. Si les modalités sont modifiées par fixation d'une nouvelle date d'échéance, la déclaration d'échec de la pension sur titres doit comprendre une date d'échéance modifiée. Si la convention de pension sur titres est résiliée, le contrat doit simplement être déclaré par la mention « Échec », sans être modifié. Tout paiement supplémentaire exigé par suite de l'échec ne doit pas être déclaré (il n'existe pas de champ à cet effet).

8. Attestation et gestion du changement

Les courtiers membres déclarants et leurs mandataires autorisés sont tenus d'attester leur capacité de transmettre les fichiers d'opérations au moyen du SEROM 2.0, conformément aux spécifications de message de celui-ci. Pour plus de détails au sujet de la procédure d'attestation, se reporter au Guide d'adhésion et d'attestation pour le SEROM 2.0.

8.1. Demandes de modification de la part de l'OCRCVM

Il peut arriver que l'OCRCVM apporte des modifications à ses exigences en matière de déclaration d'opérations sur titres de créance qui exigent un travail de développement ou une nouvelle attestation de la part des courtiers membres déclarants et de leurs mandataires autorisés. L'OCRCVM consultera les parties au sujet de toute modification proposée et les avisera suffisamment de temps (pas moins de 90 jours) à l'avance pour leur permettre de procéder à ce travail de développement ou à cette nouvelle attestation. Les modifications apportées à la Règle 2800C seront soumises aux protocoles habituels de modification de règles.

8.2. Demandes de modification de la part des courtiers membres

Les courtiers membres doivent communiquer avec l'OCRCVM avant d'apporter des modifications susceptibles d'avoir une incidence sur la déclaration des opérations sur titres de créance au moyen du

SEROM 2.0 afin que l'OCRCVM puisse évaluer cette incidence et déterminer si une nouvelle attestation est requise. Ces modifications peuvent notamment consister à ajouter ou supprimer un mandataire autorisé, à ajouter ou supprimer une entité déclarante ou à modifier la méthode de transmission des fichiers à l'OCRCVM.

9. Renseignements concernant le soutien

Le courtier membre doit communiquer avec le Service des opérations de l'OCRCVM avant 17 h (HNE) pour signaler les problèmes techniques liés à la transmission d'un fichier d'opérations à l'OCRCVM par le courtier membre ou son mandataire autorisé. Le courtier membre doit communiquer avec la Surveillance des marchés des titres de créance de l'OCRCVM pour signaler des changements dans les renseignements concernant l'adhésion ou la transmission tardive d'un fichier d'opérations par le courtier membre ou son mandataire autorisé.

Le soutien est offert du lundi au vendredi de 9 h à 17 h (HNE), sauf les jours fériés. Tout problème signalé en dehors des heures normales de soutien est traité par ordre de priorité lorsque les heures normales de soutien reprennent.

Les coordonnées des groupes de soutien figurent ci-dessous :

Tableau 5 : Coordonnées des groupes de soutien

Groupe de soutien	Adresse de courriel	Numéro de téléphone
Service des opérations de l'OCRCVM	smonitoring@iiroc.ca	416-362-4472
Surveillance des marchés des titres de créance de l'OCRCVM	Debtsurveillance@iiroc.ca	416-943-5861

10. Système de déclaration des opérations SEROM 2.0

Le système de déclaration des opérations SEROM 2.0 offre un portail Web sécurisé pour la transmission des fichiers d'opérations à l'OCRCVM et l'accès aux rapports et autres renseignements. Les fichiers d'opérations peuvent être transmis automatiquement par le protocole SFTP (*Secure File Transfer Protocol*) ou par téléchargement manuel en amont à l'aide d'un gabarit Excel sur le portail Web. Chaque courtier membre possède son propre répertoire dans le système de déclaration. Les courtiers membres disposent d'une fonctionnalité de téléchargement en amont et en aval pour transmettre leurs fichiers d'opérations quotidiens et pour récupérer les données de référence sur les identifiants pour entités et les relevés.

Pour plus de détails, se reporter au Guide du système de déclaration des opérations SEROM 2.0.

11. ANNEXES

11.1. Annexe A – Spécifications de message des fichiers d'opérations du SEROM 2.0 – Opérations sur titres de créance

- Tous les fichiers doivent être envoyés dans l'ordre indiqué au tableau 6 ci-dessous.
- Le champ est requis (« R ») ou requis à titre conditionnel (« RC »), selon le type d'opération. « F » indique un champ facultatif.

Tableau 6 : Spécifications de message des fichiers d'opérations – Opérations sur titres de créance

N°	Champ de données	Nom du champ	Requis?	Type/format de champ	Exemple de valeur d'entrée	Description
1.	SECURITY_ID	Identifiant de titre	R	Chaîne 12 caractères alphanumériques	CA12345JKLA8	Code ISIN ou numéro CUSIP attribué aux titres visés par l'opération
2.	SECURITY_ID_TYPE	Type d'identifiant de titre	R	Nombre entier 1 = numéro CUSIP 2 = code ISIN	2	Type d'identifiant soumis, code ISIN ou numéro CUSIP
3.	TRADE_ID	Identifiant d'opération	R	Chaîne 30 caractères alphanumériques « AAAAMMJJ »+« XXXX...X » Date à laquelle l'opération a été exécutée sur le marché local suivie de l'identifiant unique (valable ce jour-là pour le courtier déclarant)	2014062600007241	Identifiant unique attribué à l'opération par le courtier membre déclarant
4.	ORIG_TRADE_ID	Identifiant d'opération initiale	RC	Chaîne 30 caractères alphanumériques « AAAAMMJJ » + « XXXX...X »	2014062600000232	Indiqué dans le cas d'annulations ou de corrections d'opérations

N°	Champ de données	Nom du champ	Requis?	Type/format de champ	Exemple de valeur d'entrée	Description
5.	TRANS_TYPE	Type d'opération	R	Nombre entier 0 = nouvelle opération 1 = annulation 2 = correction	0	Indique s'il s'agit d'une nouvelle opération, d'une annulation ou d'une correction
6.	EXECUTION_DATE	Date d'exécution	R	Chaîne 8 chiffres AAAAMMJJ	20140626	Jour civil au cours duquel l'opération a été exécutée
7.	EXECUTION_TIME	Heure d'exécution	R	HH:MM:SS 8 caractères alphanumériques Selon l'heure normale de l'Est Si les secondes ne sont pas connues, indiquer « 00 ».	14:27:51	Heure à laquelle l'opération a été exécutée, soit celle inscrite par un système de négociation électronique, soit celle inscrite dans un système d'inscription d'opérations
8.	SETTLEMENT_DATE	Date de règlement	R	Chaîne 8 chiffres AAAAMMJJ	20140701	Date déclarée pour le règlement de l'opération
9	TRADER_ID	Identifiant du négociateur	R	Chaîne 30 caractères alphanumériques	JOHNSMITH	Attribué par le courtier membre déclarant pour identifier la personne physique ou le pupitre chargé de l'opération
10.	REPORTING DEALER_ID	Identifiant du courtier déclarant	R	Chaîne 20 caractères alphanumériques	001GPB6A9XPE8XJCC14	LEI du courtier membre déclarant
11.	COUNTERPARTY_TYPE	Type de contrepartie	R	Nombre entier 1 = client 2 = non-client 3 = courtier 4 = CIEO 5 = SNP 6 = banque 7 = émetteur	2	Indique si la contrepartie est un client, un non-client, un courtier membre, un courtier membre agissant comme SNP, un CIEO, un émetteur ou une banque

N°	Champ de données	Nom du champ	Requis?	Type/format de champ	Exemple de valeur d'entrée	Description
12.	COUNTERPARTY_ID	Identifiant de contrepartie	RC	Chaîne 20 caractères alphanumériques	01370W6Ziy66KQ4J3570	LEI de la contrepartie, si la contrepartie est un courtier membre, une banque, un CIEO ou un SNP. Par opérations de banques, on entend les opérations des banques de l'annexe I et des établissements canadiens de banques de l'annexe II.
13.	CUSTOMER_ACC_TYP E	Type de compte client	RC	Nombre entier 1 = client de détail 2 = client institutionnel	2	Indique si le client est un client de détail ou un client institutionnel. Ce champ doit être rempli si le type de contrepartie est « Client ».
14.	CUSTOMER_LEI	LEI client	F	Chaîne 20 caractères alphanumériques	4RU5TT9HLL8JMW340BG5	LEI attribué au client institutionnel, le cas échéant
15.	CUSTOMER_ACCOUNT_ID	Identifiant de compte client	F	Chaîne 30 caractères alphanumériques	GXF123	Identifiant attribué par un courtier membre déclarant pour identifier le client, dans le cas où le type de contrepartie est « Client » et qu'aucun LEI de client n'est connu
16.	INTROD_CARRY	Indicateur du remisier ou du courtier chargé de comptes	R	Nombre entier 1 = remisier 2 = courtier chargé de comptes 3 = n.d.	1	Indique si le courtier membre déclarant a agi en qualité de remisier ou de courtier chargé de comptes
17.	ELECTRONIC_EXECUTION	Indicateur d'exécution électronique	R	Caractère « Y » (oui) « N » (non)	Y	Indique si l'opération a été exécutée ou facilitée au moyen d'une plateforme de négociation électronique
18.	TRADING_VENUE_ID	Identifiant de plateforme de négociation	RC	Chaîne 20 caractères alphanumériques	01370W6Ziy66KQ4J3570	LEI de la plateforme de négociation électronique ou, s'il n'est pas connu, nom de la plateforme de négociation électronique au moyen de laquelle l'opération a été exécutée
19.	SIDE	Sens	R	Nombre entier 1 = achat 2 = vente	1	Toutes les opérations doivent être déclarées du point de vue de la contrepartie.
20.	QUANTITY	Quantité	R	Nombre à virgule flottante facultative X chiffres	1000000	Valeur nominale des titres

N°	Champ de données	Nom du champ	Requis?	Type/format de champ	Exemple de valeur d'entrée	Description
21.	PRICE	Prix	R	Nombre à virgule flottante facultative [4 chiffres].[10 chiffres]	101.05	Prix auquel l'opération a été exécutée, y compris toute majoration et/ou décote et/ou commission
22.	BENCHMARK_SEC_ID	Identifiant de titre de référence	RC	Chaîne 12 caractères alphanumériques	CA98765RST43	Code ISIN ou numéro CUSIP de l'obligation utilisé comme référence pour établir le prix (le cas échéant)
23.	BENCHMARK_SEC_ID_TYPE	Type d'identifiant de titre de référence	RC	Nombre entier 1 = numéro CUSIP 2 = code ISIN	2	Type d'identifiant soumis, code ISIN ou numéro CUSIP
24.	YIELD	Rendement	R	Nombre à virgule flottante facultative (pourcentage) [3 chiffres].[10 chiffres]	2.75	Le rendement à échéance est calculé en accord avec les conventions du marché du titre transigée
25.	COMMISSION	Commission	RC	Nombre à virgule flottante facultative [X chiffres].[10 chiffres]	100.00	Commission ou majoration déclarée dans l'avis d'exécution (le cas échéant)
26.	CAPACITY	Capacité	R	Nombre entier 1 = mandataire 2 = contrepartiste	P	Indique si le courtier membre a agi comme contrepartiste ou mandataire (« opérations pour compte propre sans risques » déclarées en qualité de contrepartiste)
27.	PRIMARY_MARKET	Marché primaire	R	Caractère « Y » (oui) « N » (non)	N	Indicateur de condition spéciale servant à indiquer que l'opération est soumise par le placeur d'une nouvelle émission de titres de créance et que, au moment de l'opération, les titres étaient visés par une convention de placement à prix fixe. Les attributions « autorisées » par le chef de file au profit des syndicaux sont comprises dans cette désignation, ainsi que les attributions aux clients par un membre du groupe de placement visé par une convention de placement à prix fixe à la date de l'opération
28.	RELATED_PTY	Indicateur de partie liée	R	Caractère « Y » (oui) « N » (non)	N	Indicateur de condition spéciale servant à indiquer que la contrepartie est un membre du même groupe que le courtier membre

N°	Champ de données	Nom du champ	Requis?	Type/format de champ	Exemple de valeur d'entrée	Description
29.	NON_RESIDENT	Non-résident	R	Caractère « Y » (oui) « N » (non)	N	Indicateur de condition spéciale servant à indiquer que l'opération est effectuée avec une contrepartie non résidente
30.	FEE_BASED_ACCOUNT	Indicateur de compte à honoraires	R	Caractère « Y » (oui) « N » (non)	Y	Indicateur de condition spéciale servant à indiquer que l'opération vise un compte de client de détail qui verse au courtier membre des honoraires non fondés sur les opérations comme rémunération partielle ou intégrale des services d'exécution d'opérations que le courtier membre lui rend

11.2. Annexe B – Spécifications de message des fichiers d'opérations du SEROM 2.0 – Opérations de pension sur titres

Tous les fichiers doivent être envoyés dans l'ordre indiqué au tableau 7 ci-dessous.

Tableau 7 : Spécifications de message des fichiers d'opérations – Opérations de pension sur titres

N°	Champ de données	Nom du champ	Requis?	Type/format de champ	Exemple de valeur d'entrée	Description
1.	REPO_AGREEMENT_ID	Identifiant de la convention de pension sur titres	R	Chaîne 30 caractères alphanumériques « AAAAMMJ » + « XXXX...X » Date à laquelle l'opération a été exécutée sur le marché local suivie de l'identifiant unique (valable ce jour-là pour le courtier déclarant)	2014062600007241	Identifiant unique attribué à l'opération de pension sur titres par le courtier membre déclarant
2.	ORIG_REPO_ID	Identifiant de pension sur titres initiale	RC	Chaîne 30 caractères alphanumériques « AAAAMMJ » + « XXXX...X »	2014062600000232	Indiqué dans le cas d'annulations ou de corrections de pensions sur titres
3.	TRANS_TYPE	Type d'opération	R	Nombre entier 0 = nouvelle pension sur titres 1 = annulation 2 = correction 3 = mise à jour 4 = échec	0	Indique s'il s'agit d'une nouvelle pension sur titres, d'une annulation, d'une correction, d'une mise à jour ou d'un échec ⁹

⁹ Si les modalités d'une pension sur titres ayant une durée ouverte sont mises à jour, par exemple si le taux est modifié, les nouvelles modalités doivent être déclarées comme mise à jour. Si l'une ou l'autre des contreparties omet d'honorer la convention, l'omission doit être déclarée comme échec et la déclaration doit comprendre les nouvelles modalités, par exemple la nouvelle date d'échéance.

N°	Champ de données	Nom du champ	Requis?	Type/format de champ	Exemple de valeur d'entrée	Description
4.	AGREEMENT_DATE	Date de la convention de pension sur titres	R	Chaîne 8 chiffres AAAAMMJJ	20140626	Date à laquelle la pension sur titres a été exécutée ou convenue, soit celle inscrite par un système de négociation électronique, soit celle inscrite dans un système d'inscription d'opérations
5.	AGREEMENT_TIME	Heure de la convention de pension sur titres	R	HH:MM:SS 8 caractères alphanumériques Selon l'heure normale de l'Est Si les secondes ne sont pas connues, indiquer « 00 ».	14:27:51	Heure à laquelle la pension sur titres a été exécutée ou convenue, soit celle inscrite par un système de négociation électronique, soit celle inscrite dans un système de déclaration d'opérations
6.	CLEARING_HOUSE	Chambre de compensation	RC	Chaîne 20 caractères alphanumériques	001GPB6A9XPE8XJICC14	Si une chambre de compensation centrale a compensé la pension sur titres, LEI de cette chambre de compensation centrale
7.	TRADER_ID	Identifiant du négociateur	R	Chaîne 30 caractères alphanumériques	JSMITH REPO01TOR	Attribué par le courtier membre déclarant pour identifier la personne physique ou le pupitre chargé de l'opération de pension sur titres
8.	REPO_TYPE	Type de pension sur titres	R	Nombre entier 1 = mise en pension 2 = prise en pension 3 = vente-rachat 4 = achat-rétrocession	2	Indique si l'opération a été exécutée dans le cadre d'une mise en pension, d'une prise en pension, d'une vente-rachat ou d'un achat-rétrocession
9.	REPO_TERM	Durée de la pension sur titres	R	Nombre entier 1 = durée fixe 2 = durée ouverte	1	Indique si la pension sur titres a une durée fixe ou ouverte
10.	REPO_MAT_DATE	Date d'échéance de la pension sur titres (si la durée est fixe)	RC	Chaîne 8 chiffres AAAAMMJJ	20140627	Date d'échéance (date du deuxième volet) dans le cas de pension sur titres à durée fixe. Si la pension sur titres a une durée ouverte, ne rien inscrire.

N°	Champ de données	Nom du champ	Requis?	Type/format de champ	Exemple de valeur d'entrée	Description
11.	SETTLEMENT_DATE	Date de règlement de la pension sur titres	R	Chaîne 8 chiffres AAAAMMJJ	20140626	Date de règlement de la pension sur titres (date du premier volet)
12.	REPORTING DEALER_ID	Identifiant du courtier déclarant	R	Chaîne 20 caractères alphanumériques	001GPB6A9XPE8XJICC14	LEI du courtier membre déclarant
13.	COUNTERPARTY_TYPE	Type de contrepartie	R	Nombre entier 1 = client 2 = non-client 3 = courtier 4 = CIEO 5 = SNP 6 = banque	2	Indique si la contrepartie est un client, un courtier membre, un courtier membre agissant comme SNP, un CIEO ou une banque
14.	COUNTERPARTY_ID	Identifiant de la contrepartie	RC	Chaîne 20 caractères alphanumériques	01370W6ZIY66KQ4J3570	LEI de la contrepartie, si la contrepartie est un courtier membre, une banque, un CIEO ou un SNP. Par opérations de banques, on entend les opérations des banques de l'annexe I et des établissements canadiens de banques de l'annexe II.
15.	CUSTOMER_ACCOUNT_TYPE	Type de compte client	RC	Nombre entier 1 = client de détail 2 = client institutionnel	2	Indique si le client est un client de détail ou un client institutionnel. Ce champ doit être rempli si le type de contrepartie est « Client ».
16.	CUSTOMER_LEI	LEI client	F	Chaîne 20 caractères alphanumériques	4RU5TT9HLL8JMW340BG5	LEI attribué au client institutionnel, le cas échéant
17.	CUSTOMER_ACCOUNT_ID	Identifiant de compte client	F	Chaîne 30 caractères alphanumériques	GXF123	Identifiant attribué par un courtier membre déclarant pour identifier le client, dans le cas où le type de contrepartie est « Client » et qu'aucun LEI de client n'est connu

N°	Champ de données	Nom du champ	Requis?	Type/format de champ	Exemple de valeur d'entrée	Description
18.	ELECTRONIC_EXECUTION	Indicateur d'exécution électronique	R	Caractère « Y » (oui) « N » (non)	Y	Indique si la pension sur titres a été exécutée ou facilitée au moyen d'une plateforme de négociation électronique
19.	TRADING_VENUE_ID	Identifiant de plateforme de négociation	RC	Chaîne 20 caractères alphanumériques	01370W6Z1Y66KQ4J3570	LEI de la plateforme de négociation électronique ou, s'il n'est pas connu, le nom de la plateforme de négociation électronique au moyen de laquelle l'opération a été exécutée
20.	QUANTITY	Quantité	R	Nombre à virgule flottante facultative X chiffres	1000000	Valeur nominale de la garantie
21.	PRICE	Prix	R	Nombre à virgule flottante facultative [4 chiffres].[10 chiffres]	101.05	Prix auquel l'achat initial du titre visé par la convention de pension de titres a été exécuté, y compris toute majoration et/ou décote
22.	REPO_CURRENCY	Monnaie de pension sur titres	R	Chaîne 3 caractères alphanumériques	USD	Libellé de la monnaie du paiement au comptant utilisé pour l'achat initial du titre dans une convention de pension de titres
23.	REPO_RATE	Taux de pension sur titres	R	Nombre à virgule flottante facultative (pourcentage) [3 chiffres].[10 chiffres] ou chaîne	0.0500	Taux d'intérêt de la pension sur titres. Si le taux d'intérêt n'a pas été fixé dans le contrat, il s'agit du taux d'intérêt implicite que représente l'écart entre le prix de vente (d'achat) et son prix de rachat (de rétrocession).
24.	REPO_HAIRCUT	Décote de pension sur titres	R	Nombre à virgule flottante facultative (pourcentage) [3 chiffres].[10 chiffres]	3.000	Décote de la pension sur titres. Si la décote n'a pas été établie dans le contrat, il s'agit de la décote implicite que représente la disparité entre le prix d'achat et la valeur marchande du titre à la date de l'achat initial.
25.	REPO_CSI_TYPE	Type de garantie de pension sur titres	R	Nombre entier 1 = numéro CUSIP 2 = code ISIN 3 = plusieurs titres 4 = garantie générale	1	Indique le type de l'identifiant soumis, code ISIN ou numéro CUSIP, ou si la pension sur titres sert de garantie générale ou porte sur plusieurs titres
26.	REPO_CSI_ID	Identifiant de	RC	Chaîne	CA98765RST43	Code ISIN ou numéro CUSIP du titre sous-

N°	Champ de données	Nom du champ	Requis?	Type/format de champ	Exemple de valeur d'entrée	Description
		garantie de pension sur titres		12 caractères alphanumériques		jaient à la convention de pension sur titres au début de la convention, si un seul titre sert de garantie
27.	RELATED_PTY	Indicateur de partie liée	R	Caractère « Y » (oui) « N » (non)	N	Indicateur de condition spéciale servant à indiquer que la contrepartie est un membre du même groupe que le courtier membre
28.	NON_RESIDENT	Non-résident	R	Caractère « Y » (oui) « N » (non)	N	Indicateur de condition spéciale servant à indiquer que l'opération est effectuée avec une contrepartie non résidente

11.3. Annexe C – Exemples d'opérations sur titres de créance

Nota : Toutes les opérations doivent être déclarées du point de vue de la contrepartie.

Figure 1 : Courtier déclarant agissant comme contrepartiste

	<p>1. Le courtier membre déclarant vend pour 1 million de dollars d'obligations à 3,7 % de la ville de Saskatoon échéant le 27 novembre 2023 à un client institutionnel canadien. Le courtier agit comme contrepartiste.</p> <p>a) Une déclaration d'opérations est exigée.</p>
<div data-bbox="250 632 475 730" style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-bottom: 20px;"> <p>Courtier déclarant</p> </div> <div data-bbox="250 1591 475 1671" style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>Client institutionnel canadien</p> </div>	<p>1-Security_ID=CA80383BQJ66 2-Security_ID_Type=2 [ISIN] 3-Trade_ID=2013111212345678 4-Orig_Trade_ID= 5-Trans_Type=0 [nouvelle opération] 6-Execution_Date=2013112 7-Execution_Time=14:27:51 8-Settlement_Date=20131118 9-Trader_ID=GeneSimmons 10-Reporting_Dealer_ID=13IEWX0W7C3RVXNMNW50 11-Counterparty_Type=1 [client] 12-Counterparty_ID= 13-Customer_Acc_Type=2 [institutionnel] 14-Customer_LEI=13IEWX0W7C3RVXNMNZ25 [facultatif] 15-Customer_Account_ID= 16-Intro_Carry=3 [n. d.] 17-Electronic_Execution=N 18-Trading_Venue_ID= 19-Side=1 [achat] 20-Quantity=1000000 21-Price=98.80 22-Benchmark_Sec_ID=CA135087A610 23-Benchmark_Sec_ID_Type=2 [ISIN] 24-Yield=3.84 25-Commission= 26-Capacity=2 27-Primary Market=N 28-Related Party=N 29-Non-resident=N 30-Fee-based Account=N</p> <p>Aucune déclaration d'opérations n'est exigée.</p>

Figure 2 : Courtier déclarant négociant sur une plateforme électronique

	<p>2. Le courtier membre déclarant vend pour 10 millions de dollars d'obligations de Société ABC à un client institutionnel canadien sur MarketAxess.</p> <p>a) Une déclaration d'opérations est exigée.</p>
<div data-bbox="250 436 477 533" style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-bottom: 20px;"> <p>Courtier déclarant</p> </div> <div data-bbox="250 1402 477 1482" style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>Client institutionnel canadien</p> </div>	<p>1-Security_ID= CA80383BQJ66 2-Security_ID_Type=2 [ISIN] 3-Trade_ID=2013111212345678 4-Orig_Trade_ID= 5-Trans_Type=0 [nouvelle opération] 6-Execution_Date=20131112 7-Execution_Time=14:27:51 8-Settlement_Date=20131118 9-Trader_ID= GeneSimmons 10-Reporting_Dealer_ID=13IEWX0W7C3RVXNMNW50 11-Counterparty_Type=1 [client] 12-Counterparty_ID= 13-Customer_Acc_Type=2 [institutionnel] 14-Customer_LEI=13IEWX0W7C3RVXNMNZ25 [facultatif] 15-Customer_Account_ID= 16-Introd_Carry=3 [n. d.] 17-Electronic_Execution=Y 18-Trading_Venue_ID= GPSMMRI21JE7ZCVYF972 19-Side=1 [achat] 20-Quantity=1000000 21-Price=98.80 22-Benchmark_Sec_ID= CA135087A610 23-Benchmark_Sec_ID_Type=2 [ISIN] 24-Yield=3.84 25-Commission= 26-Capacity=2 27-Primary Market=N 28-Related Party=N 29-Non-resident=N 30-Fee-based Account=N</p> <p>Aucune déclaration d'opérations n'est exigée.</p>

Figure 3 : Compte à honoraires d'un client de détail

	<p>3. Le courtier membre déclarant achète pour 1 million de dollars d'obligations à 3,7 % de la ville de Saskatoon échéant le 27 novembre 2023 à un client de détail canadien.</p> <p>a) Une déclaration d'opérations est exigée.</p> <p>b) Le compte de client de détail est un compte à honoraires.</p>
<div data-bbox="250 432 475 533" style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: fit-content; margin-bottom: 20px;"> <p>Courtier déclarant</p> </div> <div data-bbox="250 1415 475 1495" style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: fit-content;"> <p>Client de détail</p> </div>	<p>1-Security_ID= CA80383BQJ66 2-Security_ID_Type=2 [isin] 3-Trade_ID=2013111212345678 4-Orig_Trade_ID= 5-Trans_Type=0 [nouvelle opération] 6-Execution_Date=20131112 7-Execution_Time=14:27:51 8-Settlement_Date=20131118 9-Trader_ID=BobDylan 10-Reporting_Dealer_ID=13IEWXOW7C3RVXNMNW50 11-Counterparty_Type=1 [client] 12-Counterparty_ID= 13-Customer_Acc_Type=1 [détail] 14-Customer_LEI= 15-Customer_Account_ID= RRSP1234 [facultatif] 16-Introd_Carry=3 [n. d.] 17-Electronic_Execution=Y 18-Trading_Venue_ID= GPSMMRI21JE7ZCVYF972 19-Side=2 [vente] 20-Quantity=1000000 21-Price=98.80 22-Benchmark_Sec_ID= CA135087A610 23-Benchmark_Sec_ID_Type=2 [ISIN] 24-Yield=3.84 25-Commission= 26-Capacity=2 27-Primary_Market=N 28-Related_Party=N 29-Non-resident=N 30-Fee-based Account=Y</p> <p>Aucune déclaration d'opérations n'est exigée.</p>

Figure 4 : Opération entre deux courtiers déclarants

	<p>4. Le courtier membre déclarant A achète pour 2 millions de dollars d'obligations à 1,75 % du gouvernement du Canada échéant le 1^{er} mars 2019 au courtier membre déclarant B.</p> <p>a) Deux déclarations d'opérations sont exigées [une pour chaque courtier].</p>
<div data-bbox="250 401 475 501" style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: fit-content; margin-bottom: 20px;"> <p>Courtier déclarant A</p> </div> <div data-bbox="250 1539 475 1619" style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: fit-content;"> <p>Courtier déclarant B</p> </div>	<p>1-Security_ID=CA135087B86 2-Security_ID_Type=2 [ISIN] 3-Trade_ID=2014062312345678 4-Orig_Trade_ID= 5-Trans_Type=0 [nouvelle opération] 6-Execution_Date=20140623 7-Execution_Time=14:27:51 8-Settlement_Date=20140626 9-Trader_ID=GordonSumner 10-Reporting_Dealer_ID=13IEWX0W7C3RVXNMNW50 11-Counterparty_Type=3 [courtier] 12-Counterparty_ID=PT3QB789TSUIDF371261 13-Customer_Acc_Type= 14-Customer_LEI= 15-Customer_Account_ID= 16-Introd_Carry=3 [n. d.] 17-Electronic_Execution=N 18-Trading_Venue_ID= 19-Side=2 [vente] 20-Quantity=2000000 21-Price=98.88 22-Benchmark_Sec_ID= 23-Benchmark_Sec_ID_Type= 24-Yield=3.10 25-Commission= 26-Capacity=2 27-Primary_Market=N 28-Related_Party=N 29-Non-resident=N 30-Fee-based Account=N</p> <p>1-Security_ID= CA135087B86 2-Security_ID_Type=2 [ISIN] 3-Trade_ID=2014062387654321 4-Orig_Trade_ID= 5-Trans_Type=0 [nouvelle opération] 6-Execution_Date=20140623 7-Execution_Time=14:27:51 8-Settlement_Date=20140626 9-Trader_ID=JohnBongiovi 10-Reporting_Dealer_ID= PT3QB789TSUIDF371261 11-Counterparty_Type=3 [courtier] 12-Counterparty_ID=13IEWX0W7C3RVXNMNW50 13-Customer_Acc_Type= 14-Customer_LEI= 15-Customer_Account_ID= 16-Introd_carry=3 [n. d.] 17-Electronic_Execution=N 18-Trading_Venue_ID=</p>

	19-Side=1 [achat] 20-Quantity=2000000 21-Price=98.88 22-Benchmark_Sec_ID= 23-Benchmark_Sec_ID_Type= 24-Yield=3.10 25-Commission= 26-Capacity=2 27-Primary Market=N 28-Related Party=N 29-Non-resident=N 30-Fee-based Account=N
--	---

Figure 5 : Opération entre le courtier et une partie liée

	<p>5. Le courtier membre déclarant (pupitre de Toronto) achète pour 2 millions de dollars d'obligations à 1,75 % du gouvernement du Canada échéant le 1^{er} mars 2019 à son pupitre de Londres.</p> <p>a) Une déclaration d'opérations est exigée.</p> <p>b) Il y a eu changement de propriété véritable.</p>
<p>Courtier déclarant [pupitre de Toronto]</p> <p>Courtier déclarant [pupitre de Londres]</p>	<p>1-Security_ID= CA135087B86 2-Security_ID_Type=2 [ISIN] 3-Trade_ID=2014062312345678 4-Orig_Trade_ID= 5-Trans_Type=0 [nouvelle opération] 6-Execution_Date=20140623 7-Execution_Time=14:27:51 8-Settlement_Date=20140626 9-Trader_ID=BillyGibbons 10-Reporting_Dealer_ID=13IEWXOW7C3RVXNMNW50 11-Counterparty_Type=1 [client] 12-Counterparty_ID=PT3QB789TSUIDF371261 13-Customer_Acc_Type= 2 [institutionnel] 14-Customer_LEI= 15-Customer_Account_ID= 16-Intro_Carry=3 [n. d.] 17-Electronic_Execution=N 18-Trading_Venue_ID= 19-Side=2 [vente] 20-Quantity=2000000 21-Price=98.88 22-Benchmark_Sec_ID= 23-Benchmark_Sec_ID_Type= 24-Yield=3.10 25-Commission= 26-Capacity=2 27-Primary Market=N 28-Related Party=Y 29-Non-resident=Y 30-Fee-based Account=N</p> <p>Aucune déclaration d'opérations n'est exigée.</p>

Figure 6 : Opération entre le courtier et une entité étrangère

	<p>6. Le courtier membre déclarant (pupitre de Toronto) achète pour 2 millions de dollars d'obligations à 1,75 % du gouvernement du Canada échéant le 1^{er} mars 2019 à un client institutionnel situé en Suisse.</p> <p>a) Une déclaration d'opérations est exigée.</p>
<div data-bbox="224 436 474 533" style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-bottom: 10px;"> <p>Courtier déclarant [pupitre de Toronto]</p> </div> <div data-bbox="250 1453 474 1537" style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>Client suisse</p> </div>	<p>1-Security_ID= CA135087B86 2-Security_ID_Type=2 [ISIN] 3-Trade_ID=2014062312345678 4-Orig_Trade_ID= 5-Trans_Type=0 [nouvelle opération] 6-Execution_Date=20140623 7-Execution_Time=14:27:51 8-Settlement_Date=20140626 9-Trader_ID=BillyGibbons 10-Reporting_Dealer_ID=13IEWX0W7C3RVXNMNW50 11-Counterparty_Type=1 [client] 12-Counterparty_ID= 13-Customer_Acc_Type=2 [institutionnel] 14-Customer LEI=13IEWX0W7C3RVXNMNZ25 [facultatif] 15-Customer_Account_ID= 16-Introd_Carry=3 [n. d.] 17-Electronic_Execution=N 18-Trading_Venue_ID= 19-Side=2 [vente] 20-Quantity=2000000 21-Price=98.88 22-Benchmark_Sec_ID= 23-Benchmark_Sec_ID_Type= 24-Yield=3.10 25-Commission= 26-Capacity=2 27-Primary Market=N 28-Related Party=N 29-Non-resident=Y 30-Fee-based Account=N</p> <p>Aucune déclaration d'opérations n'est exigée.</p>

Figure 7: Opération entre deux courtiers réalisée par l'intermédiaire d'un CIEO

	<p>7. Le courtier membre déclarant A vend pour 5 millions de dollars d'obligations à 1,5 % du gouvernement du Canada échéant le 1^{er} juin 2023 par voie électronique à partir de la plateforme de négociation d'un CIEO. Le courtier déclarant B est situé de l'autre côté de l'opération.</p> <p>a) Deux déclarations d'opérations sont exigées.</p>
<div data-bbox="245 401 475 489" style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-bottom: 20px;"> <p>Courtier déclarant A</p> </div> <div data-bbox="253 1575 475 1654" style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>Courtier déclarant B</p> </div>	<p>1-Security_ID=CA135087A610 2-Security_ID_Type=2 [ISIN] 3-Trade_ID=20140623009988 4-Orig_Trade_ID= 5-Trans_Type=0 [nouvelle opération] 6-Execution_Date=20140623 7-Execution_Time=14:27:51 8-Settlement_Date=20140626 9-Trader_ID=DustyHill 10-Reporting_Dealer_ID=13IEWX0W7C3RVXNMNW50 11-Counterparty_Type=4 [CIEO] 12-Counterparty_ID=NJ73YDRBTUDR8UZ9UZ22 13-Customer_Acc_Type= 14-Customer_LEI= 15-Customer_Account_ID= 16-Introd_Carry=3 [n. d.] 17-Electronic_Execution=Y 18-Trading_Venue_ID=NJ73YDRBTUDR8UZ9UZ22 19-Side=1 [achat] 20-Quantity=5000000 21-Price=99.50 22-Benchmark_Sec_ID= 23-Benchmark_Sec_ID_Type= 24-Yield=3.05 25-Commission= 26-Capacity=2 27-Primary Market=N 28-Related Party=N 29-Non-resident=N 30-Fee-based Account=N</p> <p>1-Security_ID=CA135087A610 2-Security_ID_Type=2 [ISIN] 3-Trade_ID=20140623009988 4-Orig_Trade_ID= 5-Trans_Type=0 [nouvelle opération] 6-Execution_Date=20140623 7-Execution_Time=14:27:51 8-Settlement_Date=20140626 9-Trader_ID=NeilYoung 10-Reporting_Dealer_ID=PT3QB789TSUIDF371261 11-Counterparty_type=4 [CIEO] 12-Counterparty_ID=NJ73YDRBTUDR8UZ9UZ22 13-Customer_Acc_Type= 14-Customer_LEI= 15-Customer_Account_ID= 16-Introd_carry=3 [n. d.] 17-Electronic_Execution=Y</p>

<div data-bbox="241 627 467 697" style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: fit-content; margin: auto;">CIEO</div>	<p>18-Trading_Venue_ID=NJ73YDRBTUDR8UZ9UZ22 19-Side=2 [vente] 20-Quantity=5000000 21-Price=99.50 22-Benchmark_Sec_ID= 23-Benchmark_Sec_ID_Type= 24-Yield=3.05 25-Commission= 26-Capacity=2 27-Primary Market=N 28-Related Party=N 29-Non-resident=N 30-Fee-based Account=N</p> <p>Aucune déclaration d'opérations n'est exigée.</p>
--	--

Figure 8 : Opération entre le courtier et une banque

	<p>8. Le courtier membre déclarant achète pour 1 million de dollars d'obligations à 3,7 % de la ville de Saskatoon échéant le 27 novembre 2023 à une banque de l'annexe I. Le courtier agit comme contrepartiste.</p> <p>a) Une déclaration d'opérations est exigée.</p>
<div data-bbox="250 436 477 537" style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: fit-content; margin-bottom: 20px;"> <p>Courtier déclarant</p> </div> <div data-bbox="250 1409 477 1491" style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: fit-content;"> <p>Banque de l'annexe 1</p> </div>	<p>1-Security_ID=CA80383BQJ66 2-Security_ID_Type=2 [ISIN] 3-Trade_ID=2014062311223344 4-Orig_Trade_ID= 5-Trans_Type=0 [nouvelle opération] 6-Execution_Date=20140623 7-Execution_Time=14:27:51 8-Settlement_Date=20140626 9-Trader_ID=BarryWhite 10-Reporting_Dealer_ID=13IEWX0W7C3RVXNMNW50 11-Counterparty_Type=6 [banque] 12-Counterparty_ID=5493001ECI4NJPXI5P10 13-Customer_Acc_Type= 14-Customer_LEI= 15-Customer_Account_ID= 16-Introd_Carry=3 [n. d.] 17-Electronic_Execution=N 18-Trading_Venue_ID= 19-Side=2 [vente] 20-Quantity=1000000 21-Price=98.80 22-Benchmark_Sec_ID=CA135087A610 23-Benchmark_Sec_ID_Type=2 [ISIN] 24-Yield=3.40 25-Commission= 26-Capacity=2 27-Primary Market=N 28-Related Party=N 29-Non-resident=N 30-Fee-based Account=N</p> <p>Aucune déclaration d'opérations n'est exigée.</p>

Figure 9 : Remisier-courtier chargé de comptes

	<p>9. Le courtier membre déclarant B achète pour 4 millions de dollars d'obligations à 1,75 % du gouvernement du Canada échéant le 1^{er} mars 2019 à un client de détail et transmet l'opération à un courtier chargé de comptes, le courtier A.</p> <p>a) Deux déclarations d'opérations sont exigées.</p>
<p>Courtier déclarant B [remisier]</p>	<p>1-Security_ID=CA80383BQJ66 2-Security_ID_Type=2 [ISIN] 3-Trade_ID=2014062311223344 4-Orig_Trade_ID= 5-Trans_Type=0 [nouvelle opération] 6-Execution_Date=20140623 7-Execution_Time=14:27:51 8-Settlement_Date=20140626 9-Trader_ID=PatBenater 10-Reporting_Dealer_ID=13IEWX0W7C3RVXNMNW50 11-Counterparty_Type=1 [client] 12-Counterparty_ID=PT3QB789TSUIDF371261 13-Customer_Acc_Type=1 [détail] 14-Customer_LEI= 15-Customer_Acc_ID=JS1234 [facultatif] 16-Introd_Carry=1 [remisier] 17-Electronic_Execution=N 18-Trading_Venue_ID= 19-Side=2 [vente] 20-Quantity=4000000 21-Price=98.50 22-Benchmark_Sec_ID= 23-Benchmark_Sec_ID_Type= 24-Yield=3.10 25-Commission=0.30 26-Capacity=1 27-Primary Market=N 28-Related Party=N 29-Non-resident=N 30-Fee-based Account=N</p> <p>1-Security_ID=CA80383BQJ66 2-Security_ID_Type=2 [ISIN] 3-Trade_ID=2014062311223344 4-Orig_Trade_ID= 5-Trans_Type=0 [nouvelle opération] 6-Execution_Date=20140623 7-Execution_Time=14:27:51 8-Settlement_Date=20140626 9-Trader_ID=MichaelBuble 10-Reporting_Dealer_ID=5493001ECI4NJPXI5P10 11-Counterparty_Type=3 [courtier] 12-Counterparty_ID=13IEWX0W7C3RVXNMNW50 13-Customer_Acc_Type= 14-Customer_LEI= 15-Customer_Account_ID= 16-Introd_Carry=2 [courtier chargé de comptes] 17-Electronic_execution=N</p>
<p>Courtier déclarant A [chargé de comptes]</p>	

	18-Trading_Venue_ID= 19-Side=2 [vente] 20-Quantity=4000000 21-Price=98.80 22-Benchmark_Sec_ID= 23-Benchmark_Sec_ID_Type= 24-Yield=3.15 25-Commission= 26-Capacity=2 27-Primary Market=N 28-Related Party=N 29-Non-resident=N 30-Fee-based Account=N
--	---

Figure 10 : Courtier chef de file – Nouvelle émission

	<p>10. Le courtier membre (chef de file) déclarant acquiert dans un compte de stocks pour 2 milliards de dollars d'obligations de l'émetteur dans le cadre d'un placement sur le marché primaire par acquisition ferme.</p> <p>a) Une déclaration d'opérations est exigée.</p>
<div data-bbox="251 436 475 535" style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-bottom: 20px;"> <p>Courtier déclarant</p> </div> <div data-bbox="256 1390 482 1472" style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>Émetteur</p> </div>	<p>1-Security_ID=123412341 2-Security_ID_Type=1 [CUSIP] 3-Trade_ID=2014062311223344 4-Orig_Trade_ID= 5-Trans_Type=0 [nouvelle opération] 6-Execution_Date=20140623 7-Execution_Time=14:27:51 8-Settlement_Date=20140626 9-Trader_ID=BryanAdams 10-Reporting_Dealer_ID=13IEWX0W7C3RVXNMNW50 11-Counterparty_Type=7 [émetteur] 12-Counterparty_ID= 13-Customer_Acc_Type= 14-Customer_LEI= 15-Customer_Account_ID= 16-Introd_Carry=3 [n. d.] 17-Electronic_Execution=N 18-Trading_Venue_ID= 19-Side=2 [vente] 20-Quantity=2000000000 21-Price=99.875 22-Benchmark_Sec_ID= 23-Benchmark_Sec_ID_Type= 24-Yield=3.25 25-Commission= 26-Capacity=2 27-Primary Market=Y 28-Related Party=N 29-Non-resident=N 30-Fee-based Account=N</p> <p>Aucune déclaration d'opérations n'est exigée.</p>

Figure 11 : Vente par le courtier chef de file à un syndicat

	<p>11. Le courtier membre (chef de file) déclarant A attribue pour 100 millions de dollars d'obligations au courtier membre B membre du syndicat pour qu'il les vende à ses clients finaux. a) Deux déclarations d'opérations sont exigées.</p>
<p>Courtier déclarant A</p>	<p>1-Security_ID=123412341 2-Security_ID_Type=1 [CUSIP] 3-Trade_ID=2014062311223344 4-Orig_Trade_ID= 5-Trans_Type=0 [nouvelle opération] 6-Execution_Date=20140623 7-Execution_Time=14:27:51 8-Settlement_Date=20140626 9-Trader_ID=BryanAdams 10-Reporting_Dealer_ID=13IEWX0W7C3RVXNMNW50 11-Counterparty_type=3 [courtier] 12-Counterparty_ID=PT3QB789TSUIDF371261 13-Customer_Acc_Type= 14-Customer_LEI= 15-Customer_Account_ID= 16-Introd_Carry=3 [n. d.] 17-Electronic_Execution=N 18-Trading_Venue_ID= 19-Side=1 [achat] 20-Quantity=100000000 21-Price=99.50 22-Benchmark_Sec_ID= 23-Benchmark_Sec_iID_Type= 24-Yield=3.25 25-Commission= 26-Capacity=2 27-Primary Market=Y 28-Related Party=N 29-Non-resident=N 30-Fee-based Account=N</p>
<p>Courtier déclarant B</p>	<p>1-Security_ID=123412341 2-Security_ID_Type=1 [CUSIP] 3-Trade_ID=2014062311223344 4-Orig_Trade_ID= 5-Trans_Type=0 [nouvelle opération] 6-Execution_Date=20140623 7-Execution_Time=14:27:51 8-Settlement_Date=20140626 9-Trader_ID=BryanAdams 10-Reporting_Dealer_ID= PT3QB789TSUIDF371261 11-Counterparty_Type=3 [courtier] 12-Counterparty_ID=13IEWX0W7C3RVXNMNW50 13-Customer_Acc_Type= 14-Customer_LEI= 15-Customer_Account_ID= 16-Introd_Carry=3 [n. d.]</p>

	17-Electronic_Execution=N 18-Trading_Venue_ID= 19-Side=2 [vente] 20-Quantity=100000000 21-Price=99.50 22-Benchmark_Sec_ID= 23-Benchmark_Sec_ID_Type= 24-Yield=3.25 25-Commission= 26-Capacity=2 27-Primary Market=Y 28-Related Party=N 29-Non-resident=N 30-Fee-based Account=N
--	---

Figure 12 : Vente par le courtier d'une nouvelle émission à un client institutionnel canadien

	<p>12. Le courtier membre déclarant vend pour 5 millions de dollars d'obligations provinciales nouvellement émises à un client institutionnel canadien. a) Une déclaration d'opérations est exigée.</p>
<div data-bbox="250 401 477 501" style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-bottom: 20px;"> <p>Courtier déclarant</p> </div> <div data-bbox="250 1352 477 1432" style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>Client institutionnel canadien</p> </div>	<p>1-Security_ID=123412341 2-Security_ID_Type=1 [CUSIP] 3-Trade_ID=2014062311223344 4-Orig_Trade_ID= 5-Trans_Type=0 [nouvelle opération] 6-Execution_Date=20140623 7-Execution_Time=14:27:51 8-Settlement_Date=20140626 9-Trader_ID=BryanAdams 10-Reporting_Dealer_ID=13IEWXOW7C3RVXNMNW50 11-Counterparty_Type=1 [client] 12-Counterparty_ID= 13-Customer_Acc_Type=2 [institutionnel] 14-Customer_LEI=13IEWXOW7C3RVXNMNZ25 [facultatif] 15-Customer_Account_ID= 16-Introd_Carry=3 [n. d.] 17-Electronic_Execution=N 18-Trading_Venue_ID= 19-Side=1 [achat] 20-Quantity=5000000 21-Price=99.875 22-Benchmark_Sec_ID= 23-Benchmark_Sec_ID_Type= 24-Yield=3.25 25-Commission= 26-Capacity=2 27-Primary Market=Y 28-Related Party=N 29-Non-resident=N 30-Fee-based Account=N</p> <p>Aucune déclaration d'opérations n'est exigée.</p>

Figure 13 : Opération pour compte propre sans risque

	<p>13. Le courtier membre déclarant A vend pour 4 millions de dollars d'obligations à 1,75 % du gouvernement du Canada échéant le 1^{er} mars 2019 à un client institutionnel canadien dans le cadre d'une opération pour compte propre sans risque. Le courtier déclarant A exécute un ordre identique avec le courtier déclarant B.</p> <p>a) Trois déclarations d'opérations sont exigées. Le client n'est pas tenu de produire de déclaration.</p>
<div data-bbox="250 499 477 625" style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-bottom: 20px;"> <p>Courtier déclarant A [volet client]</p> </div> <div data-bbox="250 1619 477 1703" style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>Courtier déclarant A</p> </div>	<p>1-Security_ID=CA80383BQJ66 2-Security_ID_Type=2 [ISIN] 3-Trade_ID=2014062311223344 4-Orig_Trade_ID= 5-Trans_Type=0 [nouvelle opération] 6-Execution_Date=20140623 7-Execution_Time=14:27:51 8-Settlement_Date=20140626 9-Trader_ID=PatBenater 10-Reporting_Dealer_ID=13IEWX0W7C3RVXNMNW50 11-Counterparty_Type=1 [client] 12-Counterparty_ID= 13-Customer_Acc_Type=2 [institutionnel] 14-Customer_LEI= 13IEWX0W7C3RVXNMNZ25 [facultatif] 15-Customer_Account_ID=JS1234 [facultatif] 16-Introd_Carry=3 [n. d.] 17-Electronic_Execution=N 18-Trading_Venue_ID= 19-Side=1 [achat] 20-Quantity=4000000 21-Price=98.85 22-Benchmark_Sec_ID= 23-Benchmark_Sec_ID_Type= 24-Yield=3.20 25-Commission= 26-Capacity=2 27-Primary Market=N 28-Related Party=N 29-Non-resident=N 30-Fee-based Account=N</p> <p>1-Security_ID=CA80383BQJ66 2-Security_ID_Type=2 [ISIN] 3-Trade_ID=2014062311223344 4-Orig_Trade_ID= 5-Trans_Type=0 [nouvelle opération] 6-Execution_Date=20140623 7-Execution_Time=14:27:51 8-Settlement_Date=20140626 9-Trader_ID=MichaelBuble 10-Reporting_Dealer_ID=13IEWX0W7C3RVXNMNW50 11-Counterparty_type=3 [courtier] 12-Counterparty_ID=5493001ECI4NJPXI5P10</p>

<div style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: fit-content; margin: auto;"> Courtier déclarant B </div>	<p> 13-Customer_Acc_Type= 14-Customer_LEI= 15-Customer_Account_ID= 16-Intro Carry=3 [n. d.] 17-Electronic_Execution=N 18-Trading_Venue_ID= 19-Side=2 [vente] 20-Quantity=4000000 21-Price=98.80 22-Benchmark_Sec_ID= 23-Benchmark_Sec_ID_Type= 24-Yield=3.15 25-Commission= 26-Capacity=2 27-Primary Market=N 28-Related Party=N 29-Non-resident=N 30-Fee-based Account=N </p> <p> 1-Security_ID=CA80383BQJ66 2-Security_ID_Type=2 [ISIN] 3-Trade_ID=2014062311223344 4-Orig_Trade_ID= 5-Trans_Type=0 [nouvelle opération] 6-Execution_Date=20140623 7-Execution_Time=14:27:51 8-Settlement_Date=20140626 9-Trader_ID=MichaelBuble 10-Reporting_Dealer_ID=5493001ECI4NJPXI5P10 11-Counterparty_Type=3 [courtier] 12-Counterparty_ID=13IEWX0W7C3RVXNMNW50 13-Customer_Acc_Type= 14-Customer_LEI= 15-Customer_Account_ID= 16-Intro Carry=3 [n. d.] 17-Electronic_Execution=N 18-Trading_Venue_ID= 19-Side=1 [achat] 20-Quantity=4000000 21-Price=98.80 22-Benchmark_Sec_ID= 23-Benchmark_Sec_ID_Type= 24-Yield=3.15 25-Commission= 26-Capacity=2 27-Primary Market=N 28-Related Party=N 29-Non-resident=N 30-Fee-based Account=N </p>
--	--

Figure 14 : Annulation d'opération

	<p>14. Le courtier membre déclarant vend pour 1 million de dollars d'obligations à 3,7 % de la ville de Saskatoon échéant le 27 novembre 2023 à un client institutionnel canadien. Le courtier annule l'opération après deux jours.</p> <p>a) Deux déclarations d'opérations sont exigées.</p>
<p>Opération initiale</p>	<p>1-Security_ID=CA80383BQJ66 2-Security_ID_Type=2 [ISIN] 3-Trade_ID=2013111212345678 4-Orig_Trade_ID= 5-Trans_Type = 0 [nouvelle opération] 6-Execution_Date=20131112 7-Execution_Time=14:27:51 8-Settlement_Date=20131118 9-Trader_ID=GeneSimmons 10-Reporting_Dealer_ID=13IEWXOW7C3RVXNMNW50 11-Counterparty_Type=1 [client] 12-Counterparty_ID= 13-Customer_Acc_Type=2 [institutionnel] 14-Customer_LEI=13IEWXOW7C3RVXNMNZ25 [facultatif] 15-Customer_Account_ID= 16-Introd_Carry=3 [n. d.] 17-Electronic_Execution=N 18-Trading_Venue_ID= 19-Side=1 [achat] 20-Quantity=1000000 21-Price=98.80 22-Benchmark_Sec_ID=CA135087A610 23-Benchmark_Sec_ID_Type=2 [ISIN] 24-Yield=3.84 25-Commission= 26-Capacity=2 27-Primary Market=N 28-Related Party=N 29-Non-resident=N 30-Fee-based Account=N</p>
<p>Annulation</p>	<p>1-Security_ID=CA80383BQJ66 2-Security_ID_Type=2 [ISIN] 3-Trade_ID=20131114578421 4-Orig_Trade_ID=2013111212345678 5-Trans_Type=1 [annulation] 6-Execution_Date=20131114 7-Execution_Time=09:15:37 8-Settlement_Date=20131118 9-Trader_ID=GeneSimmons 10-Reporting_Dealer_ID=13IEWXOW7C3RVXNMNW50 11-Counterparty_Type=1 [client] 12-Counterparty_ID= 13-Customer_Acc_Type=2 [institutionnel] 14-Customer_LEI=13IEWXOW7C3RVXNMNZ25 [facultatif] 15-Customer_Account_ID= 16-Introd_Carry=3 [n. d.]</p>

17-Electronic_Execution=N
18-Trading_Venue_ID=
19-Side=1 [achat]
20-Quantity=1000000
21-Price=98.80
22-Benchmark_Sec_ID=CA135087A610
23-Benchmark_Sec_ID_Type=2 [ISIN]
24-Yield=3.84
25-Commission=
26-Capacity=2
27-Primary Market=N
28-Related Party=N
29-Non-resident=N
30-Fee-based Account=N

Figure 15 : Annulation d'opération puis nouvelle opération

<p>15. Le courtier membre déclarant vend pour 1 million de dollars d'obligations à 3,7 % de la ville de Saskatoon échéant le 27 novembre 2023 à un client institutionnel canadien. Le courtier annule par la suite l'opération et la remplace par une nouvelle opération avec une contrepartie différente.</p> <p>a) Trois déclarations d'opérations sont exigées.</p>	
Opération initiale	<p>1-Security_ID=CA80383BQJ66 2-Security_ID_Type=2 [ISIN] 3-Trade_ID=2013111212345678 4-Orig_Trade_ID= 5-Trans_Type=0 [nouvelle opération] 6-Execution_Date=20131112 7-Execution_Time=14:27:51 8-Settlement_Date=20131118 9-Trader_ID=GeneSimmons 10-Reporting_Dealer_ID=13IEWX0W7C3RVXNMNW50 11-Counterparty_Type=1 [client] 12-Counterparty_ID= 13-Customer_Acc_Type=2 [institutionnel] 14-Customer_LEI=13IEWX0W7C3RVXNMNZ25 [facultatif] 15-Customer_Account_ID= 16-Introd_Carry=3 [n. d.] 17-Electronic_Execution=N 18-Trading_Venue_ID= 19-Side=1 [achat] 20-Quantity=1000000 21-Price=98.80 22-Benchmark_Sec_ID=CA135087A610 23-Benchmark_Sec_ID_Type=2 [ISIN] 24-Yield=3.84 25-Commission= 26-Capacity=2 27-Primary Market=N 28-Related Party=N 29-Non-resident=N 30-Fee-based Account=N</p>
Annulation	<p>1-Security_ID=CA80383BQJ66 2-Security_ID_Type=2 [ISIN] 3-Trade_ID=20131114578421 4-Orig_Trade_ID=2013111212345678 5-Trans_Type=1 [annulation] 6-Execution_Date=20131114 7-Execution_Time=09:15:37 8-Settlement_Date=20131118 9-Trader_ID=GeneSimmons 10-Reporting_Dealer_ID=13IEWX0W7C3RVXNMNW50 11-Counterparty_Type=1 [client] 12-Counterparty_ID= 13-Customer_Acc_Type=2 [institutionnel] 14-Customer_LEI=13IEWX0W7C3RVXNMNZ25 [facultatif] 15-Customer_Account_ID=</p>

16-Introd_Carry=3 [n. d.]
17-Electronic_Execution=N
18-Trading_Venue_ID=
19-Side=1 [achat]
20-Quantity=1000000
21-Price=98.80
22-Benchmark_Sec_ID=CA135087A610
23-Benchmark_Sec_ID_Type=2 [ISIN]
24-Yield=3.84
25-Commission=
26-Capacity=2
27-Primary Market=N
28-Related Party=N
29-Non-resident=N
30-Fee-based Account=N

1-Security_ID=CA80383BQJ66
2-Security_ID_Type=2 [ISIN]
3-Trade_ID=2013111487654321
4-Orig_Trade_ID=
5-Trans_Type=0 [nouvelle opération]
6-Execution_Date=20131112 [antidaté]
7-Execution_Time=14:27:51
8-Settlement_Date=20131118
9-Trader_ID=GeneSimmons
10-Reporting_Dealer_ID=13IEWX0W7C3RVXNMNW50
11-Counterparty_Type=1 [client]
12-Counterparty_ID=
13-Customer_Acc_Type=1 [détail]
14-Customer_LEI=
15-Customer_Account_ID=561780C [facultatif]
16-Introd_Carry=3 [n. d.]
17-Electronic_Execution=N
18-Trading_Venue_ID=
19-Side=1 [achat]
20-Quantity=1000000
21-Price=98.80
22-Benchmark_Sec_ID=CA135087A610
23-Benchmark_Sec_ID_Type=2 [ISIN]
24-Yield=3.84
25-Commission=
26-Capacity=2
27-Primary Market=N
28-Related Party=N
29-Non-resident=N
30-Fee-based Account=N

Remplacement par
une nouvelle
opération

Figure 16 : Correction d'opération

	<p>16. Le courtier membre déclarant vend pour 1 million de dollars d'obligations à 3,7 % de la ville de Saskatoon échéant le 27 novembre 2023 à un client institutionnel canadien. Le courtier corrige ensuite la quantité sur laquelle porte l'opération pour la faire passer à 2 millions de dollars.</p> <p>a) Deux déclarations d'opérations sont exigées.</p>
<p>Opération initiale</p>	<p>1-Security_ID=CA80383BQJ66 2-Security_ID_Type=2 [ISIN] 3-Trade_ID=2013111212345678 4-Orig_Trade_ID= 5-Trans_Type=0 [nouvelle opération] 6-Execution_Date=20131112 7-Execution_Time=14:27:51 8-Settlement_Date=20131118 9-Trader_ID=GeneSimmons 10-Reporting_Dealer_ID=13IEWX0W7C3RVXNMNW50 11-Counterparty_Type=1 [client] 12-Counterparty_ID= 13-Customer_Acc_Type=2 [institutionnel] 14-Customer_LEI=13IEWX0W7C3RVXNMNZ25 [facultatif] 15-Customer_Account_ID= 16-Intro_Carry=3 [n. d.] 17-Electronic_Execution=N 18-Trading_Venue_ID= 19-Side=1 [achat] 20-Quantity=1000000 21-Price=98.80 22-Benchmark_Sec_ID=CA135087A610 23-Benchmark_Sec_ID_Type=2 [ISIN] 24-Yield=3.84 25-Commission= 26-Capacity=2 27-Primary Market=N 28-Related Party=N 29-Non-resident=N 30-Fee-based Account=N</p>
<p>Correction</p>	<p>1-Security_ID=CA80383BQJ66 2-Security_ID_Type=2 [ISIN] 3-Trade_ID=20131114578421 4-Orig_Trade_ID=2013111212345678 5-Trans_Type=2 [correction] 6-Execution_Date=20131114 7-Execution_Time=09:15:37 8-Settlement_date=20131118 9-Trader_ID=GeneSimmons 10-Reporting_Dealer_ID=13IEWX0W7C3RVXNMNW50 11-Counterparty_Type=1 [client] 12-Counterparty_ID=</p>

13-Customer_Acc_Type=2 [institutionnel]
14-Customer_LEI=13IEWX0W7C3RVXNMNZ25 [facultatif]
15-Customer_Account_ID=
16-Intro_Carry=3 [n. d.]
17-Electronic_Execution=N
18-Trading_Venue_ID=
19-Side=1 [achat]
20-Quantity=2000000
21-Price=98.80
22-Benchmark_Sec_ID=CA135087A610
23-Benchmark_Sec_ID_Type=2 [ISIN]
24-Yield=3.84
25-Commission=
26-Capacity=2
27-Primary Market=N
28-Related Party=N
29-Non-resident=N
30-Fee-based Account=N

11.4. Annexe D – Exemples d'opérations de pension sur titres

Figure 17 : Conclusion par le courtier déclarant d'une opération de mise en pension à un jour assortie d'une garantie générale (titres connus) avec un client

<p>1. Le courtier membre déclarant conclut une opération de mise en pension à un jour livrée à départ immédiat, assortie d'une garantie générale de 50 M\$, avec un client institutionnel canadien. Les titres à livrer sont connus.</p> <p>a. Une déclaration est exigée.</p>	
<div style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: fit-content; margin: 0 auto;"> <p>Courtier déclarant</p> </div>	<p>1-Repo_Agreement_ID=20150126000ABC71 2-Orig_Repo_ID= 3-Trans_Type=0 [nouvelle pension sur titres] 4-Agreement_Date=20150126 5-Agreement_Time=08:27:51 6-Clearing_House= 7-Trader_ID=TH3FLASH 8-Repo_Type=1 [mise en pension] 9-Repo_Term=1 [durée fixe] 10-Repo_Mat_Date=20150127 11-Settlement_Date=20150126 12-Reporting_Dealer_ID=DF69AG6FAG76SV73KC89 13-Counterparty_Type=1 [client] 14-Counterparty_ID= 15-Customer_Acc_Type=2 [client institutionnel] 16-Customer_LEI=167DGF78AFGC92MD01LD 17-Customer_Account_ID= 18-Electronic_Execution=N 19-Trading_Venue_ID= 20-Quantity=50000000 21-Price=104.462 22-Repo_Currency=CAD 23-Repo_Rate=0.74 24-Repo_Haircut= 25-Repo_CSI_Type=4 [garantie générale] 26-Repo_CSI_ID=CA135087A610 27-Related_Party=N 28-Non-resident=N</p>

Figure 18 : Conclusion par le courtier membre déclarant d'une opération de prise en pension assortie d'une garantie générale (titres inconnus) au moyen d'un SNP avec un courtier non déclarant

<p>2. Le courtier membre déclarant conclut une opération de prise en pension à deux jours livrée à départ immédiat, assortie d'une garantie générale de 44 M\$, exécutée par voie électronique au moyen d'un SNP qui n'agit pas comme contrepartie, avec un courtier membre canadien (qui n'est pas un distributeur de titres d'État). La nature des titres reste non précisée pendant deux jours.</p> <p>a. Une déclaration est exigée.</p>	
<div style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: fit-content; margin: 0 auto;"> <p>Courtier déclarant</p> </div>	<p>1-Repo_Agreement_ID=20150115HC3L00SBDF76 2-Orig_Repo_ID= 3-Trans_Type=0 [nouvelle pension sur titres] 4-Agreement_Date=20150115 5-Agreement_Time=09:49:18 6-Clearing_House=001GPB6A9XPE8XJ 7-Trader_ID=GR33NARROW 8-Repo_Type=2 [prise en pension] 9-Repo_Term=1 [durée fixe] 10-Repo_Mat_Date=20150119 11-Settlement_Date=20150115 12-Reporting_Dealer_ID=HDAGD8DFGFA78BX3B0S2 13-Counterparty_Type=3 [courtier] 14-Counterparty_ID=AG8FGEGF7890HAFSD73JS 15-Customer_Acc_Type= 16-Customer_LEI= 17-Customer_Account_ID= 18-Electronic_Execution=Y 19-Trading_Venue_ID=ATS70687DF789G97 20-Quantity=44000000 21-Price=100.80 22-Repo_Currency=CAD 23-Repo_Rate=0.75 24-Repo_Haircut=0 25-Repo_CSI_Type=4 [garantie générale] 26-Repo_CSI_ID= 27-Related Party=N 28-Non-resident=N</p>

Figure 19 : Conclusion par le courtier déclarant d'une convention d'achat-récession d'une durée d'une semaine livrée à départ différé par l'entremise d'un CIEO avec un distributeur de titres d'État

<p>3. Le courtier membre déclarant réalise une convention d'achat-récession d'une durée d'une semaine portant sur 50 M\$ d'obligations de l'Ontario, convenue un jeudi et prenant effet le lundi suivant, exécutée par voie électronique sur la plateforme d'un CIEO qui agit comme contrepartie, avec un courtier membre qui est distributeur de titres d'État.</p> <p>a. Deux déclarations sont exigées si les parties situées des deux côtés de l'opération sont des distributeurs de titres d'État et que le CIEO sert d'intermédiaire.</p>	
<div style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: fit-content; margin: 0 auto;"> <p>Courtier déclarant A</p> </div>	<p>1-Repo_Agreement_ID=2014111300GS6SG1 2-Orig_Repo_ID= 3-Trans_Type=0 [nouvelle pension sur titres] 4-Agreement_Date=20141113 5-Agreement_Time=15:16:22 6-Clearing_House=001GPB6A9XPE8XJ 7-Trader_ID=B4TM4N 8-Repo_Type=4 [achat-récession] 9-Repo_Term=1 [durée fixe] 10-Repo_Mat_Date=20141124 11-Settlement_Date=20141117 12-Reporting_Dealer_ID=8ADH768AEG8680SSOV78 13-Counterparty_Type=4 [CIEO] 14-Counterparty_ID>IDB67AG78887AG01MAS0 15-Customer_Acc_Type= 16-Customer_LEI= 17-Customer_Account_ID= 18-Electronic_Execution=Y 19-Trading_Venue_ID>IDB67AG78887AG01MAS0 20-Quantity=50000000 21-Price=115.44 22-Repo_Currency=CAD 23-Repo_Rate=0.76 24-Repo_Haircut=0 25-Repo_CSI_Type=1 [numéro CUSIP] 26-Repo_CSI_ID=683234B98 27-Related Party=N 28-Non-resident=N</p>

<p>Courtier déclarant B</p>	<p>1-Repo_Agreement_ID=20141113000ADFG7 2-Orig_Repo_ID= 3-Trans_Type=0 [nouvelle pension sur titres] 4-Agreement_Date=20141113 5-Agreement_Time=15:16:22 6-Clearing_House= 7-Trader_ID=ROB1N 8-Repo_Type=3 [vente-rachat] 9-Repo_Term=1 [durée fixe] 10-Repo_Mat_Date=20141124 11-Settlement_Date=20141117 12-Reporting_Dealer_ID=F689DF078A6ADH9DC8N2 13-Counterparty_Type=4 [CIEO] 14-Counterparty_ID>IDB67AG78887AG01MAS0 15-Customer_Acc_Type= 16-Customer_LEI= 17-Customer_Account_ID= 18-Electronic_Execution=Y 19-Trading_Venue_ID>IDB67AG78887AG01MAS0 20-Quantity=50000000 21-Price=115.44 22-Repo_Currency=CAD 23-Repo_Rate=0.76 24-Repo_Haircut=0 25-Repo_CSI_Type=1 [numéro CUSIP] 26-Repo_CSI_ID=683234B98 27-Related Party=N 28-Non-resident=N</p>
<p>CIEO</p>	<p>Aucune déclaration d'opérations n'est exigée.</p>

Figure 20 : Conclusion par le courtier déclarant d'une opération de mise en pension à durée fixe livrée à départ différé, assortie d'une garantie générale (titres connus), avec un client étranger

<p>4. Le courtier membre déclarant conclut une opération de mise en pension d'une semaine, conclue un vendredi et prenant effet le lundi suivant, assortie d'une garantie générale de 11 M\$, avec un client étranger. Les titres à livrer sont connus.</p> <p>a. Une déclaration est exigée.</p>	
<div style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: fit-content; margin: 0 auto;"> <p>Courtier déclarant</p> </div>	<p>1-Repo_Agreement_ID=2015011600UF6A3 2-Orig_Repo_ID= 3-Trans_Type=0 [nouvelle pension sur titres] 4-Agreement_Date=20150116 5-Agreement_Time=12:43:05 6-Clearing_House= 7-Trader_ID=WOND32WOM4N 8-Repo_Type=1 [mise en pension] 9-Repo_Term=1 [durée fixe] 10-Repo_Mat_Date=20150126 11-Settlement_Date=20150119 12-Reporting_Dealer_ID=FA69ASG68GSXC0VM2LZ 13-Counterparty_Type=1 [client] 14-Counterparty_ID= 15-Customer_Acc_Type=2 [client institutionnel] 16-Customer_LEI=L7DC49AYEPOLMOHEDGER 17-Customer_Account_ID= 18-Electronic_Execution=N 19-Trading_Venue_ID= 20-Quantity=11000000 21-Price=105.28 22-Repo_Currency=CAD 23-Repo_Rate=0.76 24-Repo_Haircut=2 25-Repo_CSI_Type=4 [garantie générale] 26-Repo_CSI_ID=CA135087ZU15 27-Related Party=N 28-Non-resident=Y</p>

Figure 21 : Conclusion par le courtier déclarant d'une opération de mise en pension à taux variable à durée ouverte, assortie d'une garantie générale (titres inconnus), avec un courtier non déclarant

<p>5. Le courtier membre déclarant conclut une opération de mise en pension à taux variable assortie d'une garantie générale de 10 M\$ avec un courtier membre qui n'est pas distributeur de titres d'État.</p> <p>a. Une déclaration est exigée.</p>	
<div style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: fit-content; margin: 0 auto;"> <p>Courtier déclarant</p> </div>	<p>1-Repo_Agreement_ID=201412030013578Q 2-Orig_Repo_ID= 3-Trans_Type=0 [nouvelle pension sur titres] 4-Agreement_Date=20141203 5-Agreement_Time=10:31:57 6-Clearing_House= 7-Trader_ID=5UPERMAN 8-Repo_Type=1 [mise en pension] 9-Repo_Term=2 [durée ouverte] 10-Repo_Mat_Date= 11-Settlement_Date=20141203 12-Reporting_Dealer_ID=DBA76DF76ADF790AM2B0 13-Counterparty_Type=3 [courtier] 14-Counterparty_ID=7AG6FWE7OF8A8VAQM0S 15-Customer_Acc_Type= 16-Customer_LEI= 17-Customer_Account_ID= 18-Electronic_Execution= 19-Trading_Venue_ID= 20-Quantity=10000000 21-Price=108.37 22-Repo_Currency=CAD 23-Repo_Rate=CORRA+5bps [chaîne] 24-Repo_Haircut=0 25-Repo_CSI_Type=4 [garantie générale] 26-Repo_CSI_ID=CA135087YF56 27-Related Party=N 28-Non-resident=N</p>

Figure 22 : Clôture par le courtier déclarant d'une opération de mise en pension à durée ouverte (mise à jour)

<p>6. Déclaration de la clôture de l'opération de mise en pension à durée ouverte décrite dans le scénario 5. Les contreparties conviennent de clore l'opération le lendemain, ce qui nécessite une mise à jour de l'opération précédente.</p> <p>a. Une déclaration est exigée.</p>	
<div style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: fit-content; margin: 0 auto;"> <p>Courtier déclarant</p> </div>	<p>1-Repo_Agreement_ID=2014120800DFG78 2-Orig_Repo_ID=201412030013578Q 3-Trans_Type=3 [mise à jour] 4-Agreement_Date=20141208 5-Agreement_Time=13:15:09 6-Clearing_House= 7-Trader_ID=5UPERMAN 8-Repo_Type=1 [mise en pension] 9-Repo_Term=2 [durée ouverte] 10-Repo_Mat_Date=20141209 11-Settlement_Date=20141203 12-Reporting_Dealer_ID=DBA76DF76ADF790AM2B0 13-Counterparty_Type=3 [courtier] 14-Counterparty_ID=7AG6FWE7OF8A8VAQM0S 15-Customer_Acc_Type= 16-Customer_LEI= 17-Customer_Account_ID= 18-Electronic_Execution= 19-Trading_Venue_ID= 20-Quantity=10000000 21-Price=108.37 22-Repo_Currency=CAD 23-Repo_Rate=CORRA+5bps 24-Repo_Haircut=0 25-Repo_CSI_Type=4 [garantie générale] 26-Repo_CSI_ID=CA135087YF56 27-Related Party=N 28-Non-resident=N</p>

Figure 23 : Mise à jour par le courtier déclarant d'une opération de prise en pension assortie d'une garantie générale (titres inconnus) par l'indication des titres en question (mise à jour)

<p>7. Le courtier membre déclarant met à jour l'opération de prise en pension décrite dans le scénario 2, dans laquelle les titres à livrer étaient inconnus, en indiquant le numéro CUSIP des titres.</p> <p>b. Une déclaration est exigée.</p>	
<div style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: fit-content; margin: 0 auto;"> <p>Courtier déclarant</p> </div>	<p>1-Repo_Agreement_ID=201501178GDR823CBNQ2 2-Orig_Repo_ID=20150115HC3L00SBDF76 3-Trans_Type=3 [mise à jour] 4-Agreement_Date=20150117 5-Agreement_Time=11:13:51 6-Clearing_House=001GPB6A9XPE8XJ 7-Trader_ID=GR33NARROW 8-Repo_Type=2 [prise en pension] 9-Repo_Term=1 [durée fixe] 10-Repo_Mat_Date=20150119 11-Settlement_Date=20150115 12-Reporting_Dealer_ID=HDAGD8DFGFA78BX3B0S2 13-Counterparty_Type=3 [courtier] 14-Counterparty_ID=AG8FGEGF7890HAFSD73JS 15-Customer_Acc_Type= 16-Customer_LEI= 17-Customer_Account_ID= 18-Electronic_Execution=Y 19-Trading_Venue_ID=ATS70687DF789G97 20-Quantity=44000000 21-Price=100.80 22-Repo_Currency=CAD 23-Repo_Rate=0.75 24-Repo_Haircut=0 25-Repo_CSI_Type=4 [garantie générale] 26-Repo_CSI_ID=CA135087D275 27-Related Party=N 28-Non-resident=N</p>

Figure 24 : Modification par le courtier déclarant du taux d'une opération de mise en pension à durée ouverte (mise à jour)

<p>8. Déclaration de la mise à jour des modalités de l'opération de mise en pension décrite dans le scénario 1, la mise à jour concernant le taux (les contreparties conviennent d'appliquer un nouveau taux à partir de maintenant).</p> <p>a. Une déclaration est exigée.</p>	
<div style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: fit-content; margin: 0 auto;"> <p>Courtier déclarant</p> </div>	<p>1-Repo_Agreement_ID=20150126653QRST 2-Orig_Repo_ID=20150126000ABC71 3-Trans_Type=3 [mise à jour] 4-Agreement_Date=20150126 5-Agreement_Time=09:54:26 6-Clearing_House= 7-Trader_ID=TH3FLASH 8-Repo_Type=1 [mise en pension] 9-Repo_Term=1 [durée fixe] 10-Repo_Mat_Date=20150127 11-Settlement_Date=20150126 12-Reporting_Dealer_ID=DF69AG6FAG76SV73KC89 13-Counterparty_Type=1 [client] 14-Counterparty_ID= 15-Customer_Acc_Type=2 [client institutionnel] 16-Customer_LEI=167DGF78AFGC92MD01LD 17-Customer_Account_ID= 18-Electronic_Execution=N 19-Trading_Venue_ID= 20-Quantity=50000000 21-Price=104.462 22-Repo_Currency=CAD 23-Repo_Rate=0.76 24-Repo_Haircut= 25-Repo_CSI_Type=4 [garantie générale] 26-Repo_CSI_ID=CA135087A610 27-Related Party=N 28-Non-resident=N</p>

Figure 25 : Correction par le courtier déclarant de la quantité sur laquelle porte une opération de mise en pension à un jour conclue avec un client

<p>9. Déclaration de la correction des modalités de l'opération de mise en pension décrite dans le scénario 1, la correction concernant la quantité sur laquelle porte l'opération (valeur de la garantie) (une des contreparties a déclaré une quantité erronée et procède à une correction).</p> <p>a. Une déclaration est exigée.</p>	
<div style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: fit-content; margin: 0 auto;">Courtier déclarant</div>	<p>1-Repo_Agreement_ID=20150203Z88BNQ 2-Orig_Repo_ID=20150126000ABC71 3-Trans_Type=2 [correction] 4-Agreement_Date=20150203 5-Agreement_Time=10:15:33 6-Clearing_House= 7-Trader_ID=TH3FLASH 8-Repo_Type=1 [mise en pension] 9-Repo_Term=1 [durée fixe] 10-Repo_Mat_Date=20150127 11-Settlement_Date=20150126 12-Reporting_Dealer_ID=DF69AG6FAG76SV73KC89 13-Counterparty_Type=1 [client] 14-Counterparty_ID= 15-Customer_Acc_Type=2 [client institutionnel] 16-Customer_LEI=167DGF78AFGC92MD01LD 17-Customer_Account_ID= 18-Electronic_Execution=N 19-Trading_Venue_ID= 20-Quantity=40000000 21-Price=104.462 22-Repo_Currency=CAD 23-Repo_Rate=0.74 24-Repo_Haircut= 25-Repo_CSI_Type=4 [garantie générale] 26-Repo_CSI_ID=CA135087A610 27-Related Party=N 28-Non-resident=N</p>

Figure 26 : Annulation par le courtier d'une opération de mise en pension

10. Déclaration de l'annulation de l'opération de mise en pension décrite dans le scénario 1.	
a. Une déclaration est exigée.	
<div style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: fit-content; margin: 0 auto;">Courtier déclarant</div>	<p>1-Repo_Agreement_ID=20150127OI519S 2-Orig_Repo_ID=20150126000ABC71 3-Trans_Type=1 [annulation] 4-Agreement_Date=20150127 5-Agreement_Time=12:06:51 6-Clearing_House= 7-Trader_ID=TH3FLASH 8-Repo_Type=1 [mise en pension] 9-Repo_Term=1 [durée fixe] 10-Repo_Mat_Date=20150127 11-Settlement_Date=20150126 12-Reporting_Dealer_ID=DF69AG6FAG76SV73KC89 13-Counterparty_Type=1 [client] 14-Counterparty_ID= 15-Customer_Acc_Type=2 [client institutionnel] 16-Customer_LEI=167DGF78AFGC92MD01LD 17-Customer_Account_ID= 18-Electronic_Execution=N 19-Trading_Venue_ID= 20-Quantity=40000000 21-Price=104.462 22-Repo_Currency=CAD 23-Repo_Rate=0.74 24-Repo_Haircut= 25-Repo_CSI_Type=4 [garantie générale] 26-Repo_CSI_ID=CA135087A610 27-Related Party=N 28-Non-resident=N</p>

11.5. Annexe E – Formulaire d'adhésion au SEROM 2.0

Tableau 8 : Formulaire d'adhésion

Organisme canadien de réglementation du commerce des valeurs mobilières Adhésion des courtiers membres au SEROM 2.0

<p>Renseignements sur le courtier membre</p> <p>Nom du courtier membre : _____</p> <p>Identifiant pour entités juridiques (LEI) : _____</p> <p>Adresse : _____</p> <p>Ville : _____ Province : _____ Code postal : _____</p> <p>Personne-ressource (questions administratives)</p> <p>Nom : _____</p> <p>Téléphone : _____ Courriel : _____</p> <p>Personne-ressource (questions techniques)</p> <p>Nom : _____</p> <p>Téléphone : _____ Courriel : _____</p> <p>Renseignements sur les opérations</p> <p>Opérations de détail : <input type="checkbox"/> Oui <input type="checkbox"/> Non</p> <p>Opérations institutionnelles : <input type="checkbox"/> Oui <input type="checkbox"/> Non</p> <p>Opérations sur obligations : <input type="checkbox"/> Oui <input type="checkbox"/> Non</p> <p>Opérations sur le marché monétaire : <input type="checkbox"/> Oui <input type="checkbox"/> Non</p> <p>Opérations de pension sur titres : <input type="checkbox"/> Oui <input type="checkbox"/> Non</p> <p>Courtier chargé de comptes : <input type="checkbox"/> Oui <input type="checkbox"/> Non</p> <p>Si oui, veuillez joindre la liste des courtiers remisiers.</p> <p>Renseignements sur le mandataire autorisé</p> <p>Nom du mandataire autorisé : _____</p> <p>Personne-ressource : _____</p> <p>Téléphone : _____ Courriel : _____</p> <p>Veuillez joindre la liste des mandataires autorisés supplémentaires le cas échéant.</p> <p>Autorisation du courtier membre</p> <p>Nom : _____</p> <p>Titre : _____</p> <p>Signature : _____</p> <p>Téléphone : _____ Courriel : _____</p>
--

11.6. Annexe F – Identifiants pour entités juridiques (LEI) – Renseignements et inscription

Les LEI ne peuvent être obtenus qu'après qu'une unité d'exploitation locale (UEL) avalidée par le Comité de surveillance réglementaire (CSR) du Système d'identifiant international pour les entités juridiques. La liste des UEL approuvées par le CSR et leurs coordonnées figurent à l'adresse http://www.leiroc.org/publications/gls/lou_20131003_2.pdf.

Chaque UEL a son propre processus d'émission des LEI mais, en général, un demandeur doit fournir à l'UEL le nom officiel de l'entité, son adresse de constitution, l'adresse de son siège social, le nom du registre des entreprises et l'identifiant de l'entité dans ce registre au moment où elle a été créée, s'il y a lieu. Chaque entité ne peut se voir attribuer qu'un LEI.

Le processus d'inscription nécessaire à l'obtention d'un LEI prend de une à trois semaines et coûte entre 200 \$ et 300 \$.

Une fois inscrite, chaque entité doit aviser l'UEL de tout changement apporté aux renseignements la concernant. Elle doit aussi faire de nouveau valider ces renseignements une fois par an par l'UEL.

[http://www.gfma.org/initiatives/legal-entity-identifier-\(lei\)/legal-entity-identifier-\(lei\)/](http://www.gfma.org/initiatives/legal-entity-identifier-(lei)/legal-entity-identifier-(lei)/)
http://www.treasury.gov/initiatives/wsr/ofr/Documents/LEI_FAQs_August2012_FINAL.pdf
<https://www.ciciutility.org/>

11.7. Annexe G – Figures

FIGURE 1 : COURTIER DÉCLARANT AGISSANT COMME CONTREPARTISTE	300
FIGURE 2 : COURTIER DÉCLARANT NÉGOCIANT SUR UNE PLATEFORME ÉLECTRONIQUE	311
FIGURE 3 : COMPTE À HONORAIRES D'UN CLIENT DE DÉTAIL	322
FIGURE 4 : OPÉRATION ENTRE DEUX COURTIER DÉCLARANTS	333
FIGURE 5 : OPÉRATION ENTRE LE COURTIER ET UNE PARTIE LIÉE.....	355
FIGURE 6 : OPÉRATION ENTRE LE COURTIER ET UNE ENTITÉ ÉTRANGÈRE	366
FIGURE 7 : OPÉRATION ENTRE DEUX COURTIER RÉALISÉE PAR L'INTERMÉDIAIRE D'UN CIEO.....	377
FIGURE 8 : OPÉRATION ENTRE LE COURTIER ET UNE BANQUE	39
FIGURE 9 : REMISIER-COURTIER CHARGÉ DE COMPTES	400
FIGURE 10 : COURTIER CHEF DE FILE – NOUVELLE ÉMISSION	422
FIGURE 11 : VENTE PAR LE COURTIER CHEF DE FILE À UN SYNDICAT	433
FIGURE 12 : VENTE PAR LE COURTIER D'UNE NOUVELLE ÉMISSION À UN CLIENT INSTITUTIONNEL CANADIEN	455
FIGURE 13 : OPÉRATION POUR COMPTE PROPRE SANS RISQUE	466
FIGURE 14 : ANNULATION D'OPÉRATION.....	48
FIGURE 15 : ANNULATION D'OPÉRATION PUIS NOUVELLE OPÉRATION	500
FIGURE 16 : CORRECTION D'OPÉRATION	522
FIGURE 17 : CONCLUSION PAR LE COURTIER DÉCLARANT D'UNE OPÉRATION DE MISE EN PENSION À UN JOUR ASSORTIE D'UNE GARANTIE GÉNÉRALE (TITRES CONNUS) AVEC UN CLIENT	544
FIGURE 18 : CONCLUSION PAR LE COURTIER MEMBRE DÉCLARANT D'UNE OPÉRATION DE PRISE EN PENSION ASSORTIE D'UNE GARANTIE GÉNÉRALE (TITRES INCONNUS) AU MOYEN D'UN SNP AVEC UN COURTIER NON DÉCLARANT	555
FIGURE 19 : CONCLUSION PAR LE COURTIER DÉCLARANT D'UNE CONVENTION D'ACHAT-RÉTROCESSION D'UNE DURÉE D'UNE SEMAINE LIVRÉE À DÉPART DIFFÉRÉ PAR L'ENTREMISE D'UN CIEO AVEC UN DISTRIBUTEUR DE TITRES D'ÉTAT.....	566
FIGURE 20 : CONCLUSION PAR LE COURTIER DÉCLARANT D'UNE OPÉRATION DE MISE EN PENSION À DURÉE FIXE LIVRÉE À DÉPART DIFFÉRÉ, ASSORTIE D'UNE GARANTIE GÉNÉRALE (TITRES CONNUS), AVEC UN CLIENT ÉTRANGER	588
FIGURE 21 : CONCLUSION PAR LE COURTIER DÉCLARANT D'UNE OPÉRATION DE MISE EN PENSION À TAUX VARIABLE À DURÉE OUVERTE, ASSORTIE D'UNE GARANTIE GÉNÉRALE (TITRES INCONNUS), AVEC UN COURTIER NON DÉCLARANT	59
FIGURE 22 : CLÔTURE PAR LE COURTIER DÉCLARANT D'UNE OPÉRATION DE MISE EN PENSION À DURÉE OUVERTE (MISE À JOUR)	600
FIGURE 23 : MISE À JOUR PAR LE COURTIER DÉCLARANT D'UNE OPÉRATION DE PRISE EN PENSION ASSORTIE D'UNE GARANTIE GÉNÉRALE (TITRES INCONNUS) PAR L'INDICATION DES TITRES EN QUESTION (MISE À JOUR)	61
FIGURE 24 : MODIFICATION PAR LE COURTIER DÉCLARANT DU TAUX D'UNE OPÉRATION DE MISE EN PENSION À DURÉE OUVERTE (MISE À JOUR).....	62
FIGURE 25 : CORRECTION PAR LE COURTIER DÉCLARANT DE LA QUANTITÉ SUR LAQUELLE PORTE UNE OPÉRATION DE MISE EN PENSION À UN JOUR CONCLUE AVEC UN CLIENT	63
FIGURE 26 : ANNULATION PAR LE COURTIER D'UNE OPÉRATION DE MISE EN PENSION	64