

RÈGLEMENT MODIFIANT LE RÈGLEMENT 91-507 SUR LES RÉFÉRENTIELS CENTRAUX ET LA DÉCLARATION DE DONNÉES SUR LES DÉRIVÉS

Loi sur les instruments dérivés

(chapitre I-14.01, a. 175, al. 1, par. 2°, 3°, 9°, 11°, 12° et 29°)

1. L'article 1 du Règlement 91-507 sur les référentiels centraux et la déclaration de données sur les dérivés (chapitre I-14.01, r. 1.1) est modifié :

1° dans le paragraphe 1 :

a) par le remplacement, dans la définition de l'expression « contrepartie locale », des sous-paragraphes *b* et *c* par les suivants :

« *b*) une personne physique résidant au Québec ou la succession d'une personne décédée qui y résidait au moment de son décès;

« *c*) une entité du même groupe qu'une personne visée au sous-paragraphe *a*, cette personne étant responsable de la totalité ou de la quasi-totalité des passifs de la contrepartie; »;

b) par l'insertion, après la définition de l'expression « contrepartie locale », de la suivante :

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

c) dans la définition de l'expression « données à communiquer à l'exécution », par le remplacement du mot « champs » par le mot « éléments » et par l'addition, après les mots « l'Annexe A », des mots « , sauf les données sur les sûretés et les marges et les données de valorisation »;

d) par le remplacement, dans la définition de l'expression « données de valorisation », des mots « champs applicables » par le mot « éléments » et des mots « Données de valorisation » par les mots « Éléments de données relatifs à la valorisation »;

e) par l'insertion, après la définition de l'expression « données de valorisation », de la suivante :

« « données sur les sûretés et les marges » : les données correspondant aux montants actuels de sûreté et de marge déposées ou collectées qui sont visés dans les éléments de la rubrique « Éléments de données relatifs aux sûretés et aux marges » de l'Annexe A; »;

f) par l'insertion, après la définition de l'expression « données sur les dérivés », de la suivante :

« « données sur les positions » : les données agrégées sur les événements du cycle de vie visées à l'article 32.1; »;

g) par l'insertion, après la définition de l'expression « événement du cycle de vie », des suivantes :

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

« « lien » : un dispositif contractuel et opérationnel qui relie, directement ou par un intermédiaire, un système d'un référentiel central reconnu au moins à un système d'acceptation, de conservation, d'utilisation et de communication de données sur les dérivés ou d'accès à celles-ci exploité par une autre personne; »;

h) par l'insertion, après la définition de l'expression « participant », des suivantes :

« « participant indirect » : une personne qui a accès aux services d'un référentiel central reconnu en vertu d'une convention conclue avec un participant;

« « procédures de validation des données sur les dérivés » : les règles, politiques et procédures écrites établies, mises en œuvre, maintenues et appliquées par un référentiel central reconnu en vertu de l'article 22.2; »;

2° par le remplacement, dans le paragraphe 3, des mots « considérées comme membres » par les mots « des entités » et des mots « ou si » par les mots « ou qu'elles »;

3° par le remplacement des sous-paragraphes *c* et *d* du paragraphe 4 par les suivants :

« *c)* les conditions suivantes sont réunies :

i) l'autre personne est une société en commandite;

ii) elle est le commandité de la société en commandite visée à la disposition *i*;

iii) elle a le pouvoir de diriger cette autre personne et d'appliquer ses politiques du fait de sa qualité de commandité;

« *d)* les conditions suivantes sont réunies :

i) l'autre personne est une fiducie;

ii) elle est le fiduciaire de la fiducie visée à la disposition *i*;

iii) elle a le pouvoir de diriger cette autre personne et d'appliquer ses politiques du fait de sa qualité de fiduciaire. »;

4° par l'insertion, après le paragraphe 5, du suivant :

« 5.1) Malgré les paragraphes 3 et 4, un fonds d'investissement n'est pas une entité du même groupe qu'une autre personne pour l'application du présent règlement. ».

2. L'article 7 de ce règlement est modifié, dans le paragraphe 2 :

1° par le remplacement, dans le sous-paragraphe *a*, du mot « ces » par le mot « les » et des mots « les conventions contractuelles » par les mot « ses dispositifs contractuels »;

2° par l'insertion, après le sous-paragraphe *a*, des suivants :

« *a.1)* les règles, politiques et procédures déterminent et réduisent les risques découlant de tout conflit de lois potentiel entre territoires;

« a.2) les règles, politiques et procédures et ses dispositifs contractuels lui permettent de collecter des informations de base sur les risques créés par les dispositifs conclus avec des participants indirects, afin de déterminer, de mesurer, de surveiller et de gérer les risques importants auxquels ces dispositifs pourraient l'exposer; »;

3° par le remplacement, dans le sous-paragraphe *c*, des mots « conventions contractuelles » par les mots « dispositifs contractuels »;

4° par le remplacement, dans le texte anglais du sous-paragraphe *d*, du mot « established. » par les mots « established, and »;

5° par l'addition, après le sous-paragraphe *d*, du suivant :

« e) les liens sont conformes à la législation en valeurs mobilières applicable. ».

3. L'article 8 de ce règlement est modifié, dans le paragraphe 1 :

1° par l'insertion, dans le sous-paragraphe *a* et après le mot « cohérentes », des mots « , dont les rôles et responsabilités en matière de détermination, de mesure, de surveillance et de gestion des risques »;

2° par l'insertion, après le sous-paragraphe *b*, des suivants:

« b.1) les règles, politiques et procédures déterminent et réduisent les risques découlant de tout conflit de lois potentiel entre territoires;

« b.2) les règles, politiques et procédures et ses dispositifs contractuels lui permettent de collecter des informations de base sur les risques créés par les dispositifs conclus avec des participants indirects, afin de déterminer, de mesurer, de surveiller et de gérer les risques importants auxquels ces dispositifs pourraient l'exposer; »;

3° par l'insertion, dans le sous-paragraphe *d* et après les mots « à son égard », des mots « et son efficacité à répondre aux besoins de ses participants ».

4. L'article 9 de ce règlement est modifié par l'addition, après le paragraphe 4, du suivant :

« 5) Le référentiel central reconnu est doté de politiques et de procédures d'évaluation régulière de la performance globale du conseil d'administration et de chacun de ses membres. ».

5. L'article 12 de ce règlement est modifié :

1° par la suppression, dans le texte anglais du paragraphe *a* et après le mot « participants, », du mot « and »;

2° par le remplacement, dans le texte anglais du paragraphe *b*, du mot « data. » par les mots « data, and »;

3° par l'addition, après le paragraphe *b*, du suivant :

« c) ils sont régulièrement révisés. ».

6. L'article 14 de ce règlement est remplacé par le suivant :

« Acceptation des déclarations

« **14.** 1) Le référentiel central reconnu accepte les données sur les dérivés que lui déclarent les participants à l'égard des opérations sur dérivés des catégories d'actifs visées dans sa décision de reconnaissance.

2) Pour toutes les opérations à déclarer en vertu du présent règlement, y compris celles ayant expiré ou auxquelles il est mis fin, et sous réserve du paragraphe 2 de l'article 18, le référentiel central reconnu accepte la correction de toute erreur ou omission dans les données sur les dérivés d'un participant et l'apporte dès qu'il est technologiquement possible de le faire.

3) Pour l'application des paragraphes 1 et 2, le référentiel central reconnu accepte les données sur les dérivés comprenant les éléments de données à déclarer en vertu de l'Annexe A. ».

7. Ce règlement est modifié par l'insertion, après l'article 14, du suivant :

« Efficience et efficacité opérationnelles

« 14.1. 1) Le référentiel central reconnu veille à ce que ses services répondent aux critères suivants :

a) ils sont conçus de manière à satisfaire aux besoins des participants et des marchés qu'il sert;

b) ils sont rendus de manière efficace, efficiente et sécuritaire.

2) Le référentiel central reconnu établit, met en œuvre, maintient et applique des règles, politiques et procédures écrites afin d'examiner régulièrement les éléments suivants :

a) son efficience et son efficacité à satisfaire les exigences de ses participants et des marchés qu'elle sert;

b) ses coûts et sa structure tarifaire.

3) Le référentiel central reconnu est doté de politiques et de procédures définissant des buts et des objectifs mesurables pour tous les aspects de son activité à ce titre. ».

8. L'article 20 de ce règlement est modifié par l'addition, après le paragraphe 6, du suivant :

« 7) Le référentiel central reconnu maintient un plan de recapitalisation, approuvé par le conseil d'administration et régulièrement mis à jour, dans l'éventualité où ses capitaux propres tomberaient à proximité ou en deçà du montant exigé en vertu du paragraphe 3. ».

9. L'article 21 de ce règlement est modifié :

1° par le remplacement de son intitulé par le suivant :

« Risques liés aux systèmes et autres risques opérationnels »;

2° dans le sous-paragraphe c du paragraphe 3, par l'insertion, après les mots « d'incident », du mot « écrit » et par l'addition, après les mots « de l'incident », des mots « et toute mesure corrective qu'il a prise ou qu'il prendra ».

10. Ce règlement est modifié par l'insertion, après l'article 22, des suivants :

« Opérations exécutées anonymement sur une plateforme de négociation de dérivés

« 22.1. Le référentiel central reconnu ne divulgue l'identité ou l'identifiant pour les entités juridiques d'aucune contrepartie à une autre à l'égard d'une opération avec une contrepartie locale qui est exécutée anonymement sur une plateforme de négociation de dérivés et compensée par l'entremise d'une chambre de compensation déclarante.

« Validation des données

« 22.2. 1) Le référentiel central reconnu établit, met en œuvre, maintient et applique des règles, politiques et procédures écrites raisonnablement conçues pour valider la conformité des données sur les dérivés déclarées en vertu du présent règlement aux éléments de données sur les dérivés prévus à l'Annexe A.

2) Dès que technologiquement possible après la réception des données sur les dérivés d'une contrepartie déclarante ou d'une partie à laquelle cette dernière a délégué son obligation de déclaration en vertu du présent règlement, le référentiel central reconnu confirme ou infirme à cette contrepartie, ou au mandataire agissant en son nom, qu'elles satisfont à ses procédures de validation des données sur les dérivés.

3) Sous réserve du paragraphe 2 de l'article 18, le référentiel central reconnu crée et conserve des dossiers de toutes les données sur les dérivés déclarées n'ayant pas satisfait à ses procédures de validation des données sur les dérivés. ».

11. L'article 23 de ce règlement est remplacé par le suivant :

« Confirmation des données et de l'information

« 23. Le référentiel central reconnu établit, met en œuvre, maintient et applique des règles, politiques et procédures écrites raisonnablement conçues pour permettre à la contrepartie déclarante à une opération de s'acquitter de ses obligations de vérification de données en vertu du sous-paragraphe *b* du paragraphe 1 de l'article 26.1. ».

12. Ce règlement est modifié par l'insertion, après l'article 24, du suivant :

« Liens et dispositifs à plusieurs niveaux de participation

« 24.1. 1) Le référentiel central reconnu établit, met en œuvre et maintient des procédures et contrôles appropriés pour remplir les fonctions suivantes :

a) déterminer, évaluer, surveiller, mesurer et gérer toutes les sources de risque potentielles découlant des liens et des autres dispositifs conclus avec les participants indirects;

b) relever les rapports de dépendance importants entre les participants et les participants indirects qui sont susceptibles de le toucher.

2) Le référentiel central reconnu examine régulièrement les risques émanant des dispositifs à plusieurs niveaux de participation. ».

13. L'article 25 de ce règlement est modifié par l'addition, après le paragraphe 4, des suivants :

« 5) La contrepartie locale à une opération à laquelle le paragraphe 3 s'applique a les obligations suivantes :

a) elle tient un dossier sur la convention écrite visée à ce paragraphe pendant une période de 7 ans suivant la date d'expiration ou de fin de l'opération;

b) elle conserve le dossier visé au sous-paragraphe *a* en lieu sûr et sous une forme durable.

« 6) Malgré l'article 40, est obligée de déclarer les données sur les dérivés conformément au présent règlement la contrepartie locale qui accepte en vertu du paragraphe 3 d'être la contrepartie déclarante pour une opération à laquelle l'article 40 s'applique. ».

14. L'article 26 de ce règlement est modifié :

1° par le remplacement, dans le paragraphe 1, des mots « à une » par les mots « à l'égard d'une »;

2° dans le paragraphe 5 :

a) par la suppression, dans le sous-paragraphe *a*, de « *b* ou »;

b) dans le sous-paragraphe *b* :

i) par le remplacement, dans le texte anglais de ce qui précède la disposition *i*, des mots « pursuant to » par le mot « under »;

ii) dans la disposition *i*, par l'insertion, après le mot « province », des mots « ou d'un territoire » et par le remplacement du mot « canadienne » par les mots « du Canada »;

3° par le remplacement des paragraphes 6 et 7 par les suivants :

« 6) La contrepartie déclarante veille à ce que toutes les données sur les dérivés déclarées relativement à une opération satisfassent aux procédures de validation des données sur les dérivés du référentiel central reconnu auquel est déclarée l'opération.

« 7) La contrepartie déclarante veille à ce que toutes les données sur les dérivés déclarées relativement à une opération soient déclarées au même référentiel central reconnu ou, si la déclaration a été faite conformément au paragraphe 4, à l'Autorité. »;

4° par l'abrogation du paragraphe 8.

15. Ce règlement est modifié par l'insertion, après l'article 26, du suivant :

« Vérification de l'exactitude des données et signalement des erreurs et omissions

« **26.1. 1)** La contrepartie déclarante veille à ce que toutes les données sur les dérivés déclarées relativement à une opération remplissent les conditions suivantes :

a) elles sont exactes et ne contiennent aucune information fautive ou trompeuse;

b) dans le cas de la contrepartie déclarante qui est une personne assujettie à l'obligation d'inscription à titre de courtier prévue par la Loi, une chambre de compensation déclarante ou une institution financière canadienne, leur exactitude et le fait qu'elles ne contiennent aucune information fautive ou trompeuse sont vérifiées au moins tous les 30 jours.

2) La contrepartie déclarante signale toute erreur ou omission dans les données sur les dérivés au référentiel central reconnu ou, si la déclaration de ces données a été faite conformément au paragraphe 4 de l'article 26, à l'Autorité dès qu'il est technologiquement possible de le faire, mais en aucun cas après la fin du jour ouvrable suivant le jour de sa découverte.

3) La contrepartie locale qui n'est pas la contrepartie déclarante avise cette dernière de toute erreur ou omission dans les données sur les dérivés relatives à l'opération à laquelle elle est contrepartie dès qu'il est technologiquement possible de le faire, mais en aucun cas après la fin du jour ouvrable suivant le jour de sa découverte.

4) La contrepartie déclarante avise l'Autorité de toute erreur ou omission importante dès qu'il est possible de le faire suivant sa découverte. ».

16. L'article 28 de ce règlement est modifié par le remplacement, dans le paragraphe 4, des mots « autre identifiant » par les mots « seul autre identifiant unique ».

17. L'article 28.1 de ce règlement est remplacé par le suivant :

« **Maintien et renouvellement des identifiants pour les entités juridiques**

« **28.1.** Chaque contrepartie à une opération à déclarer en vertu du présent règlement qui n'est pas une personne physique et qui y est admissible obtient un identifiant pour les entités juridiques attribué conformément aux normes établies par le Système d'identifiant international pour les entités juridiques, et le maintient et le renouvelle, si elle est l'une des entités suivantes :

- a) une contrepartie déclarante;
- b) une contrepartie non déclarante qui est une contrepartie locale. ».

18. L'article 29 de ce règlement est remplacé par le suivant :

« **Identifiants uniques d'opération**

« **29.** 1) Chaque opération à déclarer en vertu du présent règlement est identifiée par un identifiant unique d'opération qui est attribué par l'une des entités suivantes :

a) lorsque l'opération est compensée par l'entremise d'une chambre de compensation déclarante, cette chambre;

b) lorsque l'opération n'est pas compensée par l'entremise d'une chambre de compensation déclarante et qu'elle est exécutée sur une plateforme de négociation de dérivés qui lui a attribué un identifiant unique d'opération, cette plateforme;

c) lorsque les sous-paragraphes *a* et *b* ne s'appliquent pas à l'opération et qu'elle doit aussi être déclarée en vertu de la législation en valeurs mobilières d'une province ou d'un territoire du Canada autre que le Québec, ou des lois d'un territoire étranger, dans un délai de déclaration plus court que celui prévu par le présent règlement, la personne tenue d'attribuer l'identifiant unique d'opération en vertu de la législation de cette province ou de ce territoire en la matière, ou des lois de ce territoire étranger;

d) lorsque les sous-paragraphes *a* à *c* ne s'appliquent pas à l'opération et que les deux contreparties à celle-ci sont des personnes assujetties à l'obligation d'inscription à titre de courtier prévue par la Loi, la contrepartie déclarante en vertu du paragraphe 3 de l'article 25 ou toute partie à laquelle a été déléguée l'obligation de déclaration en vertu du paragraphe 3 de l'article 26;

e) lorsque les sous-paragraphes *a* à *d* ne s'appliquent pas à l'opération et que les deux contreparties à celle-ci sont des personnes assujetties à l'obligation d'inscription à titre de courtier prévue par la Loi, la personne arrivant en tête du classement alphanumérique des identifiants uniques pour les entités juridiques après inversion de leurs caractères;

f) lorsque les sous-paragraphes *a* à *e* ne s'appliquent pas à l'opération et que seule une contrepartie à celle-ci est une personne assujettie à l'obligation d'inscription à titre de courtier prévue par la Loi, cette personne;

g) lorsque les sous-paragraphes *a* à *f* ne s'appliquent pas à l'opération, qu'aucune contrepartie à celle-ci n'est une personne assujettie à l'obligation d'inscription à titre de courtier prévue par la Loi et que seule une contrepartie est une institution financière canadienne, cette institution;

h) dans tout autre cas, le référentiel central reconnu.

2) L'identifiant unique d'opération est attribué dès qu'il est technologiquement possible de le faire après l'exécution de l'opération, mais en aucun cas après le moment auquel il faut la déclarer à un référentiel central reconnu en vertu du présent règlement. ».

19. L'article 30 de ce règlement est modifié :

1° par le remplacement, dans le paragraphe 1, des mots « conformément aux normes internationales ou sectorielles » par les mots « par le Derivatives Service Bureau »;

2° dans le paragraphe 2, par l'insertion, après le mot « chaque », des mots « dérivé visé par » et, après le mot « un », du mot « seul »;

3° par l'abrogation des paragraphes 3 et 4.

20. L'article 32 de ce règlement est modifié :

1° par le remplacement, dans le texte anglais de l'intitulé, du mot « **Life-cycle** » par le mot « **Lifecycle** »;

2° par le remplacement, partout où il se trouve dans le texte anglais du paragraphe 1, du mot « life-cycle » par le mot « lifecycle »;

3° par le remplacement du paragraphe 2 par le suivant :

« 2) Malgré le paragraphe 1, les données sur les événements du cycle de vie ne pouvant être technologiquement déclarées avant la fin du jour ouvrable où les événements se sont produits sont déclarées au plus tard à la fin du jour ouvrable suivant. »;

3° par l'addition, après le paragraphe 2, du suivant :

« 3) Malgré les paragraphes 1 et 2, la chambre de compensation déclarante par l'entremise de laquelle l'opération est compensée déclare qu'il est mis fin à l'opération initiale au référentiel central reconnu auquel les données sur les dérivés à l'égard de cette opération ont été déclarées, avant la fin du jour ouvrable où il y est mis fin. ».

21. Ce règlement est modifié par l'insertion, après l'article 32, du suivant :

« Données sur les positions »

« **32.1.** Malgré l'article 32, la contrepartie déclarante peut, à son gré, déclarer les données sur les positions à l'égard des opérations à déclarer en vertu du présent règlement, lorsque chaque opération pour laquelle ces données sont agrégées et déclarées répond aux critères suivants :

a) elle ne comporte pas de date d'expiration fixe;

b) elle appartient à une catégorie de dérivés dans laquelle chaque opération est fongible. ».

22. L'article 33 de ce règlement est remplacé par le suivant :

« Données de valorisation et données sur les sûretés et les marges »

« **33.** 1) La contrepartie déclarante qui est une personne assujettie à l'obligation d'inscription à titre de courtier prévue par la Loi, une chambre de compensation déclarante ou une institution financière canadienne déclare chaque jour ouvrable à un référentiel central reconnu les données suivantes à l'égard de toute opération à déclarer conformément au présent règlement :

a) les données de valorisation;

b) les données sur les sûretés et les marges.

2) Si des données sur les positions à l'égard d'opérations ont été déclarées en vertu de l'article 32.1, les données de valorisation et les données sur les sûretés et les marges sont calculées et déclarées sur la valeur nette de l'ensemble des achats et des ventes déclarés en tant que données sur les positions des opérations. ».

23. L'article 35 de ce règlement est modifié par l'insertion, après le mot « Malgré », de « le paragraphe 7 de l'article 26 et ».

24. Ce règlement est modifié par l'insertion, après l'article 36, du suivant :

« Plateforme de négociation de dérivés

« **36.1.** Malgré l'article 25, à l'égard d'une opération avec une contrepartie locale qui n'est pas compensée par l'entremise d'une chambre de compensation déclarante, est exécutée anonymement sur une plateforme de négociation de dérivés et est destinée à être compensée, les conditions suivantes s'appliquent :

a) la plateforme de négociation de dérivés a les obligations de la contrepartie déclarante en vertu des articles 26, 27, 30, 31 et 35 à 37, des paragraphes 1, 2 et 4 de l'article 26.1 et du paragraphe 4 de l'article 28, plutôt que celles de la contrepartie déclarante en vertu de l'article 25;

b) toutes les mentions de la « contrepartie déclarante » à l'article 23, aux paragraphes 2 de l'article 22.2, 3 des articles 26 et 26.1 et 5 de l'article 28 sont réputées s'entendre de la plateforme de négociation de dérivés et non de la contrepartie déclarante visée à l'article 25. ».

25. L'article 37 de ce règlement est modifié, dans le paragraphe 1 :

1° par le remplacement, dans le sous-paragraphe *b*, du mot « globales » par le mot « agrégées »;

2° par le remplacement, dans le sous-paragraphe *c*, du mot « regroupées » par le mot « agrégées »;

3° par l'addition, après le sous-paragraphe *c*, du suivant :

« *d)* il fournit à l'Autorité les corrections de toute erreur ou omission dans les données sur les dérivées visées aux sous-paragraphes *a* à *c* qui lui sont déclarées par un participant dès que technologiquement possible après qu'elles sont enregistrées. ».

26. L'article 38 de ce règlement est modifié :

1° par le remplacement, dans le paragraphe 1, des mots « Le référentiel » par les mots « Sous réserve de l'article 22.1, le référentiel »;

2° par le remplacement, dans le paragraphe 2, des mots « de vérification et d'autorisation pour encadrer » par les mots « d'autorisation pour permettre »;

3° par le remplacement, dans le paragraphe 3, du mot « Chaque » par les mots « Sous réserve de l'article 22.1, chaque ».

27. L'article 39 de ce règlement est modifié :

1° par le remplacement du paragraphe 1 par le suivant :

« 1) Le référentiel central reconnu crée et met à la disposition du public, sans frais, les éléments suivants :

a) les données agrégées sur les opérations ouvertes, le volume, le nombre et, s'il y a lieu, le prix se rapportant aux opérations qui lui sont périodiquement déclarées en vertu du présent règlement;

b) les corrections des données visées au sous-paragraphe *a* résultant de la correction de toute erreur ou omission dans les données sur les dérivés qui lui sont déclarées par un participant en vertu du présent règlement dès qu'il est technologiquement possible de le faire après leur enregistrement, mais en aucun cas après la prochaine mise à la disposition du public des données agrégées périodiques. »;

2° par le remplacement, dans le paragraphe 2, du mot « globales » par le mot « agrégées » et des mots « d'échéance » par les mots « d'expiration »;

3° par le remplacement du paragraphe 3 par le suivant :

« 3) Relativement à chaque opération déclarée en vertu du présent règlement, le référentiel central reconnu met à la disposition du public, sans frais, les éléments suivants :

a) des données sur les opérations conformément aux obligations prévues à l'Annexe C;

b) dès que technologiquement possible, les corrections des données visées au sous-paragraphe *a* résultant de la correction de toute erreur ou omission dans les données sur les dérivés qui lui sont déclarées en vertu du présent règlement, sous réserve des obligations prévues à l'Annexe C. »;

4° par le remplacement, dans le paragraphe 6, du mot « personnes » par le mot « entités ».

28. L'article 40 de ce règlement est modifié :

1° par le remplacement de l'intitulé par le suivant :

« **Opérations sur marchandises** »;

2° dans ce qui précède le paragraphe *a*, par le remplacement des mots « tout autre article » par les mots « toute autre disposition » et par l'insertion, après le mot « règlement, », de « sauf le paragraphe 5 de l'article 25, »;

3° par le remplacement, dans le paragraphe *a*, des mots « des liquidités » par les mots « de la trésorerie »;

4° par le remplacement du paragraphe *b* par le suivant :

« *b)* la contrepartie n'est aucune des personnes suivantes :

i) une chambre de compensation déclarante;

ii) une personne assujettie à l'obligation d'inscription à titre de courtier prévue par la Loi;

iii) une institution financière canadienne;

iv) une entité du même groupe que la personne visée au sous-paragraphe *i* ou *ii* »;

5° par le remplacement du paragraphe *c* par le suivant :

« *c)* le montant notionnel brut global de l'ensemble des opérations en cours à la fin du mois, dont la catégorie d'actifs est une marchandise autre que de la trésorerie ou une monnaie, et de celles de chaque entité du même groupe qu'elle qui est une contrepartie locale dans tout territoire du Canada, à l'exclusion des opérations avec une entité du même groupe, n'a pas excédé 250 000 \$ au cours des 12 mois civils précédents ».

29. Ce règlement est modifié par l'insertion, après l'article 41, du suivant :

« Personnes physiques

« 41.1. Malgré tout autre article du présent règlement, la contrepartie qui est une contrepartie locale en vertu du paragraphe *b* de la définition de l'expression « contrepartie locale » n'est pas obligée de déclarer les données sur les dérivés relativement à une opération. ».

30. Ce règlement est modifié par le remplacement de l'Annexe A par la suivante :

« Annexe A

Champs de données minimales à déclarer au référentiel central reconnu

Conformément au chapitre 3 du présent règlement, la contrepartie déclarante est tenue de remplir tous les champs, sauf ceux qui ne sont pas pertinents.

La présente annexe prévoit les éléments de données et leurs descriptions pour l'application du chapitre 3 du présent règlement et toute diffusion dans le public des données à déclarer relativement à chaque opération en vertu de son chapitre 4 et de son Annexe C.

La colonne « Description des éléments de données » comprend les descriptions normalisées à l'échelle mondiale. Dans la présente annexe, les expressions utilisées dans cette colonne ont le sens suivant :

Expression utilisée dans la colonne « Description de l'élément de données »	Signification dans l'Annexe A
opération sur dérivé	opération
instrument	dérivé
dérivé conclu à l'origine	opération initiale
dérivé de gré à gré (seulement à l'égard de l'élément de données n° 115)	dérivé
opération sur dérivé de gré à gré	opération
produit	dérivé
plateforme de négociation	plateforme de négociation de dérivés

Éléments de données relatifs aux contreparties

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Diffusion dans le public
1	Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)	L'identifiant de la contrepartie à une opération sur dérivé de gré à gré qui remplit son obligation de déclaration par la déclaration en question. Dans les territoires où les deux parties doivent déclarer l'opération, l'identifiant de la contrepartie 1 identifie toujours la contrepartie déclarante. Dans le cas d'une opération sur dérivés attribuée qu'un gestionnaire de fonds exécute pour le compte d'un fonds, c'est le fonds, et non pas le gestionnaire, qui est déclaré en tant que contrepartie. Lorsque l'obligation de déclaration est acquittée par une plateforme de négociation, l'identifiant de la contrepartie 1 identifie l'une des contreparties à l'opération.	N

2	Contrepartie 2	L'identifiant de la deuxième contrepartie à une opération sur dérivé de gré à gré. Dans le cas d'une opération sur dérivés attribuée qu'un gestionnaire de fonds exécute pour le compte d'un fonds, c'est le fonds, et non pas le gestionnaire, qui est déclaré en tant que contrepartie.	N
3	Source de l'identifiant de la contrepartie 2	La source servant à identifier la contrepartie 2.	N
4	Identifiant de l'acheteur	L'identifiant de la contrepartie qui est l'acheteur au moment de l'opération.	N
5	Identifiant du vendeur	L'identifiant de la contrepartie qui est le vendeur au moment de l'opération.	N
6	Identifiant du payeur	L'identifiant de la contrepartie de la branche du payeur au moment de l'opération.	N
7	Identifiant du receveur	L'identifiant de la contrepartie de la branche receveuse au moment de l'opération.	N
8	Numéro d'identification du courtier	Dans le cas où le courtier agit comme intermédiaire pour la contrepartie 1 sans devenir lui-même une contrepartie, il doit être identifié par un identifiant pour les entités juridiques.	N
9	Pays et province ou territoire de la personne physique	Dans le cas de la contrepartie qui est une personne physique, inscrire son pays de résidence. Si elle réside au Canada, préciser la province ou le territoire.	N
10	Territoire de la contrepartie 1	Si la contrepartie 1 est une contrepartie locale en vertu du présent règlement ou des règlements sur la déclaration des données sur les dérivés de l'Ontario ou du Manitoba, ou en vertu du paragraphe <i>a</i> ou <i>c</i> de la définition de l'expression « contrepartie locale » dans les règlements sur la déclaration des données sur les dérivés de tout autre territoire du Canada, indiquer les territoires en question.	N
11	Territoire de la contrepartie 2	Si la contrepartie 2 est une contrepartie locale en vertu du présent règlement ou des règlements sur la déclaration des données sur les dérivés de l'Ontario ou du Manitoba, ou en vertu du paragraphe <i>a</i> ou <i>c</i> de la définition de l'expression « contrepartie locale » dans les règlements sur la déclaration des données sur les dérivés de tout autre territoire du Canada, indiquer les territoires en question.	N

Éléments de données relatifs aux opérations

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Diffusion dans le public
12	Date d'entrée en vigueur	La date non ajustée, indiquée dans la confirmation, à laquelle les obligations relatives à l'opération sur un dérivé de gré à gré entrent en vigueur.	O

13	Date d'expiration	La date non ajustée, indiquée dans la confirmation, à laquelle les obligations relatives à l'opération sur un dérivé de gré à gré cessent d'avoir effet. Cet élément n'est pas modifié s'il est mis fin à l'opération par anticipation.	O
14	Horodatage de l'exécution	La date et l'heure de l'exécution initiale de l'opération ayant généré un nouvel UTI. Cet élément demeure inchangé pendant la durée de validité de l'UTI.	O
15	Horodatage de la déclaration	La date et l'heure de soumission de la déclaration au référentiel central.	N
16	Identifiant unique d'opération (UTI)	L'identifiant unique attribué à l'opération ou à la position qui sert à les identifier de manière unique pendant tout leur cycle de vie dans l'ensemble des dossiers et déclarations.	N
17	UTI antérieur (pour les relations d'une à une et d'une à plusieurs entre les opérations)	L'UTI attribué à l'opération antérieure ayant donné lieu à l'opération déclarée en raison d'un événement du cycle de vie, dans une relation entre les opérations qui est d'une à une (par exemple, dans le cas d'une novation, lorsqu'il est mis fin à une opération et qu'une nouvelle est générée) ou d'une à plusieurs (par exemple, lors de la compensation ou si une opération est scindée en plusieurs différentes).	N
18	UTI de la position subséquente	L'UTI de la position dans laquelle l'opération est incluse. Ce champ ne s'applique qu'aux déclarations relatives à la fin d'une opération du fait de son inclusion dans une position.	N
19	USI antérieur (pour les relations d'une à une et d'une à plusieurs entre les opérations)	L'identifiant unique de swap (USI) attribué à l'opération antérieure ayant donné lieu à l'opération déclarée en raison d'un événement du cycle de vie, dans une relation entre les opérations qui est d'une à une (par exemple, dans le cas d'une novation, lorsqu'il est mis fin à une opération et qu'une nouvelle est générée) ou d'une à plusieurs (par exemple, lors de la compensation ou si une opération est scindée en plusieurs différentes).	N
20	Intragroupe	Indique si l'opération est exécutée entre deux entités du même groupe.	N
21	Identifiant de l'initiateur	L'identifiant de l'entité soumettant les données sur les dérivés au référentiel central, si la contrepartie déclarante a délégué la tâche de déclarer l'opération à un tiers fournisseur de services ou qu'une plateforme de négociation déclare les données.	N
22	Identifiant de la plateforme	L'identifiant de la plateforme de négociation (par ex. une bourse, une plateforme de négociation multilatérale, une plateforme d'exécution de swaps) sur laquelle l'opération a été exécutée.	O
23	Type d'accord-cadre	Le type d'accord-cadre qui a été utilisé pour l'opération déclarée, le cas échéant.	N

24	Version de l'accord-cadre	La date de la version de l'accord-cadre (par exemple, 2002, 2006).	N
----	---------------------------	--	---

Éléments de données relatifs aux montants et quantités notionnels

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Diffusion publique
25	Montant notionnel	<p>À l'égard de chaque branche de l'opération, s'il y a lieu :</p> <ul style="list-style-type: none"> - pour les opérations sur dérivés de gré à gré négociées en montants monétaires, le montant stipulé dans le contrat; - pour les opérations sur dérivés de gré à gré non négociées en montants monétaires, un montant notionnel converti. <p>De plus :</p> <ul style="list-style-type: none"> • pour les opérations sur dérivés de gré à gré prévoyant un tableau de montants notionnels, le montant notionnel initial convenu par les contreparties au début de l'opération est déclaré sous cet élément de données; • pour les options sur devises de gré à gré, outre cet élément de données, les montants sont déclarés au moyen des éléments de données Montant d'achat et Montant de vente; • pour les modifications ou les événements du cycle de vie, le montant notionnel en cours qui en résulte est déclaré (les réalisations des étapes des tableaux des montants notionnels ne sont pas considérées comme des modifications ou des événements du cycle de vie); • si le montant notionnel est inconnu lors de la déclaration d'une nouvelle opération, cet élément de données est actualisé dès qu'il devient disponible. 	O
26	Monnaie notionnelle	À l'égard de chaque branche de l'opération, s'il y a lieu, la monnaie dans laquelle le montant notionnel est libellé.	O
27	Montant d'achat	Pour les options sur devises, le montant monétaire que l'option donne le droit d'acheter.	N
28	Monnaie d'achat	Pour les options sur devises, la monnaie dans laquelle le Montant d'achat est libellé.	N
29	Montant de vente	Pour les options sur devises, le montant monétaire que l'option donne le droit de vendre.	N
30	Monnaie de vente	Pour les options sur devises, la monnaie dans laquelle le Montant de vente est libellé.	N
31	Quantité notionnelle	À l'égard de chaque branche de l'opération, s'il y a lieu : relativement aux opérations sur dérivés négociées en montants non monétaires prévoyant une quantité notionnelle fixe pour chaque	N

		période du tableau (par exemple, 50 barils par mois). La fréquence est déclarée dans la Fréquence de cotation de la quantité, et l'unité de mesure est l'Unité de mesure de la quantité.	
32	Fréquence de cotation de la quantité	La cadence à laquelle la quantité est cotée à l'égard de l'opération (par exemple aux heures, quotidiennement, hebdomadairement ou mensuellement).	N
33	Fréquence de cotation de la quantité – multiplicateur	Le nombre d'unités de temps de la Fréquence de cotation de la quantité.	N
34	Unité de mesure de la quantité	À l'égard de chaque branche de l'opération, s'il y a lieu : l'unité de mesure dans laquelle la Quantité notionnelle totale et la Quantité notionnelle sont exprimées.	N
35	Quantité notionnelle totale	<ul style="list-style-type: none"> • À l'égard de chaque branche de l'opération, s'il y a lieu, la Quantité notionnelle globale de l'actif sous-jacent pendant la durée de l'opération • Lorsque la Quantité notionnelle totale est inconnue au moment de la déclaration de la nouvelle opération, cet élément est actualisé dès qu'elle devient disponible. 	N
36	Montant notionnel en vigueur à la date de prise d'effet associée	À l'égard de chaque branche de l'opération, s'il y a lieu. Pour les opérations sur dérivés de gré à gré négociées en montants monétaires prévoyant un tableau de montants notionnels.	N
37	Date de prise d'effet de la quantité notionnelle	La date non ajustée à laquelle la quantité notionnelle associée de la branche 1 prend effet.	N
38	Date de fin de la quantité notionnelle	La date de fin non ajustée de la quantité notionnelle de chaque branche.	N
39	Quantité notionnelle en vigueur à la date de prise d'effet associée	La quantité notionnelle de chaque branche qui prend effet à la date de prise d'effet non ajustée associée.	N
40	Tableau de montants notionnels – montant notionnel en vigueur à la date de prise d'effet associée	<ul style="list-style-type: none"> • À l'égard de chaque branche de l'opération, s'il y a lieu. • Pour les opérations sur dérivés de gré à gré négociées en montants monétaires prévoyant un tableau de montants notionnels. • Le montant notionnel qui prend effet à la date de prise d'effet non ajustée associée. • Le montant notionnel initial et les dates de prise d'effet et de fin non ajustées sont déclarés en tant que premières valeurs du tableau. 	N
41	Tableau de montants notionnels – date de prise d'effet non ajustée du montant notionnel	<ul style="list-style-type: none"> • À l'égard de chaque branche de l'opération, s'il y a lieu. • Pour les opérations sur dérivés de gré à gré négociées en montants monétaires prévoyant un tableau de montants notionnels. 	N

		<ul style="list-style-type: none"> • La date non ajustée à laquelle le montant notionnel associé prend effet. 	
42	Tableau de montants notionnels – date de fin non ajustée du montant notionnel	<ul style="list-style-type: none"> • À l'égard de chaque branche de l'opération, s'il y a lieu. • Pour les opérations sur dérivés de gré à gré négociées en montants monétaires prévoyant un tableau de montants notionnels. • La date non ajustée à laquelle le montant notionnel associé prend fin. 	N

Éléments de données relatifs aux prix

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Diffusion publique
43	Taux de change	Le taux de change des deux monnaies de l'opération sur dérivés de gré à gré dont les contreparties ont convenu au début de l'opération, exprimé en taux de conversion de l'unité monétaire en monnaie cotée.	N
44	Base du taux de change	La paire et l'ordre des monnaies dans lesquelles le taux de change est libellé. Cet élément est exprimé en unité monétaire/monnaie cotée.	N
45	Taux fixe	À l'égard de chaque branche de l'opération, s'il y a lieu : pour les opérations sur dérivés de gré à gré prévoyant des paiements périodiques, le taux annuel de la ou des branches fixes.	O
46	Prix	Le prix indiqué dans l'opération sur dérivés de gré à gré, les frais, droits, taxes ou commissions en sus.	O
47	Monnaie du prix	La monnaie dans laquelle le prix est libellé.	O
48	Notation du prix	La manière dont le prix est exprimé.	O
49	Unité de mesure du prix	L'unité de mesure dans laquelle le prix est exprimé.	N
50	Écart	À l'égard de chaque branche de l'opération, s'il y a lieu : pour les opérations sur dérivés de gré à gré prévoyant des paiement périodiques (par exemple, swaps fixe-variable, swaps variable-variable, swaps sur marchandises).	O
51	Monnaie de l'écart	À l'égard de chaque branche de l'opération, s'il y a lieu : la monnaie dans laquelle l'écart est libellé.	O
52	Notation de l'écart	À l'égard de chaque branche de l'opération, s'il y a lieu : la manière dont est exprimé l'écart.	O
53	Prix d'exercice	<ul style="list-style-type: none"> • Pour les options autres que celles sur devises, les swaptions et les produits semblables, le prix auquel le titulaire de l'option peut acheter ou vendre l'actif sous-jacent. • Pour les options sur devises, le taux de change auquel l'option peut être exercée, exprimé en taux de conversion de l'unité 	O

		monétaire en monnaie cotée. Si le prix d'exercice est inconnu lors de la déclaration d'une nouvelle opération, cet élément est actualisé dès qu'il devient disponible. • Pour les swaps de volatilité et de variance ainsi que les produits semblables, le prix d'exercice de la volatilité est déclaré sous cet élément de données.	
54	Monnaie du prix d'exercice/de la paire de monnaies	• Pour les opérations sur actions, les options sur marchandises et les produits semblables, la monnaie dans laquelle le prix d'exercice est libellé. • Pour les options sur devises, la paire et l'ordre des monnaies dans lesquelles le prix d'exercice est libellé. Cet élément est exprimé en unité monétaire/monnaie cotée.	N
55	Notation du prix d'exercice	La manière dont le prix d'exercice est exprimé.	O
56	Date de prise d'effet non ajustée du prix	La date de prise d'effet non ajustée du prix.	N
57	Date de fin non ajustée du prix	La date de fin non ajustée du prix.	N
58	Prix en vigueur entre la date de prise d'effet non ajustée et la date de fin non ajustée	Le prix en vigueur entre la date de prise d'effet non ajustée et la date de fin non ajustée, inclusivement.	N
59	Date de prise d'effet du prix d'exercice	La date de prise d'effet non ajustée du prix d'exercice.	N
60	Date de fin du prix d'exercice	La date de fin non ajustée du prix d'exercice.	N
61	Prix d'exercice en vigueur à la date de prise d'effet associée	Le prix d'exercice en vigueur entre la date de prise d'effet non ajustée et la date de fin non ajustée, inclusivement.	N
62	Indicateur de modalités non normalisées	Indique si l'opération comporte au moins une modalité ou disposition, outre celles diffusées dans le public, qui influe considérablement sur son prix.	O
63	Convention de calcul des jours	À l'égard de chaque branche de l'opération, s'il y a lieu : la convention de calcul des jours (souvent aussi appelée fraction de compte de jours, base de décompte des jours ou méthode de décompte des jours) qui établit le mode de calcul des paiements d'intérêts. Il sert à déterminer la fraction représentée par la période de calcul dans l'année et correspond au nombre de jours compris dans cette période divisé par le nombre de jours dans l'année.	O
64	Fréquence de révision du taux variable – unité de temps	Pour chaque branche variable de l'opération, s'il y a lieu, l'unité de temps associée à la fréquence des révisions (par exemple, jour, mois, année ou durée du flux).	O
65	Fréquence de révision du taux variable – multiplicateur	À l'égard de chaque branche variable de l'opération, s'il y a lieu, le nombre d'unités de temps (indiqué par la Fréquence de révision du taux variable –	O

		unité de temps) qui détermine la fréquence à laquelle les dates de révision du taux des paiements périodiques surviennent.	
--	--	--	--

Éléments de données relatifs à la compensation

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Diffusion publique
66	Compensé	Indique si l'opération a été ou sera compensée par une chambre de compensation.	O
67	Contrepartie centrale	L'identifiant de la chambre de compensation qui a compensé l'opération.	N
68	Origine du compte de compensation	Indique si un membre compensateur a agi comme contrepartiste pour une chambre de compensation ou comme mandataire pour un client.	N
69	Membre compensateur	L'identifiant du membre compensateur par l'entremise duquel l'opération sur dérivé a été compensée auprès d'une chambre de compensation.	N
70	Horodatage de la réception pour compensation	La date et l'heure, exprimées en temps universel coordonné (UTC), auxquelles la chambre de compensation reçoit le dérivé conclu à l'origine pour compensation et l'enregistre dans son système.	N
71	Exceptions et dispenses de compensation – contrepartie 1	<ul style="list-style-type: none"> • Indique le type d'exception ou de dispense dont la contrepartie 1 a choisi de se prévaloir ou qui lui est par ailleurs ouvert. • Toutes les exceptions et dispenses applicables doivent être sélectionnées. • Les valeurs peuvent être répétées, s'il y a lieu. 	N
72	Exceptions et dispenses de compensation – contrepartie 2	<ul style="list-style-type: none"> • Indique le type d'exception ou de dispense dont la contrepartie 2 a choisi de se prévaloir ou qui lui est par ailleurs ouvert. • Toutes les exceptions et dispenses applicables doivent être sélectionnées. • Les valeurs peuvent être répétées, s'il y a lieu. 	N

Éléments de données relatifs aux sûretés et aux marges

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Diffusion publique
73	Catégorie de sûreté	Indique s'il existe une ou plusieurs conventions de sûreté entre les contreparties (sans sûreté/couverture partielle/couverture à sens unique/couverture entière). Cet élément de données est fourni pour chaque opération ou chaque portefeuille, selon que la constitution de sûreté est faite au niveau de l'opération ou du portefeuille,	N

		et est applicable aux opérations compensées ou non.	
74	Portefeuille contenant un indicateur de composante à ne pas déclarer	Si les sûretés sont déclarées au niveau du portefeuille, indique si ce portefeuille inclut des opérations dispensées de déclaration.	N
75	Marge initiale déposée par la contrepartie déclarante (après décote)	<ul style="list-style-type: none"> • La valeur monétaire de la marge initiale qui a été déposée par la contrepartie déclarante, y compris toute marge en transit et en attente de règlement. • Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge initiale déposée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau des opérations individuelles, elle se rapporte à elles. • Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge initiale après application de la décote (s'il y a lieu), plutôt que de sa variation quotidienne. • L'élément de données concerne les opérations non compensées et celles compensées par contrepartie centrale. Dans le cas de ces dernières, il n'inclut pas les contributions à un fonds de défaillance, ni les sûretés couvrant les apports de liquidité fournis à la chambre de compensation, c'est-à-dire les lignes de crédit à première demande. • Si la marge initiale déposée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme d'une valeur totale. 	N
76	Marge initiale déposée par la contrepartie déclarante (avant décote)	<ul style="list-style-type: none"> • La valeur monétaire de la marge initiale qui a été déposée par la contrepartie déclarante, y compris toute marge en transit et en attente de règlement. • Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge initiale déposée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau des opérations individuelles, elle se rapporte à elles. • Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge initiale, plutôt que de sa variation quotidienne. • L'élément de données concerne les opérations non compensées et celles compensées par contrepartie centrale. Dans le cas de ces dernières, il n'inclut pas les contributions à un fonds de défaillance, ni les sûretés couvrant les apports de liquidité fournie à la chambre de compensation, c'est-à-dire les lignes de crédit à première demande. • Si la marge initiale déposée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme de valeur totale. 	N

77	Monnaie de la marge initiale déposée	<ul style="list-style-type: none"> • La monnaie dans laquelle la marge initiale déposée est libellée. • Si elle est libellée dans plus d'une monnaie, cet élément de données reflète l'une de ces monnaies en lesquelles la contrepartie déclarante a choisi de convertir toutes les valeurs des marges initiales déposées. 	N
78	Marge initiale collectée par la contrepartie déclarante (après décote)	<ul style="list-style-type: none"> • La valeur monétaire de la marge initiale qui a été collectée par la contrepartie déclarante, y compris toute marge en transit et en attente de règlement. • Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge initiale collectée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau des opérations individuelles, elle se rapporte à elles. • Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge initiale après application de la décote (s'il y a lieu), plutôt que de sa variation quotidienne. • L'élément de données concerne les opérations non compensées et celles compensées par contrepartie centrale. Dans le cas de ces dernières, il n'inclut pas les sûretés collectées par la chambre de compensation dans le cadre de son activité d'investissement. • Si la marge initiale collectée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme d'une valeur totale. 	N
79	Marge initiale collectée par la contrepartie déclarante (avant décote)	<ul style="list-style-type: none"> • La valeur monétaire de la marge initiale qui a été collectée par la contrepartie déclarante, y compris toute marge en transit et en attente de règlement. • Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge initiale collectée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau des opérations individuelles, elle se rapporte à elles. • Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge initiale, plutôt que de sa variation quotidienne. • L'élément de données concerne les opérations non compensées et celles compensées par contrepartie centrale. Dans le cas de ces dernières, il n'inclut pas les sûretés collectées par la chambre de compensation dans le cadre de son activité d'investissement. • Si la marge initiale collectée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme d'une valeur totale. 	N
80	Monnaie de la marge initiale collectée	<ul style="list-style-type: none"> • La monnaie dans laquelle la marge initiale collectée est libellée. • Si elle est libellée dans plus d'une 	N

		monnaie, cet élément de données reflète l'une de ces monnaies en lesquelles la contrepartie déclarante a choisi de convertir toutes les valeurs des marges initiales collectées.	
81	Marge de variation déposée par la contrepartie déclarante (après décote)	<ul style="list-style-type: none"> • La valeur monétaire de la marge de variation déposée par la contrepartie 1 (dont celle réglée en espèces), y compris toute marge en transit et en attente de règlement, mais non celle pour éventualités. • Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge de variation déposée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau des opérations individuelles, elle se rapporte à elles. • L'élément de données concerne la valeur actuelle totale de la marge de variation après application de la décote (s'il y a lieu), cumulée depuis la première déclaration des marges de variation déposées pour le portefeuille ou l'opération. • Si la marge de variation déposée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie 1 et présentés sous forme d'une valeur totale. 	N
82	Marge de variation déposée par la contrepartie déclarante (avant décote)	<ul style="list-style-type: none"> • La valeur monétaire de la marge de variation déposée par la contrepartie déclarante (dont celle réglée en espèces), y compris toute marge en transit et en attente de règlement, mais non celle pour éventualités. • Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge de variation déposée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau des opérations individuelles, elle se rapporte à elles. • L'élément de données concerne la valeur actuelle totale de la marge de variation, cumulée depuis la première déclaration des marges de variation déposées pour le portefeuille ou l'opération. • Si la marge de variation déposée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme d'une valeur totale. 	N
83	Monnaie de la marge de variation déposée	<ul style="list-style-type: none"> • La monnaie dans laquelle la marge de variation déposée est libellée. • Si elle est libellée dans plus d'une monnaie, cet élément de données reflète l'une de ces monnaies en lesquelles la contrepartie déclarante a choisi de convertir toutes les valeurs des marges de variation déposées. 	N

84	Marge de variation collectée par la contrepartie déclarante (après décote)	<ul style="list-style-type: none"> • La valeur monétaire de la marge de variation qui a été collectée par la contrepartie 1 (dont celle réglée en espèces), y compris toute marge en transit et en attente de règlement, mais non celle pour éventualités. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge de variation collectée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau des opérations individuelles, elle se rapporte à elles. • Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge de variation collectée après application de la décote (s'il y a lieu), cumulée depuis la première déclaration des marges de variation déposées pour le portefeuille ou l'opération. • Si la marge de variation collectée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie 1 et présentée sous forme d'une valeur totale. 	N
85	Marge de variation collectée par la contrepartie déclarante (avant décote)	<ul style="list-style-type: none"> • La valeur monétaire de la marge de variation collectée par la contrepartie déclarante (dont celle réglée en espèces), y compris toute marge en transit et en attente de règlement, mais non celle pour éventualités. • Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge de variation collectée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau des opérations individuelles, elle se rapporte à elles. • Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge de variation, cumulée depuis la première déclaration des marges de variation collectées pour le portefeuille ou l'opération. • Si la marge de variation collectée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme d'une valeur totale. 	N
86	Monnaie de la marge de variation collectée	<ul style="list-style-type: none"> • La monnaie dans laquelle la marge de variation collectée est libellée. • Si la marge de variation collectée est libellée dans plus d'une monnaie, cet élément de données reflète l'une de ces monnaies en lesquelles la contrepartie déclarante a choisi de convertir toutes les valeurs des marges de variation collectées. 	N
87	Code du portefeuille de sûretés – marge de variation	Si les sûretés sont déclarées au niveau du portefeuille, le code unique attribué par la contrepartie déclarante au portefeuille qui suit la marge de variation globale relative à un ensemble d'opérations ouvertes.	N

88	Code du portefeuille de sûretés – marge initiale	Si les sûretés sont déclarées au niveau du portefeuille, le code unique attribué par la contrepartie déclarante au portefeuille qui suit la marge initiale globale relative à un ensemble d'opérations ouvertes.	N
89	Sûretés excédentaires déposées par la contrepartie 1	<ul style="list-style-type: none"> • La valeur monétaire de toute sûreté supplémentaire déposée par la contrepartie 1 séparément et indépendamment des marges initiale et de variation. Il s'agit de la valeur actuelle totale des sûretés excédentaires avant application de la décote (s'il y a lieu), plutôt que de sa variation quotidienne. • Tout montant de marge initiale ou de variation déposée qui excède le montant requis est déclaré avec la marge initiale déposée ou la marge de variation déposée, respectivement, au lieu d'être inclus en tant que sûreté excédentaire déposée. Dans le cas des opérations compensées par contrepartie centrale, les sûretés excédentaires ne sont déclarées que dans la mesure où elles peuvent être attribuées à un portefeuille ou à une opération en particulier. 	N
90	Monnaie des sûretés excédentaires déposées	<ul style="list-style-type: none"> • La monnaie dans laquelle les sûretés excédentaires déposées sont libellées. • Si les sûretés excédentaires déposées sont libellées dans plus d'une monnaie, cet élément de données reflète l'une de ces monnaies en lesquelles la contrepartie 1 a choisi de convertir toutes les valeurs des sûretés excédentaires déposées. 	N
91	Sûretés excédentaires collectées par la contrepartie 1	<ul style="list-style-type: none"> • La valeur monétaire de toute sûreté supplémentaire collectée par la contrepartie 1 séparément et indépendamment des marges initiale et de variation. Il s'agit de la valeur actuelle totale des sûretés excédentaires avant application de la décote (s'il y a lieu), plutôt que de sa variation quotidienne. • Tout montant de marge initiale ou de variation collectée qui excède le montant requis est déclaré avec la marge initiale collectée ou la marge de variation collectée, respectivement, au lieu d'être inclus en tant que sûreté excédentaire collectée. Dans le cas des opérations compensées par contrepartie centrale, les sûretés excédentaires ne sont déclarées que dans la mesure où elles peuvent être attribuées à un portefeuille ou à une opération en particulier. 	N
92	Monnaie des sûretés excédentaires déposées	<ul style="list-style-type: none"> • La monnaie dans laquelle les sûretés excédentaires collectées sont libellées. • Si les sûretés excédentaires sont libellées dans plus d'une monnaie, cet élément de données reflète l'une de ces monnaies en lesquelles la contrepartie 1 a choisi de convertir toutes les valeurs des sûretés excédentaires collectées. 	N

Éléments de données relatifs aux événements

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Diffusion publique
93	Horodatage de l'événement	<ul style="list-style-type: none"> • La date et l'heure de l'événement établies par la contrepartie déclarante ou un fournisseur de services. • Dans le cas d'un événement de compensation, la date et l'heure auxquelles le dérivé conclu à l'origine est accepté par la chambre de compensation et enregistré dans son système devraient être déclarées sous cet élément de données. • Cet élément temporel est aussi précis qu'il est technologiquement possible de le faire. 	O
94	Niveau	Indique si la déclaration s'effectue au niveau de l'opération ou à celui de la position. La déclaration au niveau de la position ne peut être faite qu'en complément de celle au niveau de l'opération afin de déclarer des événements du cycle de vie postérieurs à l'opération, et qu'uniquement si des opérations individuelles sur des produits fongibles ont été remplacées par la position.	N
95	Identifiant d'événement	L'identifiant unique permettant de lier des opérations sur dérivés résultant d'un événement comme la compression ou un événement de crédit. Il peut être attribué par la contrepartie déclarante ou un fournisseur de services.	N
96	Type d'événement	Explication ou motif de l'action posée à l'égard de l'opération sur dérivé.	O
97	Type d'action	Type d'action posée à l'égard de l'opération sur dérivé ou type de déclaration de fin de journée.	O
98	Indicateur de modification	Indique si la modification de l'opération de swap rend compte de la nouvelle version convenue des modalités négociées antérieurement.	O

Éléments de données relatifs à la valorisation

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Diffusion publique
99	Montant de valorisation	<ul style="list-style-type: none"> • La valeur actuelle du contrat en cours. • Le montant de valorisation est exprimé en coût de sortie du contrat ou de ses composantes, c'est-à-dire le prix auquel il serait vendu (sur le marché dans le cadre d'une opération en règle à la date de valorisation). 	N
100	Monnaie de valorisation	La monnaie dans laquelle le montant de valorisation est libellé.	N

101	Méthode de valorisation	<ul style="list-style-type: none"> • La source et la méthode utilisées pour la valorisation de l'opération par la contrepartie déclarante. • S'il est utilisé au moins une donnée de valorisation classée sous la catégorie « selon un modèle » (<i>mark-to-model</i>), alors toute la valorisation entre dans cette catégorie. • Si seules sont utilisées des données de valorisation classées dans la catégorie « à la valeur de marché », alors toute la valorisation entre dans cette catégorie. 	N
102	Horodatage de la valorisation	<ul style="list-style-type: none"> • La date et l'heure de la dernière valorisation à la valeur de marché, fournie par la chambre de compensation ou calculée à l'aide du prix du marché en vigueur ou du dernier prix du marché des données d'entrée. • Si, par exemple, le taux de change d'une monnaie est à la base de la valorisation d'une opération, alors l'horodatage de la valorisation indique le moment où ce taux était en vigueur. 	N
103	Prochaine date de révision du taux variable de référence	La prochaine date à laquelle le taux variable de référence est révisé.	N
104	Dernière valeur du taux variable de référence	L'échantillonnage le plus récent de la valeur du taux variable servant au calcul des flux de trésorerie. Se rapporte à l'élément de données Dernière date de révision du taux variable de référence.	N
105	Dernière date de révision du taux variable de référence	La date de l'échantillonnage le plus récent de la valeur du taux variable servant au calcul des flux de trésorerie. Se rapporte à l'élément de données Dernière valeur du taux variable de référence.	N
106	Delta	Le coefficient exprimant le rapport entre la variation du prix d'une opération et la variation du prix/cours du sous-jacent, au moment où une nouvelle opération ou une variation du montant notionnel est déclarée.	N

Éléments de données relatifs aux paquets

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Diffusion publique
107	Identifiant de paquet d'opérations	<p>L'identifiant (établi par la contrepartie déclarante) visant à lier :</p> <ul style="list-style-type: none"> • au moins deux opérations qui sont déclarées séparément par la contrepartie déclarante, mais négociées ensemble en tant que produit d'une seule entente économique; • au moins deux rapports relatifs à la même opération dès lors que l'obligation de déclaration dans un territoire ne permet pas sa déclaration dans un seul 	N

		<p>rapport aux référentiels centraux.</p> <p>Un paquet peut contenir des opérations à déclarer et d'autres n'ayant pas à l'être.</p> <p>Si l'Identifiant du paquet d'opérations est inconnu lors de la déclaration d'une nouvelle opération, cet élément d'information est actualisé dès qu'il devient disponible.</p>	
108	Prix du paquet d'opérations	<ul style="list-style-type: none"> • Le prix négocié de l'ensemble du paquet dont l'opération sur dérivé déclarée est une composante. • Les prix et les éléments de données connexes des opérations (Monnaie du prix, Notation du prix, Unité de mesure du prix) qui représentent les composantes individuelles du paquet sont déclarés lorsqu'ils sont disponibles. • Le Prix du paquet d'opérations peut être inconnu lors de la déclaration d'une nouvelle opération, mais il est possible de l'actualiser plus tard. 	N
109	Monnaie du prix du paquet d'opérations	La monnaie dans laquelle le Prix du paquet d'opérations est libellé.	N
110	Écart du paquet d'opérations	<ul style="list-style-type: none"> • Le prix négocié de l'ensemble du paquet dont l'opération sur dérivé déclarée est une composante. • Le Prix du paquet d'opérations lorsque le prix est exprimé en écart, soit la différence entre deux prix de référence. • L'écart et les éléments de données connexes des opérations (monnaie de l'écart) qui représentent les composantes individuelles du paquet sont déclarés quand ils sont disponibles. • L'Écart du paquet d'opérations peut être inconnu lors de la déclaration d'une nouvelle opération, mais il est possible de l'actualiser plus tard. 	N
111	Monnaie de l'écart du paquet d'opérations	La monnaie dans laquelle l'Écart du paquet d'opérations est libellé.	N
112	Notation de l'écart du paquet d'opérations	La manière dont l'Écart du paquet d'opérations est exprimé.	N
113	Notation du prix du paquet d'opérations	La manière dont le Prix du paquet d'opérations est exprimé.	N
114	Indicateur de paquet	Indique si l'opération de swap fait partie du paquet d'opérations.	O

Éléments de données relatifs au produit

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Diffusion publique
115	Identifiant unique de produit	Un ensemble unique de caractères qui représente le dérivé de gré à gré.	O
116	Point d'attachement de l'indice de swaps sur défaillance	Le point inférieur défini auquel le niveau de pertes du portefeuille sous-jacent réduit le notionnel d'une tranche.	N

117	Point de détachement de l'indice de swaps sur défaillance	Le point défini au-delà duquel les pertes du portefeuille sous-jacent ne réduisent plus le notionnel d'une tranche.	N
118	Facteur d'indice	Le facteur ou pourcentage de la version de l'indice, exprimé en valeur décimale, qui, multiplié par le Montant notionnel, donne le montant notionnel couvert par le vendeur de la protection du swap sur défaillance.	O
119	Dérivé sur cryptoactifs	Indique si le dérivé repose sur des cryptoactifs.	N
120	Code du panier sur mesure	Si l'opération sur dérivé repose sur un panier sur mesure, le code unique attribué par le structurateur du panier afin de lier ses composantes.	N
121	Indicateur de panier sur mesure	Indique que le dérivé repose sur un panier sur mesure.	N
122	Source de l'identifiant des composantes du panier	La source des identifiants des sous-jacents qui représentent les composantes d'un panier sur mesure.	N
123	Identifiant des composantes du panier	Les sous-jacents qui représentent les composantes d'un panier sur mesure.	N
124	Type d'option incorporée	Le type d'option ou de disposition facultative incorporée dans un contrat.	O

Éléments de données relatifs aux paiements et au règlement

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Diffusion publique
125	Date contractuelle de règlement définitif	Date non ajustée prévue par le contrat à laquelle tous les transferts d'espèces ou d'actifs devraient avoir lieu et les contreparties ne devraient plus avoir d'obligations réciproques impayées en vertu du contrat.	N
126	Lieu de règlement	Le lieu de règlement de l'opération prévu dans le contrat. Cet élément de données ne s'applique qu'aux opérations visant une monnaie étrangère (soit une monnaie ne figurant pas sur la liste de monnaies de la norme ISO 4217, par exemple le CNH).	N
127	Monnaie de règlement	<ul style="list-style-type: none"> La monnaie du règlement en espèces, le cas échéant. Pour les produits en plusieurs monnaies qui ne sont pas compensés, la monnaie de règlement de chaque branche. 	O
128	Payeur de l'autre paiement	L'identifiant du payeur du Montant de l'autre paiement.	N
129	Receveur de l'autre paiement	L'identifiant du receveur du Montant de l'autre paiement.	N
130	Type d'autre paiement	<ul style="list-style-type: none"> Le type de Montant de l'autre paiement. Le paiement de la prime de l'option n'est pas inclus en tant que type de paiement, car les primes de la sorte sont déclarées à l'aide de l'élément de données qui y est consacré. 	O
131	Montant de l'autre paiement	Les montants de paiement avec les types de paiements correspondants afin de tenir	O

		compte des obligations relatives aux descriptions des opérations pour différentes catégories d'actifs.	
132	Monnaie de l'autre paiement	La monnaie dans laquelle le Montant de l'autre paiement est libellé.	O
133	Date de l'autre paiement	La date non ajustée à laquelle le Montant de l'autre paiement est versé.	N
134	Fréquence des paiements – unité de temps	À l'égard de chaque branche de l'opération, s'il y a lieu : l'unité de temps associée à la fréquence des paiements, par exemple, jour, mois, année ou durée du flux.	O
135	Fréquence des paiements – multiplicateur	À l'égard de chaque branche de l'opération, s'il y a lieu : le nombre d'unités de temps (exprimé par la Fréquence des paiements – unité de temps) qui détermine la fréquence à laquelle les dates des paiements périodiques surviennent.	O
136	Montant de la prime de l'option	Pour les options et les swaptions de toutes les catégories d'actifs, le montant monétaire payé par l'acheteur de l'option.	O
137	Monnaie de la prime de l'option	Pour les options et les swaptions de toutes les catégories d'actifs, la monnaie dans laquelle le montant de la prime de l'option est libellé.	O
138	Date de paiement de la prime de l'option	La date non ajustée à laquelle la prime de l'option est payée.	N
139	Première date d'exercice	La première date non ajustée à laquelle une option peut être exercée durant la période d'exercice. Pour les options de type européen, cette date correspond à la Date d'expiration. Pour celles de type américain, la première date d'exercice possible est la date non ajustée indiquée dans l'Horodatage de l'exécution. Dans le cas des options barrières activantes, lorsque la première date d'exercice est inconnue au moment de la déclaration d'une nouvelle opération, cet élément de données est actualisé lorsqu'elle devient disponible.	O
140	Date de fixation	La date précise à laquelle est fixé à un contrat à terme de gré à gré non livrable, ainsi qu'à divers types d'options sur devises de gré à gré comme les options réglées en espèces, un taux de change particulier, qui servira à calculer le règlement en espèces ultime.	N

».

31. L'Annexe C de ce règlement est modifiée :

1° par la suppression de l'intitulé « **Instructions** »;

2° dans la rubrique 1 :

a) par le remplacement, dans ce qui précède le paragraphe *a*, des mots « les données » par les mots « l'information indiquée à l'Annexe A vis-à-vis de laquelle

apparaît un « O » dans la colonne intitulée « Diffusion publique » ainsi que les éléments de données »;

b) par le remplacement, dans le paragraphe a, des mots « une opération » par les mots « toute opération »;

c) par le remplacement, dans le paragraphe b, des mots « un événement » par les mots « tout événement »;

d) par le remplacement, dans le paragraphe c, des mots « l'annulation ou la correction » par les mots « toute annulation ou correction »;

e) par le remplacement du tableau 1 et du tableau 2 par les suivants :

« **Tableau 1** »

#	Nom de l'élément de données	Définition de l'élément de données	Format	Valeurs admissibles
D1	Identifiant de diffusion	L'identifiant unique et aléatoire généré par le référentiel central pour chaque message publiquement diffusé.	Varchar(52)	Jusqu'à 52 caractères alphanumériques
D2	Identifiant de diffusion initiale	Pour les types d'actions autres que « Nouveau », cet identifiant correspond à l'Identifiant de diffusion des données sur l'opération initiale et des données sur le prix initial publiquement diffusées.	Varchar(52)	Jusqu'à 52 caractères alphanumériques
D3	Horodatage de la diffusion	La date et l'heure, à la seconde près, de la diffusion publique par un référentiel central.	YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ, exprimé en temps universel coordonné (UTC)	Toute représentation valide de la date et de l'heure selon le format de la norme ISO 8601.
D4	Nom abrégé de l'identifiant unique de produit	Une description lisible par l'humain que fournit l'émetteur de l'identifiant unique de produit (UPI) et qui correspond à l'UPI.	Une liste contenant les valeurs admissibles et leur format sera publiée par l'émetteur de l'UPI.	Une liste contenant les valeurs admissibles et leur format sera publiée par l'émetteur de l'UPI.

« **Tableau 2** »

Catégorie d'actifs	Identifiant de l'actif sous-jacent
Taux d'intérêt	CAD-BA-CDOR
Taux d'intérêt	USD-LIBOR-BBA
Taux d'intérêt	EUR-EURIBOR-Reuters
Taux d'intérêt	GBP-LIBOR-BBA

Crédit	Tous les indices
Capitaux propres	Tous les indices

»;

3° par le remplacement, dans le tableau 4, des mots « **d'échéance** » par les mots « **d'expiration** »;

4° par le remplacement, dans la rubrique 7, de « figurant dans le Tableau 1 » par le mot « requise »;

5° par l'addition, après la rubrique 7, de la suivante :

« **8.** S'il est technologiquement impossible au référentiel central reconnu de diffuser l'information requise 48 heures après l'heure et la date indiquées dans le champ « Horodatage de l'exécution » de l'opération en raison des périodes d'interruption nécessaires pour la maintenance opérationnelle, les mises à niveau et réparations des systèmes, les exercices de reprise après sinistre ou tout autre exercice relatif à son exploitation conformément au présent règlement et à sa décision de reconnaissance, il la diffuse dès que technologiquement possible après la conclusion de la période d'interruption. ».

32. L'Annexe 91-507A1 de ce règlement est modifiée par le remplacement, partout où ils se trouvent, des mots « livres et dossiers » par le mot « dossiers ».

33. L'Annexe 91-507A2 de ce règlement est modifiée :

1° par le remplacement, dans l'intitulé, du mot « **RECONNAISSANCE** » par les mots « **DE DÉSIGNATION** »;

2° par le remplacement, dans les rubriques 8, 9 et 10, des mots « et de reconnaissance » par les mots « et de désignation »;

3° par le remplacement, partout où il se trouve dans l'alinéa sous l'intitulé « **CONSENTEMENT À AGIR COMME MANDATAIRE AUX FINS DE SIGNIFICATION** », du mot « reconnaissance » par le mot « désignation ».

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