

chapitre I-14.01, r. 1.1

## **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, 1er al., par. 2, 3, 9, 12, 26, 27 et 29)

### **CHAPITRE 1 DÉFINITIONS ET INTERPRÉTATION**

#### **Définitions et interprétation**

1) Dans le présent règlement, on entend par:

«banque de l'annexe III»: une banque étrangère autorisée figurant à l'annexe III de la Loi sur les banques (L.C. 1991, c. 46);

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

«chambre de compensation déclarante»: les entités suivantes:

a) une personne reconnue ou dispensée de l'obligation de reconnaissance à titre de chambre de compensation par l'Autorité en vertu de la Loi sur les instruments dérivés (chapitre I-14.01);

b) une chambre de compensation ayant souscrit un engagement, accepté par l'Autorité, d'agir à titre de contrepartie déclarante aux fins de l'exécution de l'obligation de déclaration prévue par le présent règlement;

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

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

«contrepartie déclarante»: la contrepartie à un dérivé visé à l'article 25 qui est tenue de déclarer les données sur les dérivés conformément à l'article 26;

«contrepartie déclarante agréée»: les contreparties déclarantes suivantes:

- a) une personne assujettie à l'obligation d'inscription à titre de courtier en vertu de la Loi;
- b) une institution financière canadienne;
- c) une chambre de compensation déclarante;
- d) une entité du même groupe qu'une personne visée au paragraphe a ou b;

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

- a) une personne qui a été constituée en vertu des lois du Québec ou qui a son siège ou son établissement principal au Québec;
- b) une personne assujettie à l'obligation d'inscription à titre de courtier en vertu de la Loi;
- c) une entité du même groupe qu'une personne à laquelle le paragraphe a s'applique, cette personne étant responsable de la totalité ou de la quasi totalité des passifs de la contrepartie;

«courtier en dérivés visé par le seuil de montant notionnel»: la personne assujettie à l'obligation d'inscription à titre de courtier en vertu de la Loi à laquelle le paragraphe 1 ou 2 de l'article 44 du Règlement 93-101 sur la conduite commerciale en dérivés approuvé par l'arrêté ministériel numéro I-14.01-2023-21 du ministre des Finances en date du 5 décembre 2023 (2023), 51 G.O. Il s'applique;

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

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

«données à communiquer à l'exécution»: les données relatives aux éléments figurant à l'Annexe A, sauf celles des rubriques «Éléments de données relatifs aux sûretés et aux marges» et «Éléments de données relatifs à la valorisation»;

«données de valorisation»: les données relatives aux éléments figurant aux rubriques «Éléments de données relatifs à la valorisation» et «Éléments de données relatifs aux actions et aux événements» de l'Annexe A;

«données sur les événements du cycle de vie»: les modifications des données à communiquer à l'exécution qui résultent d'un événement du cycle de vie ainsi que des données relatives aux éléments figurant à la rubrique «Éléments de données relatifs aux actions et aux événements» de l'Annexe A;

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

«données sur les positions»: les données sur les événements du cycle de vie, les données de valorisation et les données sur les sûretés et les marges, présentées respectivement de façon agrégée;

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

«événement du cycle de vie»: un événement qui entraîne un changement dans les données sur les dérivés déclarées antérieurement à un référentiel central reconnu au sujet d'un dérivé;

«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);

«participant»: une personne qui a conclu avec le référentiel central reconnu une convention l'autorisant à avoir accès aux services de ce dernier;

«procédure de validation»: toute règle, politique ou procédure écrite raisonnablement conçue pour valider le fait que les données sur les dérivés déclarées en vertu du présent règlement satisfont aux éléments de données figurant à l'Annexe A;

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

«transaction»: la conclusion, la cession, la vente ou toute autre forme d'acquisition ou d'aliénation d'un dérivé ou la novation d'un dérivé;

«UTI»: un identifiant unique de transaction;

«utilisateur»: à l'égard d'un référentiel central reconnu, une contrepartie, ou son représentant, à un dérivé déclaré à ce référentiel central reconnu en vertu du présent règlement.

2) Dans le présent règlement, les expressions «entreprise ayant une obligation d'information du public», «NAGR américaines de l'AICPA», «NAGR américaines du PCAOB», «normes d'audit», «PCGR américains» et «principes comptables» s'entendent au sens du Règlement 52-107 sur les principes comptables et les normes d'audit acceptables (chapitre V-1.1, r. 25).

3) Dans le présent règlement, 2 personnes sont des entités du même groupe si l'une contrôle l'autre ou qu'elles sont contrôlées par la même personne..

4) Dans le présent règlement, une personne est considérée comme exerçant le contrôle d'une autre personne dans les cas suivants:

a) elle a la propriété véritable de titres de cette autre personne lui assurant un nombre de votes suffisant pour élire la majorité des administrateurs de celle-ci ou exerce directement ou indirectement une emprise sur de tels titres, à moins qu'elle ne les détienne qu'en garantie d'une obligation;;

b) dans le cas d'une société de personnes autre qu'une société en commandite, elle détient plus de 50% des parts sociales;

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.

5) (*paragraphe abrogé*).

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.

6) Dans le présent règlement, l'expression «liens» s'entend au sens de l'article 5 de la Loi sur les valeurs mobilières (chapitre V-1.1).

7) Dans le présent règlement, l'expression «période intermédiaire» a le sens qui lui est donné à l'article 1.1 du Règlement 51-102 sur les obligations d'information continue (chapitre V-1.1, r. 24).

A.M. 2013-21, a. 1; A.M. 2014-08, a. 1; A.M. 2016-10, a. 1; A.M. 2023-16, a. 1; A.M. 2024-15, a. 1.

## **Champ d'application**

**1.1.** *(Abrogé).*

A.M. 2013-21, a. 1.1; A.M. 2016-10, a. 2.

## **CHAPITRE 2 RECONNAISSANCE D'UN RÉFÉRENTIEL CENTRAL ET OBLIGATIONS CONTINUES**

### **Reconnaissance et premier dépôt d'information d'un référentiel central**

**2.** 1) Le candidat qui demande la reconnaissance en vertu des articles 12 et 14 de la Loi dépose le formulaire prévu à l'Annexe 91-507A1 dûment rempli.

2) Outre l'obligation prévue au paragraphe 1, le candidat qui demande la reconnaissance en vertu des articles 12 et 14 de la Loi et dont le siège ou l'établissement principal est situé à l'extérieur du Québec doit:

*a)* attester dans le formulaire prévu à l'Annexe 91-507A1 qu'il mettra ses dossiers à la disposition de l'Autorité et qu'il se soumettra aux inspections et examens effectués sur place par l'Autorité;

*b)* attester dans le formulaire prévu à l'Annexe 91-507A1 qu'il fournira à l'Autorité un avis juridique indiquant qu'il a le pouvoir de faire ce qui suit:

*i)* mettre ses dossiers à la disposition de l'Autorité;

*ii)* se soumettre aux inspections et examens effectués sur place par l'Autorité.

3) Outre les obligations prévues aux paragraphes 1 et 2, le candidat qui demande la reconnaissance en vertu des articles 12 et 14 de la Loi et dont le siège ou l'établissement principal est situé dans un territoire étranger dépose le formulaire prévu à l'Annexe 91-507A2 dûment rempli.

4) Le candidat dépose une modification du formulaire établi selon l'Annexe 91-507A1 de la façon qui y est indiquée dans un délai de 7 jours après avoir eu connaissance d'une inexactitude dans l'information qu'il contient ou avoir modifié cette information.

A.M. 2013-21, a. 2; A.M. 2016-10, a. 3.

### **Modification de l'information**

3. 1) Sous réserve du paragraphe 2, le référentiel central reconnu ne peut mettre en œuvre un changement significatif touchant l'information fournie au formulaire prévu à l'Annexe 91-507A1 que s'il a déposé une modification de ce formulaire de la façon qui y est indiquée au moins 45 jours avant la mise en œuvre du changement.

2) Le référentiel central reconnu dépose une modification de l'information fournie à l'Annexe I de l'Annexe 91-507A1 de la façon qui y est indiquée au moins 15 jours avant de mettre en œuvre tout changement à cette information.

3) En cas de changement touchant l'information fournie au formulaire prévu à l'Annexe 91-507A1, à l'exception d'un changement visé au paragraphe 1 ou 2, le référentiel central reconnu dépose une modification de ce formulaire de la façon qui y est indiquée au moins une fois par année.

A.M. 2013-21, a. 3 ; A.M. 2024-15, a. 2.

### **Dépôt des premiers états financiers audités**

4. 1) Le candidat à la reconnaissance en vertu des articles 12 et 14 de la Loi dépose auprès de l'Autorité les états financiers audités de son dernier exercice.

2) Les états financiers visés au paragraphe 1 remplissent les conditions suivantes:

a) ils sont établis conformément à l'un des ensembles de principes suivants:

i) les PCGR canadiens applicables aux entreprises ayant une obligation d'information du public;

ii) les IFRS;

iii) les PCGR américains, si la personne est constituée en vertu des lois des États-Unis d'Amérique ou d'un territoire des États-Unis d'Amérique;

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

c) ils indiquent la monnaie de présentation;

d) ils sont audités conformément aux normes suivantes, selon le cas:

i) les NAGR canadiennes;



*iii)* les PCGR américains, si la personne est constituée en vertu des lois des États-Unis d'Amérique ou d'un territoire des États-Unis d'Amérique;

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

A.M. 2013-21, a. 5; A.M. 2016-10, a. 5

### **Cessation d'activité**

**6.** 1) Le référentiel central reconnu qui entend cesser son activité au Québec en fait la demande et dépose le rapport prévu à l'Annexe 91-507A3 au moins 180 jours avant la date prévue de la cessation de son activité.

2) Le référentiel central reconnu qui cesse involontairement son activité au Québec dépose le rapport prévu à l'Annexe 91-507A3 dès que possible après la cessation de son activité.

A.M. 2013-21, a. 6.

### **Cadre juridique**

**7.** 1) Le référentiel central reconnu établit, met en œuvre, maintient et applique des règles, politiques et procédures écrites raisonnablement conçues pour conférer à chaque aspect important de ses activités un fondement juridique bien établi, clair, transparent et exécutoire.

2) Sans que soit limitée la portée générale du paragraphe 1, le référentiel central reconnu établit, met en œuvre, maintient et applique des règles, politiques et procédures écrites qui ne sont pas contraires à l'intérêt public et qui sont raisonnablement conçues pour garantir ce qui suit:

*a)* les règles, politiques et procédures ainsi que ses contrats sont conformes aux lois auxquelles ils sont soumis, et tout risque important découlant d'un conflit entre les lois du Québec et celles d'un autre territoire du Canada ou d'un territoire étranger applicables à un contrat conclu avec ses participants est raisonnablement atténué;

*b)* les droits et les obligations de l'utilisateur, du propriétaire et de l'organisme de réglementation relativement à l'utilisation de l'information détenue par le référentiel central reconnu sont clairs et transparents;

*c)* les conventions contractuelles qu'il conclut et les documents à l'appui indiquent clairement les niveaux de service, les droits d'accès, la protection des renseignements confidentiels, les droits de propriété intellectuelle et la fiabilité opérationnelle;

d) le statut des dossiers des contrats figurant dans son répertoire et le fait que ces dossiers constituent ou non des contrats juridiques sont clairement définis.

A.M. 2013-21, a. 7 ; A.M. 2024-15, a. 3.

## **Gouvernance**

8. 1) Le référentiel central reconnu établit, met en œuvre et maintient des mécanismes de gouvernance écrits qui réunissent les conditions suivantes:

a) ils établissent une structure organisationnelle claire avec des responsabilités et des chaînes de reddition de comptes directes, dont les rôles et responsabilités en matière de détermination, de mesure, de surveillance et de gestion des risques;

a.1) ils établissent un cadre de gestion du risque clair qui comprend le niveau de tolérance aux risques propres au référentiel central reconnu;

a.2) ils établissent des processus décisionnels, notamment en situation de crise ou d'urgence, et des règles de reddition de comptes sur les décisions prises relativement aux risques;

b) ils comprennent des mécanismes efficaces de contrôle interne;

c) ils assurent sa sécurité et son efficacité et permettent aux participants d'accéder efficacement à ses services de déclaration des données sur les dérivés;

d) ils assurent une bonne surveillance à son égard;

e) ils soutiennent la stabilité du système financier dans son ensemble et d'autres éléments d'intérêt public pertinents.

2) Le référentiel central reconnu établit, met en œuvre, maintient et applique des règles, des politiques et des procédures écrites raisonnablement conçues pour relever et gérer les conflits d'intérêt existants ou potentiels.

3) Le référentiel central reconnu met l'information suivante à la disposition du public sur son site Web:

a) les mécanismes de gouvernance établis conformément au paragraphe 1;

b) les règles, politiques et procédures établies conformément au paragraphe 2.

A.M. 2013-21, a. 8 ; A.M. 2024-15, a. 4.

## **Conseil d'administration**

9. 1) Le référentiel central reconnu est doté d'un conseil d'administration.

2) Le conseil d'administration du référentiel central reconnu remplit les conditions suivantes:

a) il se compose de personnes physiques qui ont les compétences et l'expérience nécessaires pour surveiller efficacement et avec efficacité la gestion de ses activités conformément à la législation applicable;

b) il compte une proportion adéquate de personnes physiques qui sont indépendantes du référentiel central reconnu.

3) Le conseil d'administration, en consultation avec le chef de la conformité du référentiel central reconnu, résout les conflits d'intérêts relevés par ce dernier.

4) Le conseil d'administration du référentiel central reconnu rencontre régulièrement le chef de la conformité.

5) Le référentiel central reconnu établit, met en œuvre et maintient des politiques et des procédures d'évaluation régulière de la performance globale du conseil d'administration et de chacun de ses membres.

A.M. 2013-21, a. 9 ; A.M. 2024-15, a. 5.

## **Direction**

**10.** 1) Le référentiel central reconnu établit, met en œuvre, maintient et applique des règles, des politiques et des procédures écrites qui réunissent les conditions suivantes:

a) elles précisent les rôles et les responsabilités des membres de la direction;

b) elles assurent que les membres de la direction possèdent l'expérience, l'intégrité ainsi que les compétences nécessaires pour s'acquitter de leurs rôles et de leurs responsabilités.

2) Lorsqu'il nomme ou remplace le chef de la conformité, le chef de la direction ou le chef de la gestion du risque, le référentiel central reconnu en avise l'Autorité au plus tard le 5<sup>e</sup> jour ouvrable suivant la nomination ou le remplacement.

A.M. 2013-21, a. 10.

## **Chef de la conformité**

**11.** 1) Le conseil d'administration du référentiel central reconnu nomme un chef de la conformité qui possède l'expérience pertinente, l'intégrité ainsi que les compétences nécessaires pour exercer ces fonctions.

2) Le chef de la conformité relève directement du conseil d'administration ou, à l'appréciation du conseil d'administration, du chef de la direction du référentiel central reconnu.

3) Le chef de la conformité a les responsabilités suivantes:

a) établir, mettre en œuvre, maintenir et appliquer des règles, des politiques et des procédures écrites permettant de relever et de résoudre les conflits d'intérêts;

b) établir, mettre en œuvre, maintenir et appliquer des règles, des politiques et des procédures écrites permettant d'assurer la conformité du référentiel central reconnu à la législation en valeurs mobilières;

c) veiller constamment au respect des règles, politiques et procédures visées aux paragraphes a et b;

d) signaler dès que possible au conseil d'administration du référentiel central reconnu toute situation indiquant que le référentiel central reconnu ou une personne physique agissant en son nom a commis un manquement au droit des valeurs mobilières qui présente l'une des caractéristiques suivantes:

i) il risque de causer un préjudice à un utilisateur;

ii) il risque de causer un préjudice aux marchés des capitaux;

iii) il s'agit d'un manquement récurrent;

iv) il peut nuire à la capacité du référentiel central reconnu d'exercer son activité conformément à la législation en valeurs mobilières.

e) signaler dès que possible au conseil d'administration du référentiel central reconnu tout conflit d'intérêts qui pose un risque de préjudice pour un utilisateur ou les marchés des capitaux;

f) établir et attester un rapport annuel sur la conformité à la législation en valeurs mobilières du référentiel central reconnu et des personnes physiques qui agissent en son nom et présenter ce rapport au conseil d'administration.

4) Concurrément à la présentation du rapport ou au signalement visé au sous-paragraphes d, e ou f du paragraphe 3, le chef de la conformité dépose une copie du rapport ou du signalement auprès de l'Autorité.

A.M. 2013-21, a. 11.

## **Tarifcation**

**12.** Les frais et les autres coûts importants que le référentiel central reconnu fait porter à ses participants remplissent les conditions suivantes:

a) ils sont répartis équitablement entre les participants;

b) ils sont publiés en tout temps sur son site Web pour chaque service de collecte et de maintien des données sur les dérivés;

- c) ils sont régulièrement révisés, au moins à deux années civiles d'intervalle.

A.M. 2013-21, a. 12 ; A.M. 2024-15, a. 7.

### **Accès aux services du référentiel central reconnu**

**13.** 1) Le référentiel central reconnu établit, met en œuvre, maintient et applique des règles, des politiques et des procédures écrites prévoyant des critères de participation objectifs, fondés sur le risque et qui assurent un accès libre et équitable à ses services.

2) Le référentiel central reconnu met à la disposition du public sur son site Web les règles, politiques et procédures visées au paragraphe 1.

3) Le référentiel central reconnu ne peut faire ce qui suit:

- a) interdire à une personne l'accès à ses services ou lui imposer des conditions d'accès ou d'autres limites à cet égard sans motif valable;

- b) permettre une discrimination déraisonnable entre les participants;

- c) imposer à la concurrence un fardeau qui n'est pas raisonnablement nécessaire et approprié;

- d) exiger qu'une personne utilise ou acquière un autre service pour pouvoir utiliser son service de déclaration d'opérations.

A.M. 2013-21, a. 13.

### **Réception des données sur les dérivés**

**14.** Le référentiel central reconnu ne peut refuser de recevoir des données sur les dérivés que lui déclarent les participants à l'égard de tous les dérivés d'une catégorie d'actifs visée dans sa décision de reconnaissance et de tous les éléments de données figurant à l'Annexe A.

A.M. 2013-21, a. 14 ; A.M. 2024-15, a. 8.

### **Procédures et norms de communication**

**15.** Le référentiel central reconnu doit appliquer des procédures et normes de communication internationalement reconnues pertinentes, ou en permettre l'application, en vue de favoriser l'échange efficient de données entre ses systèmes et ceux des entités suivantes:

- a) les participants;

- b) d'autres référentiels centraux;

c) les bourses, chambres de compensation, systèmes de négociation parallèles et autres marchés;

d) les autres fournisseurs de services.

A.M. 2013-21, a. 15 ; A.M. 2024-15, a. 9.

### **Application régulière**

**16.** 1) Avant de prendre une décision ayant un effet défavorable direct sur un participant ou sur un candidat à la qualité de participant, le référentiel central reconnu lui donne l'occasion d'être entendu.

2) Le référentiel central reconnu consigne ses décisions, les motive et en permet la consultation, notamment, pour chaque candidat ou participant, les raisons pour lesquelles l'accès est accordé, limité ou refusé.

A.M. 2013-21, a. 16 ; A.M. 2024-15, a. 10.

### **Règles, politiques et procédures**

**17.** 1) Les règles, politiques et procédures du référentiel central reconnu réunissent les conditions suivantes:

a) fournir aux participants suffisamment d'information pour leur permettre de bien comprendre leurs droits et leurs obligations relativement à l'accès aux services du référentiel central reconnu ainsi que les risques, frais et autres coûts importants auxquels ils s'exposent en les utilisant;

b) être raisonnablement conçues de manière à régir tous les aspects des services du référentiel central reconnu qui se rapportent à la collecte et au maintien des données sur les dérivés et des autres renseignements relatifs à un dérivé;

c) ne pas être incompatibles avec la législation en valeurs mobilières.

2) Le référentiel central reconnu surveille en permanence la conformité à ses règles, à ses politiques et à ses procédures.

3) Le référentiel central reconnu établit, met en œuvre, maintient et applique des règles, des politiques et des procédures écrites de sanction du non-respect de ses règles, politiques et procédures;

4) Le référentiel central met l'information suivante à la disposition du public sur son site Web:

a) les règles, politiques et procédures visées dans le présent article;

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

A.M. 2013-21, a. 17; A.M. 2024-15, a. 11.

### **Dossiers des données déclarées**

**18.** 1) Le référentiel central reconnu établit des procédures de tenue de dossiers garantissant que les données sur les dérivés sont consignées sans erreur ni omission et en temps opportun.

2) Le référentiel central reconnu conserve en lieu sûr et sous une forme durable les dossiers des données sur les dérivés pendant 7 ans suivant la date d'expiration ou de fin du dérivé.

3) Pendant la période prévue au paragraphe 2, le référentiel central reconnu crée au moins une copie de chaque dossier des données sur les dérivés à conserver en vertu de ce paragraphe et la conserve en lieu sûr et sous une forme durable dans un endroit distinct du dossier original.

A.M. 2013-21, a. 18; A.M. 2024-15, a. 12.

### **Cadre de gestion globale des risques**

**19.** Le référentiel central reconnu établit, met en œuvre et maintient un cadre écrit de gestion globale des risques visant notamment les risques d'entreprise, juridique et opérationnel.

A.M. 2013-21, a. 19.

### **Risque d'activité**

A.M. 2013-21; A.M. 2016-10, a. 6.

**20.** 1) Le référentiel central reconnu établit, met en œuvre et maintient des procédures, des systèmes et des contrôles adéquats pour relever, pour surveiller et pour gérer son risque d'activité.

2) Sans que soit limitée la portée générale du paragraphe 1, le référentiel central reconnu souscrit une assurance suffisante et détient suffisamment d'actifs liquides nets financés par capitaux propres pour couvrir ses pertes économiques générales éventuelles afin d'assurer la continuité de ses activités et services et d'assurer la reprise ou la cessation ordonnée des activités si ces pertes se réalisaient.

3) Pour l'application du paragraphe 2, le référentiel central reconnu détient des actifs liquides nets financés par capitaux propres représentant au moins 6 mois de charges opérationnelles courantes.

4) Le référentiel central reconnu définit les scénarios qui pourraient empêcher la continuité de ses activités et de ses services essentiels et évalue l'efficacité d'une grande variété d'options de cessation ordonnée de ses activités.

5) Le référentiel central reconnu établit, met en œuvre, maintient et applique des règles, des politiques et des procédures écrites raisonnablement conçues pour permettre la cessation ordonnée de ses activités selon les résultats de l'évaluation visée au paragraphe 4.

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

A.M. 2013-21, a. 20; A.M. 2016-10, a. 6.

## **Risques liés aux systèmes et autres risques opérationnels**

**21.** 1) Le référentiel central reconnu établit, met en œuvre, maintient et applique des procédures, des systèmes et des contrôles adéquats pour relever toutes les sources plausibles de risque opérationnel, aussi bien internes qu'externes, notamment les risques liés à l'intégrité et à la sécurité des données, à la continuité des activités et à la gestion de la capacité et de la performance afin d'en atténuer l'incidence autant que possible.

2) Les procédures, les systèmes et les contrôles visés au paragraphe 1 sont approuvés par le conseil d'administration du référentiel central reconnu.

3) Sans que soit limitée la portée générale du paragraphe 1, le référentiel central reconnu a les obligations suivantes:

a) élaborer et maintenir les éléments suivants:

i) un système adéquat de contrôle interne de ses systèmes;

ii) des contrôles généraux adéquats en matière de technologie de l'information, notamment en ce qui concerne le fonctionnement des systèmes d'information, la sécurité et l'intégrité de l'information, la gestion du changement, la gestion des problèmes, le soutien du réseau et le soutien du logiciel d'exploitation;

b) conformément à la pratique commerciale prudente, prendre les mesures suivantes à une fréquence raisonnable et au moins une fois par année:

i) effectuer des estimations raisonnables de la capacité actuelle et future;

ii) soumettre les systèmes à des simulations de crise pour déterminer la capacité de ces systèmes de traiter les données sur les dérivés de manière exacte, rapide et efficiente;

c) aviser rapidement l'Autorité des pannes, défauts de fonctionnement, retards ou autres interruptions d'importance des systèmes, de même que de toute atteinte à la sécurité, à l'intégrité ou à la confidentialité des données, et fournir dès que possible un rapport d'incident écrit qui comprend une analyse de la cause fondamentale de l'incident et toute mesure corrective qu'il a prise ou qu'il compte prendre.

4) Sans que soit limitée la portée générale du paragraphe 1, le référentiel central reconnu établi, met en œuvre, maintient et applique des plans de continuité des activités, notamment des plans de reprise après sinistre raisonnablement conçus pour ce qui suit:

a) reprendre rapidement ses activités à la suite d'une interruption des activités;

b) permettre la récupération rapide des données, y compris les données sur les dérivés, en cas d'interruption des activités;

c) assurer l'exercice des fonctions d'autorité en cas d'urgence.

5) Le référentiel central reconnu met à l'essai ses plans de continuité des activités, notamment ses plans de reprise après sinistre, au moins une fois par année.

6) Le référentiel central reconnu engage chaque année une partie compétente pour effectuer un examen indépendant de chacun de ses systèmes servant à la collecte et au maintien des déclarations sur les dérivés et pour établir un rapport selon les normes d'audit établies afin de garantir sa conformité aux sous-paragraphe a et b du paragraphe 3 et aux paragraphes 4 et 5.

7) Le référentiel central reconnu présente le rapport établi conformément au paragraphe 6 aux destinataires suivants:

a) son conseil d'administration ou son comité d'audit, rapidement après l'établissement du rapport;

b) l'Autorité, au plus tard le 30e jour suivant la présentation du rapport au conseil d'administration ou au comité d'audit.

8) Le référentiel central reconnu met à la disposition du public sur son site Web la version définitive de toutes les prescriptions techniques relatives à l'interfaçage avec ses services ou à l'accès à ceux-ci:

a) s'il n'est pas encore en activité, suffisamment de temps avant le début de son activité pour donner aux participants un délai raisonnable leur permettant de procéder à des essais et de modifier leurs systèmes;

b) s'il est déjà en activité, suffisamment de temps avant de mettre en œuvre une modification importante de ses prescriptions techniques pour donner aux participants un délai raisonnable leur permettant de procéder à des essais et de modifier leurs systèmes.

9) Le référentiel central reconnu permet l'accès à des installations d'essais relativement à l'interfaçage avec ses services et l'accès à ceux-ci dans les délais suivants:

a) s'il n'est pas encore en activité, suffisamment de temps avant le début de son activité pour donner aux participants un délai raisonnable leur permettant de procéder à des essais et de modifier leurs systèmes;

b) s'il est déjà en activité, suffisamment de temps avant de mettre en œuvre une modification importante de ses prescriptions techniques pour donner aux participants un délai raisonnable leur permettant de procéder à des essais et de modifier leurs systèmes.

10) Le référentiel central reconnu ne peut entrer en activité au Québec que s'il se conforme au sous-paragraphe a des paragraphes 8 et 9.

11) Le sous-paragraphe b des paragraphes 8 et 9 ne s'applique pas au référentiel central reconnu lorsque les conditions suivantes sont réunies:

a) le référentiel central reconnu doit apporter immédiatement la modification à ses prescriptions techniques afin de remédier à une panne, à un défaut de fonctionnement ou à un retard important touchant ses systèmes ou son matériel;

b) le référentiel central reconnu avise immédiatement l'Autorité de son intention d'apporter la modification à ses prescriptions techniques;

c) le référentiel central reconnu met à la disposition du public dès que possible sur son site Web les prescriptions techniques modifiées.

A.M. 2013-21, a. 21; A.M. 2024-15, a. 13.

## **Sécurité et confidentialité des données**

**22.** 1) Le référentiel central reconnu établit, met en œuvre, maintient et applique des règles, des politiques et des procédures écrites raisonnablement conçues pour garantir la sécurité et la confidentialité des données sur les dérivés.

2) Le référentiel central reconnu ne peut communiquer de données sur les dérivés à des fins commerciales ou d'affaires que dans les cas suivants:

a) la communication est conforme à l'article 39;

b) les contreparties au dérivé ont expressément consenti par écrit à ce qu'il les utilise ou les communique.

A.M. 2013-21, a. 22; A.M. 2024-15, a. 14.

## **Transactions 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 transaction avec une contrepartie locale qui est exécutée anonymement sur une plateforme de négociation de dérivés et qui donne lieu à un dérivé compensé par l'entremise d'une chambre de compensation déclarante.

A.M. 2024-15, a. 15.

## **Validation des données**

**22.2.** 1) Le référentiel central reconnu établit, met en œuvre, maintient et applique une procédure de validation.

2) Dès que technologiquement possible après la réception des données sur les dérivés, le référentiel central reconnu indique à la contrepartie déclarante, y compris le mandataire agissant en son nom, si elles satisfont à sa procédure de validation.

3) Le référentiel central reconnu accepte les données sur les dérivés qui satisfont à sa procédure de validation.

4) Le référentiel central reconnu crée et conserve des dossiers de toutes les données sur les dérivés déclarées n'ayant pas satisfait à sa procédure de validation.

5) Pour tous les dérivés à déclarer en vertu du présent règlement, y compris ceux ayant expiré ou auxquels il est mis fin, le référentiel central reconnu accepte de tout participant la correction de toute erreur ou omission dans les données sur les dérivés déclarées par ce dernier si celles corrigées satisfont à sa procédure de validation.

A.M. 2024-15, a. 15.

## **Vérification des données**

**23.** 1) Pour l'application du présent article, on entend par:

«obligations de vérification»: les obligations prévues au paragraphe *b* ou *c* de l'article 26.1;

«participant à la vérification»: un participant qui est une contrepartie déclarante à l'égard d'un dérivé ou qui agit pour le compte de celle-ci, et qui est tenu aux obligations de vérification.

2) Le référentiel central reconnu établit, met en œuvre, maintient et applique des règles, politiques et procédures écrites conformément auxquelles un participant à la vérification est autorisé et habilité à s'acquitter de ses obligations de vérification.

A.M. 2013-21, a. 23 ; A.M. 2024-15, a. 16.

## **Impartition**

**24.** Le référentiel central reconnu fait ce qui suit lorsqu'il impartit un service ou un système important à un fournisseur de services, notamment à un membre du même groupe ou à une personne qui a des liens avec lui:

a) il établit, met en œuvre, maintient et applique des règles, des politiques et des procédures écrites concernant la sélection d'un fournisseur à qui le service ou le système important peut être impartit ainsi que l'évaluation et l'approbation de la convention d'impartition;

b) il repère les conflits d'intérêts entre lui et le fournisseur à qui le service ou le système important est impartit et il établit, met en œuvre, maintient et applique des règles, des politiques et des procédures écrites conçues pour les réduire et les gérer;

c) il conclut avec le fournisseur de services un contrat écrit adapté à l'importance et à la nature de l'activité impartie et qui prévoit des procédures de résiliation adéquates;

d) il conserve l'accès aux dossiers du fournisseur de services relativement à l'activité impartie;

e) il veille à ce que l'Autorité puisse accéder à l'ensemble des données, de l'information et des systèmes maintenus par le fournisseur de services pour le compte du référentiel central reconnu de la même manière qu'elle le pourrait en l'absence de convention d'impartition;

f) il veille à ce que toutes les personnes qui effectuent des audits ou des examens indépendants du référentiel central reconnu conformément au présent règlement puissent accéder de façon adéquate à l'ensemble des données, de l'information et des systèmes maintenus par le fournisseur de services pour le compte du référentiel central reconnu de la même manière qu'elles le pourraient en l'absence de convention d'impartition;

g) il prend les mesures appropriées pour s'assurer que le fournisseur à qui le service ou le système important est impartit établit, maintient et met à l'essai périodiquement un plan de continuité des activités approprié, notamment un plan de reprise après sinistre, conformément à l'article 21;

h) il prend les mesures appropriées pour veiller à ce que le fournisseur de services protège la sécurité et la confidentialité des données sur les dérivés et des renseignements confidentiels des utilisateurs, conformément à l'article 22;

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

A.M. 2013-21, a. 24.

### **CHAPITRE 3 DÉCLARATION DES DONNÉES**

#### **Contrepartie déclarante**

**25.** 1) Lorsqu'un dérivé avec une contrepartie locale est compensé par l'entremise d'une chambre de compensation déclarante, cette dernière est la contrepartie déclarante pour le dérivé.

2) Lorsqu'un dérivé avec une contrepartie locale n'est pas compensé par l'entremise d'une chambre de compensation déclarante, la contrepartie déclarante pour le dérivé est l'une des entités suivantes:

a) si seulement l'une des contreparties est une personne assujettie à l'obligation d'inscription à titre de courtier prévue par la Loi, cette personne;

b) si aucune des contreparties n'est une personne assujettie à cette obligation et que seulement l'une des contreparties est une institution financière canadienne ou une banque de l'annexe III, de l'institution financière canadienne ou la banque de l'annexe III.

3) Lorsque les paragraphes 1 et 2 ne s'applique pas à un dérivé avec une contrepartie locale, la contrepartie déclarante pour le dérivé, est si les deux contreparties ont convenu par écrit au moment de la transaction que l'une d'elles s'engage à agir comme contrepartie déclarante aux fins de l'exécution de l'obligation de déclaration prévue par le présent règlement, la contrepartie déclarante désignée dans la convention.

4) Lorsque les paragraphes 1 à 3 ne s'appliquent pas à un dérivé avec une contrepartie locale, la contrepartie déclarante pour le dérivé est chacune des contreparties locales.

5) La contrepartie locale à un dérivé auquel 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 sept ans suivant la date d'expiration ou de fin du dérivé;

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 un dérivé auquel l'article 40 s'applique.

A.M. 2013-21, a. 25; A.M. 2014-08, a. 2; A.M. 2023-16, a. 2 ; A.M. 2024-15, a. 17.

## **Obligation de déclaration**

**26.** 1) La contrepartie déclarante à l'égard d'un dérivé conclu avec une contrepartie locale déclare ou fait déclarer à un référentiel central reconnu les données à déclarer conformément au présent chapitre.

2) La contrepartie déclarante à l'égard d'un dérivé a la responsabilité de veiller à ce que toutes les obligations de déclaration relatives à ce dérivé soient respectées.

3) La contrepartie déclarante peut déléguer ses obligations de déclaration en vertu du présent règlement mais elle conserve la responsabilité de veiller à ce que les données sur les dérivés soient déclarées conformément au présent règlement.

4) Malgré le paragraphe 1, si aucun référentiel central reconnu n'accepte les données à déclarer conformément au présent chapitre, la contrepartie déclarante les transmet électroniquement à l'Autorité.

5) La contrepartie déclarante remplit l'obligation de déclaration relativement à un dérivé à déclarer en vertu du paragraphe 1 lorsque les conditions suivantes sont réunies:

a) le dérivé n'est déclaré que parce qu'une contrepartie au dérivé est une contrepartie locale en vertu du paragraphe c de la définition de «contrepartie locale»;

b) le dérivé est déclaré à un référentiel central reconnu en vertu des lois suivantes, selon le cas:

i) la législation en valeurs mobilières d'une province ou d'un territoire du Canada autre que le Québec;

ii) les lois d'un territoire étranger figurant sur la liste établie par l'Autorité;

c) la contrepartie déclarante demande au référentiel central reconnu visé au sous-paragraphe b de donner à l'Autorité accès aux données qui sont déclarées conformément à ce sous-paragraphe et fait de son mieux pour y donner accès à l'Autorité.

6) La contrepartie déclarante veille à ce que toutes les données sur les dérivés déclarées relativement à un dérivé satisfassent à la procédure de validation du référentiel central reconnu auquel est déclaré le dérivé.

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

8) *(paragraphe abrogé).*

9) Lorsqu'une contrepartie locale, autre qu'une chambre de compensation déclarante, à un dérivé qui est à déclarer en vertu du présent règlement et compensé par une chambre de compensation déclarante désigne un référentiel central reconnu auquel déclarer les données sur les dérivés qui s'y rapportent, la chambre de compensation est tenue aux obligations suivantes:

- a) déclarer ces données au référentiel central reconnu désigné;
- b) ne pas déclarer ces données à un autre référentiel central, sauf si la contrepartie locale y consent.

A.M. 2013-21, a. 26; N.I. 2014-01-01; A.M. 2014-08, a. 3; A.M. 2016-10, a. 8; A.M. 2024-15, a. 18.

## **Vérification des données**

**26.1.** La contrepartie déclarante prend les mesures suivantes:

a) elle veille à ce que les données sur les dérivés déclarées ne comportent aucune erreur ni n'omettent aucun élément;

b) si elle est un courtier en dérivés visé par le seuil de montant notionnel, elle vérifie que les données sur les dérivés déclarées ne comportent aucune erreur ni n'omettent aucun élément, au moins une fois par trimestre civil, mais au moins à deux mois civils d'intervalle;

c) si elle est une chambre de compensation déclarante, une institution financière canadienne ou une personne tenue à l'obligation d'inscription à titre de courtier en vertu de la Loi qui n'est pas un courtier en dérivés visé par le seuil de montant notionnel, elle vérifie que les données sur les dérivés déclarées ne comportent aucune erreur ni n'omettent aucun élément, au moins tous les 30 jours.

A.M. 2024-15, a. 19.

## **Dérivés déclarés par erreur**

**26.2.** La contrepartie déclarante qui déclare un dérivé par erreur le signale 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 possible de le faire, mais en aucun cas après la fin du jour ouvrable suivant le jour de sa découverte.

A.M. 2024-15, a. 19.

## **Notification des erreurs et des omissions dans les données sur les dérivés**

**26.3.** 1) La contrepartie locale qui n'est pas la contrepartie déclarante notifie à cette dernière toute erreur ou omission dans les données sur les dérivés relatives au dérivé

auquel elle est contrepartie dès qu'il est possible de le faire, mais en aucun cas après la fin du jour ouvrable suivant le jour de sa découverte.

2) La contrepartie déclarante notifie à l'Autorité toute erreur ou omission importante dans les données sur les dérivés dès qu'il est possible de le faire suivant sa découverte.

A.M. 2024-15, a. 19.

### **Transfert d'un dérivé à un autre référentiel central reconnu**

**26.4.** 1) La contrepartie déclarante ne peut, à l'égard d'un dérivé, changer de référentiel central reconnu auquel déclarer les données sur les dérivés, sauf si elle se conforme aux paragraphes 2 et 3.

2) Au moins cinq jours ouvrables avant d'effectuer le changement visé au paragraphe 1, la contrepartie déclarante en avise les entités suivantes:

- a) l'autre contrepartie au dérivé;
- b) l'ancien référentiel central reconnu;
- c) le nouveau référentiel central reconnu.

3) La contrepartie déclarante inclut dans l'avis visé au paragraphe 2 l'UTI du dérivé ainsi que la date à laquelle elle commencera à déclarer les données sur les dérivés au référentiel central reconnu visé au sous-paragraphe c de ce paragraphe.

4) Après la transmission de l'avis visé au paragraphe 2, la contrepartie déclarante déclare le changement de référentiel central reconnu comme s'il s'agissait d'un événement du cycle de vie en vertu de l'article 32 aux référentiels visés aux sous-paragraphes b et c de ce paragraphe le même jour et déclare le dérivé à chacun en l'identifiant au moyen du même UTI.

5) Après le changement de référentiel central reconnu, la contrepartie déclarante déclare au référentiel visé au sous-paragraphe c du paragraphe 2 toutes les données sur les dérivés relatives au dérivé, à moins de changer subséquemment de référentiel conformément au présent article.

A.M. 2024-15, a. 19.

### **Identifiants – dispositions générales**

**27.** La contrepartie déclarante inclut les éléments suivants dans chaque déclaration prévue par le présent chapitre:

- a) l'identifiant de chaque contrepartie tel qu'il est prévu à l'article 28;
- b) l'UTI tel qu'il est prévu à l'article 29;

- c) l'identifiant unique de produit tel qu'il est prévu à l'article 30.

A.M. 2013-21, a. 27 ; A.M. 2024-15, a. 20 ; N.I. 2025-04-01.

### **Identifiants pour les entités juridiques**

**28.** 1) Le référentiel central reconnu et la contrepartie déclarante identifient chaque contrepartie à un dérivé par un identifiant unique pour les entités juridiques dans l'ensemble des dossiers et des déclarations prévus par le présent règlement.

2) Les dispositions suivantes s'appliquent aux identifiants pour les entités juridiques:

a) l'identifiant pour les entités juridiques est un code d'identification unique attribué à une contrepartie conformément aux normes établies par le Système d'identifiant international pour les entités juridiques;

b) la contrepartie locale à un dérivé à déclarer en vertu du présent règlement respecte les exigences applicables établies par le Système d'identifiant international pour les entités juridiques.

3) *(paragraphe abrogé).*

4) Malgré le paragraphe 1, si une contrepartie à un dérivé est une personne physique ou n'est pas admissible à l'attribution d'un identifiant pour les entités juridiques conformément au Système d'identifiant international pour les entités juridiques, la contrepartie déclarante et le référentiel central reconnu l'identifient au moyen d'un seul autre identifiant unique.

5) *(paragraphe abrogé).*

A.M. 2013-21, a. 28; A.M. 2016-10, a. 9 ; A.M. 2024-15, a. 21.

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

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

A.M. 2016-10, a. 10; A.M. 2024-15, a. 22.

### **Identifiants uniques de transaction**

**29.** 1) Le référentiel central reconnu et la contrepartie déclarante identifient chaque dérivé et chaque position visés à l'article 33.1 par un seul UTI dans l'ensemble des dossiers et déclarations prévus par le présent règlement.

2) Les personnes suivantes attribuent un seul UTI à chaque dérivé à déclarer en vertu du présent règlement:

a) lorsque le dérivé doit aussi être déclaré en vertu de la législation en valeurs mobilières d'un territoire du Canada autre que le Québec, ou en vertu des lois d'un territoire étranger dans un délai plus court que celui prévu par le présent règlement, la personne tenue d'attribuer l'UTI conformément à cette législation ou ces lois;

b) lorsque le sous-paragraphe a ne s'applique pas au dérivé et que celui-ci est compensé par l'entremise d'une chambre de compensation déclarante, cette chambre de compensation;

c) lorsque les sous-paragraphe a et b ne s'appliquent pas au dérivé et que la plateforme de négociation de dérivés sur laquelle la transaction relative à ce dérivé a été exécutée lui a attribué un UTI, cette plateforme de négociation;

d) lorsque les sous-paragraphe a à c ne s'appliquent pas au dérivé, la contrepartie déclarante ou, s'il y en a deux, celle arrivant en tête du classement alphanumérique des identifiants uniques pour les entités juridiques après inversion de leurs caractères.

3) Malgré le sous-paragraphe d du paragraphe 2, si les sous-paragraphe a à c de ce paragraphe ne s'appliquent pas au dérivé et que les contreparties ont convenu par écrit que l'une d'elles sera la personne chargée de lui attribuer l'UTI, cette contrepartie attribue l'UTI.

4) Malgré le paragraphe 2, la personne tenue d'attribuer un UTI conformément à ce paragraphe peut demander à un référentiel central reconnu de le faire si elle remplit l'une des conditions suivantes:

a) elle est un courtier en dérivés visé par le seuil de montant notionnel;

b) elle n'est pas une chambre de compensation déclarante, une plateforme de négociation de dérivés, une institution financière canadienne ou une personne assujettie à l'obligation d'inscription à titre de courtier en vertu de la Loi.

5) Le référentiel central reconnu qui reçoit une demande conformément au paragraphe 4 attribue un UTI dès qu'il est technologiquement possible de le faire.

6) La personne visée au paragraphe 2 attribue un UTI dès qu'il est possible de le faire après l'exécution de la transaction relative au dérivé, mais en aucun cas après le moment auquel il faut déclarer ce dernier à un référentiel central reconnu en vertu du présent règlement.

7) La plateforme de négociation de dérivés qui est tenue d'attribuer un UTI conformément au paragraphe 2 le fournit dès qu'il est technologiquement possible de le faire aux entités suivantes:

- a) chaque contrepartie au dérivé;
  - b) si le dérivé est soumis pour compensation, la chambre de compensation déclarante à laquelle il est soumis à cette fin.
- 8) Sous réserve du paragraphe 4, si l'une des contreparties à un dérivé non compensé est tenue d'attribuer un UTI conformément au paragraphe 2 ou 3, elle le fournit dès qu'il est possible de le faire aux entités suivantes:
- a) l'autre contrepartie au dérivé;
  - b) si le dérivé est soumis pour compensation, la chambre de compensation déclarante à laquelle il est soumis à cette fin.
- 9) Le référentiel central reconnu qui attribue un UTI conformément au paragraphe 4 le fournit dès qu'il est technologiquement possible de le faire aux entités suivantes :
- a) chaque contrepartie au dérivé;
  - b) si le dérivé est soumis pour compensation, la chambre de compensation déclarante à laquelle il est soumis à cette fin.

A.M. 2013-21, a. 29; A.M. 2024-15, a. 23.

### **Identifiants uniques de produit**

- 30.** 1) Pour l'application du présent article, l'identifiant unique de produit s'entend d'un code qui identifie chaque dérivé et est attribué par le Derivatives Service Bureau.
- 2) Le référentiel central reconnu et la contrepartie déclarante identifient chaque type de dérivé par un seul identifiant unique de produit dans l'ensemble des dossiers et déclarations prévus par le présent règlement.
- 3) *(paragraphe abrogé).*
- 4) *(paragraphe abrogé).*

A.M. 2013-21, a. 30; A.M. 2024-15, a. 24.

### **Données à communiquer à l'exécution**

- 31.** 1) Dès l'exécution d'une transaction relative à un dérivé à déclarer conformément au présent règlement, la contrepartie déclarante déclare à un référentiel central reconnu les données à communiquer à l'exécution relativement à ce dérivé.
- 2) La contrepartie déclarante agréée à un dérivé déclare en temps réel les données à communiquer à l'exécution.

3) Malgré le paragraphe 2, la contrepartie déclarante agréée qui ne peut technologiquement pas déclarer en temps réel les données à communiquer à l'exécution les déclare dès qu'il est technologiquement possible de le faire et au plus tard à la fin du jour ouvrable suivant.

4) *(paragraphe abrogé).*

5) La contrepartie déclarante qui n'est pas agréée à l'égard d'un dérivé déclare les données à communiquer à l'exécution au plus tard à la fin du deuxième jour ouvrable suivant la date d'exécution de la transaction.

A.M. 2013-21, a. 31; A.M. 2014-08, a. 4; A.M. 2024-15, a. 25.

**Données sur les événements du cycle de vie 32.** 1) Pour chaque dérivé à déclarer conformément au présent règlement, la contrepartie déclarante agréée déclare à un référentiel central reconnu toutes les données sur les événements du cycle de vie avant la fin du jour ouvrable où ils se sont produits.

2) Malgré le paragraphe 1, la contrepartie déclarante agréée qui ne peut technologiquement pas déclarer les données sur les événements du cycle de vie avant la fin du jour ouvrable où ils se sont produits les déclare à un référentiel central reconnu au plus tard à la fin du jour ouvrable suivant.

3) La contrepartie déclarante qui n'est pas agréée à l'égard d'un dérivé déclare à un référentiel central reconnu toutes les données sur les événements du cycle de vie au plus tard à la fin du deuxième jour ouvrable suivant celui où ils se sont produits.

4) Malgré les paragraphes 1 à 3, la chambre de compensation déclarante par l'entremise de laquelle le dérivé est compensé déclare la fin du dérivé initial au référentiel central reconnu auquel les données sur les dérivés s'y rapportant ont été déclarées, avant la fin du jour ouvrable suivant celui où il y est mis fin.

A.M. 2013-21, a. 32; A.M. 2024-15, a. 26.

### **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 en vertu de 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 tout dérivé 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 de dérivés ont été déclarées en vertu de l'article 33.1, la contrepartie déclarante calcule et déclare la valeur nette de l'ensemble des achats et des ventes déclarés en tant que données sur les positions des dérivés.

A.M. 2013-21, a. 33; A.M. 2016-10, a. 11 ; A.M. 2023-16, a. 3; A.M. 2024-15, a. 27.

## **Données sur les positions**

**33.1.** 1) Pour l'application de l'article 32, la contrepartie déclarante peut déclarer les données sur les événements du cycle de vie comme des données sur les positions si chaque dérivé pour lequel ces données sont agrégées remplit les conditions suivantes:

a) il appartient à une catégorie dans laquelle chaque dérivé est fongible avec tous les autres de cette catégorie;

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

2) Pour l'application du paragraphe 1 de l'article 33, la contrepartie déclarante qui est une personne assujettie à l'obligation d'inscription à titre de courtier en vertu de la Loi, une chambre de compensation déclarante ou une institution financière canadienne peut déclarer les données de valorisation et les données sur les sûretés et les marges comme des données sur les positions si chaque dérivé pour lequel ces données sont agrégées remplit les conditions suivantes:

a) il appartient à une catégorie dans laquelle chaque dérivé est fongible avec tous les autres de cette catégorie;

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

A.M. 2024-15, a. 27.

## **Opérations préexistantes**

**34.** 1) Malgré l'article 31 et sous réserve du paragraphe 4 de l'article 42, la contrepartie déclarante ne déclare que les données à communiquer à l'exécution visées dans la colonne de l'Annexe A intitulée «Information requise pour les opérations préexistantes» au plus tard le 30 avril 2015 si les conditions suivantes sont réunies:

a) la contrepartie déclarante est une chambre de compensation déclarante, une personne assujettie à l'obligation d'inscription à titre de courtier prévue par la Loi ou une institution financière canadienne;

b) l'opération a été conclue avant le 31 octobre 2014;

c) des obligations contractuelles s'appliquaient relativement à l'opération le 31 octobre 2014.

1.1) Malgré l'article 31 et sous réserve du paragraphe 5 de l'article 42, la contrepartie déclarante ne déclare que les données à communiquer à l'exécution visées dans la colonne de l'Annexe A intitulée «Information requise pour les opérations préexistantes» au plus tard le 31 décembre 2015 si les conditions suivantes sont réunies:

a) la contrepartie déclarante n'est ni une chambre de compensation déclarante ni une personne assujettie à l'obligation d'inscription à titre de courtier prévue par la Loi ni une institution financière canadienne;

b) l'opération a été conclue avant le 30 juin 2015;

c) des obligations contractuelles s'appliquaient relativement à l'opération le 30 juin 2015.

2) Malgré l'article 32, la contrepartie déclarante ne déclare les données sur les événements du cycle de vie conformément à cet article qu'après la déclaration des données à communiquer à l'exécution visées au paragraphe 1 ou 1.1 relativement à une opération visée à ce paragraphe.

3) Malgré l'article 33, la contrepartie déclarante ne déclare les données de valorisation conformément à cet article qu'après la déclaration des données à communiquer à l'exécution visées au paragraphe 1 ou 1.1 relativement à une opération visée à ce paragraphe.

A.M. 2013-21, a. 34; N.I. 2014-04-01; A.M. 2014-08, a. 5.

### **Délai de déclaration des données à un autre référentiel central reconnu**

**35.** Malgré le paragraphe 7 de l'article 26 et les délais de déclaration prévus aux articles 31 à 34, dans le cas où le référentiel central reconnu cesse son activité ou cesse d'accepter les données sur les dérivés relatives à une certaine catégorie d'actifs, la contrepartie déclarante peut remplir ses obligations de déclaration en vertu du présent règlement en déclarant les données sur les dérivés à un autre référentiel central reconnu ou, à défaut de référentiel central reconnu, à l'Autorité dans un délai raisonnable.

A.M. 2013-21, a. 35 ; A.M. 2024-15, a. 29.

### **Dossiers des données déclarées**

**36.** 1) La contrepartie déclarante conserve des dossiers sur le dérivé à déclarer conformément au présent règlement, y compris des dossiers sur les transactions, pendant une période de sept ans suivant la date d'expiration ou de fin du dérivé.

2) La contrepartie déclarante conserve les dossiers visés au paragraphe 1 en lieu sûr et sous une forme durable.

A.M. 2013-21, a. 36; A.M. 2024-15, a. 30.

## Plateforme de négociation de dérivés

**36.1.** 1) Dans le présent article, on entend par « dérivé anonyme » tout dérivé pour lequel la transaction est exécutée anonymement sur une plateforme de négociation de dérivés et qui, au moment de l'exécution, est destiné à être compensé.

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

3) Malgré le paragraphe 2, les dispositions suivantes s'appliquent relativement aux dérivés anonymes:

a) la mention de la « contrepartie déclarante » au paragraphe 2 de l'article 22.2, aux paragraphes 1 à 4, 6 et 7 de l'article 26, au paragraphe a de l'article 26.1, aux articles 26.2, 26.3, 26.4 et 27, aux paragraphes 1 et 4 de l'article 28, au paragraphe 1 de l'article 29, au paragraphe 2 de l'article 30, au paragraphe 1 de l'article 31, aux articles 35 et 36, au paragraphe 3 de l'article 37 et à l'article 41.2 s'entend d'une « plateforme de négociation de dérivés »;

b) la mention de la « contrepartie déclarante agréée » aux paragraphes 2 et 3 de l'article 31 s'entend d'une « plateforme de négociation de dérivés ».

4) Malgré le paragraphe 2, la plateforme de négociation de dérivés peut prendre les mesures suivantes relativement à un dérivé anonyme:

a) déclarer l'identifiant pour les entités juridiques d'un mandataire d'une contrepartie à l'égard des éléments de données n°1 «Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)» et n°2 «Contrepartie 2 (contrepartie non déclarante)» indiqués à l'Annexe A si la transaction relative au dérivé est exécutée avant que celui-ci soit réparti entre les contreparties pour le compte desquelles le mandataire agit;

b) ne pas déclarer les éléments de données suivants indiqués à l'Annexe A:

i) l'élément de données n°20 «Indicateur intragroupe»;

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

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

iv) l'élément de données n°77 «Exceptions et dispenses de compensation – contrepartie 1»;

v) l'élément de données n°78 «Exceptions et dispenses de compensation – contrepartie 2»;

vi) l'élément de données n°96 «Niveau»;

viii) l'élément de données n°121 «Indicateur de cryptoactif sous-jacent».

5) Malgré le paragraphe 2, à l'égard d'un dérivé anonyme, lorsque la plateforme de négociation de dérivés, en dépit de ses efforts diligents et raisonnablement fréquents, n'a pas encore déterminé si l'un de ses participants, ou le client de celui-ci, est une contrepartie locale conformément au paragraphe c de la définition de cette expression dans tout territoire du Canada, le participant, ou son client, n'est pas une contrepartie locale au sens de ce paragraphe aux fins de déclaration par la plateforme de négociation de dérivés en vertu du présent règlement jusqu'à la première des dates suivantes:

a) la date à laquelle la plateforme de négociation de dérivés détermine que le participant, ou son client, est une contrepartie locale conformément à ce paragraphe;

b) le 31 juillet 2029.

A.M. 2024-15, a. 31.

## **CHAPITRE 4 DIFFUSION DES DONNÉES ET ACCÈS AUX DONNÉES**

### **Données mises à la disposition des organismes de réglementation**

**37.** 1) Le référentiel central reconnu fait ce qui suit, sans frais:

a) il fournit à l'Autorité un accès électronique direct, continue et rapide aux données qu'il a en sa possession et qui sont nécessaires à l'Autorité pour réaliser son mandat;

b) il crée des données agrégées à partir de celles qu'il a en sa possession et les met à la disposition de l'Autorité selon ce qui est nécessaire pour que l'Autorité puisse remplir son mandat;

c) il indique à l'Autorité la manière dont les données sur les dérivés fournies conformément au sous-paragraphe c ont été agrégées.

2) Le référentiel central reconnu respecte les normes internationalement reconnues qui sont applicables aux référentiels centraux en matière d'accès des organismes de réglementation.

3) La contrepartie déclarante fait de son mieux pour donner à l'Autorité accès à toutes les données sur les dérivés qu'elle est tenue de déclarer conformément au présent règlement, y compris en demandant à tout référentiel central d'y donner accès à l'Autorité.

A.M. 2013-21, a. 37 ; A.M. 2024-15, a. 32.

### **Données mises à la disposition des participants**

**38.** 1) Sous réserve de l'article 22.1, le référentiel central reconnu fournit en temps opportun au participant qui est une contrepartie à un dérivé ou qui agit au nom de celle-ci l'accès à toutes les données sur les dérivés s'y rapportant qui lui sont communiquées.

- 2) Le référentiel central reconnu se dote de procédures adéquates d'autorisation pour permettre l'accès accordé en application du paragraphe 1 au participant qui est une contrepartie non déclarante ou qui agit au nom de celle-ci.
- 3) Sous réserve de l'article 22.1, chaque contrepartie à un dérivé est réputée consentir à la publication de toutes les données sur les dérivés qu'il est obligatoire de déclarer ou de communiquer en vertu du présent règlement.
- 4) Le paragraphe 3 s'applique malgré toute convention à l'effet contraire intervenue entre les contreparties à un dérivé.

A.M. 2013-21, a. 38; A.M. 2016-10, a. 12; A.M. 2024-15, a. 33.

### **Données mises à la disposition du public**

- 39.** 1) Le référentiel central reconnu crée périodiquement des données agrégées sur les positions ouvertes, le volume, et le nombre relativement aux dérivés qui lui sont déclarés conformément au présent règlement et met ces données à la disposition du public sans frais.
- 2) Les données agrégées périodiques mises à la disposition du public conformément au paragraphe 1 sont complétées au moins par des ventilations, s'il y a lieu, en fonction de la monnaie de libellé, de la catégorie d'actifs, du type de contrat, de la date d'expiration et du fait que le dérivé est compensé ou non.
  - 3) Le référentiel central reconnu met à la disposition du public, sans frais, les déclarations des données relativement à chaque dérivé déclaré en vertu du présent règlement conformément aux dispositions de l'Annexe C pendant au moins un an après leur première mise à la disposition du public.
  - 4) Le référentiel central reconnu qui met les déclarations à la disposition du public pour l'application du paragraphe 3 ne peut divulguer l'identité des contreparties au dérivé.
  - 5) Le référentiel central reconnu fait en sorte que les données qui doivent être mises à la disposition du public en vertu du présent article soient accessibles au public sous une forme utilisable sur un site Web ou au moyen d'une autre technologie ou d'un autre support.
  - 6) Malgré les paragraphes 1 à 5, le référentiel central reconnu ne peut rendre publiques les données sur les dérivés relativement à un dérivé conclu entre des entités du même groupe que s'il y est obligé par la loi.

A.M. 2013-21, a. 39; A.M. 2016-10, a. 13 ; A.M. 2024-15, a. 34.

## **CHAPITRE 5 EXCLUSIONS**

### **Dérivés sur marchandises**

**40.** 1) Malgré le chapitre 3 et sous réserve du paragraphe 5 de l'article 25 et du paragraphe 2 du présent article, la contrepartie locale n'est pas tenue de déclarer les données sur les dérivés relativement à un dérivé sur marchandises si les conditions suivantes sont réunies:

a) cette contrepartie n'est pas une contrepartie déclarante agréée;

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

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

A.M. 2013-21, a. 40; A.M. 2016-10, a. 14 ; A.M. 2023-16, a. 4; A.M. 2024-15, a. 35.

### **Non-application**

**41.** Les contreparties suivantes sont exclues de l'application du présent règlement:

a) le gouvernement du Québec;

b) un organisme visé au paragraphe 2° de l'article 77 de la Loi sur l'administration financière (chapitre A-6.001);

c) une municipalité, une communauté métropolitaine, une commission scolaire ou le Comité de gestion de la taxe scolaire de l'île de Montréal;

d) une société de transport constituée en vertu d'une loi du Québec;

e) un établissement public ou un conseil régional au sens de la Loi sur les services de santé et les services sociaux pour les autochtones cris (chapitre S-5), un établissement public ou une agence de la santé et des services sociaux visée par la Loi sur les services de santé et les services sociaux (chapitre S-4.2);

f) une université québécoise;

g) un collège d'enseignement général et professionnel;

- h)* une régie intermunicipale.

A.M. 2013-21, a. 41.

### **Dérivés entre entités du même groupe**

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

- a)* les contreparties sont des entités du même groupe, et leurs états financiers sont consolidés conformément aux principes comptables, au sens du Règlement 52-107 sur les principes comptables et normes d'audit acceptables (chapitre V-1.1, r. 25);

- b)* aucune contrepartie n'est une contrepartie déclarante agréée;

- c)* le dérivé est soumis à des procédures centralisées d'évaluation, de mesure et de contrôle des risques raisonnablement conçues pour relever et gérer les risques;

- d)* une entente écrite prévoyant les modalités de la transaction lie les contreparties;

- e)* les contreparties conservent des dossiers relativement au dérivé et les mettent à la disposition de l'Autorité, sur demande.

A.M. 2024-15, a. 37.

### **Dérivés entre une personne non résidente assujettie à l'obligation d'inscription à titre de courtier en vertu de la Loi et une contrepartie non locale**

**41.2.** 1) Malgré le chapitre 3, la contrepartie déclarante n'est pas tenue de déclarer des données sur les dérivés relativement à un dérivé à déclarer du seul fait qu'au moins une des deux contreparties est une contrepartie locale conformément au paragraphe *b* de la définition de cette expression.

2) Le paragraphe 1 ne s'applique pas si le dérivé engage une contrepartie qui est l'une des personnes suivantes:

- a)* la contrepartie qui est une contrepartie locale conformément au paragraphe *b* de la définition de cette expression et une personne agréée en vertu de l'article 82 de la Loi;

- b)* une personne physique résidant au Québec.

A.M. 2024-15, a. 37.

## **CHAPITRE 6 DISPOSITIONS TRANSITOIRES ET FINALES**

### **Dispositions transitoires et finales**

- 42.** 1) Le présent règlement entre en vigueur le 31 décembre 2013, à l'exception des chapitres 3 et 5, qui entrent en vigueur le 31 octobre 2014.
- 2) Malgré le paragraphe 1, le paragraphe 3 de l'article 39 ne s'applique pas avant le 16 janvier 2017.
- 3) La contrepartie déclarante qui n'est ni une chambre de compensation déclarante ni une personne assujettie à l'obligation d'inscription à titre de courtier prévue par la Loi ni une institution financière canadienne n'est pas tenue de faire de déclaration en vertu du chapitre 3 avant le 30 juin 2015.
- 4) Le chapitre 3 ne s'applique pas à une opération conclue avant le 31 octobre 2014 qui expire ou prend fin au plus tard le 30 avril 2015 si la contrepartie déclarante est une chambre de compensation déclarante, une personne assujettie à l'obligation d'inscription à titre de courtier prévue par la Loi ou une institution financière canadienne.
- 5) Le chapitre 3 ne s'applique pas à une opération conclue avant le 30 juin 2015 qui expire ou prend fin au plus tard le 31 décembre 2015 si la contrepartie déclarante n'est ni une chambre de compensation déclarante ni une personne assujettie à l'obligation d'inscription à titre de courtier prévue par la Loi ni une institution financière canadienne.

A.M. 2013-21, a. 42; N.I. 2014-02-01; A.M. 2014-08, a. 6; A.M. 2016-10, a.15.

## ANNEXE A ÉLÉMENTS DE DONNÉES MINIMAUX À DÉCLARER AU RÉFÉRENTIEL CENTRAL RECONNU

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

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

Dans la présente annexe, on entend par « règlements sur la déclaration de données sur les dérivés de tout territoire du Canada » la *Rule 91-507 Derivatives: Trade Reporting* de la Commission des valeurs mobilières du Manitoba, la *Rule 91-507 Derivatives: Trade Reporting* de la Commission des valeurs mobilières de l'Ontario, le Règlement 91-507 sur les référentiels centraux et la déclaration de données sur les dérivés (chapitre I-14.01, r. 1.1) ou la Norme multilatérale 96-101 sur la déclaration des opérations sur 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	Mis à la disposition du public
1	Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)	L'identifiant de la contrepartie déclarante.	N
2	Contrepartie 2 (contrepartie non déclarante)	L'identifiant de la contrepartie non déclarante.	N
3	Source de l'identifiant de la contrepartie 2	Le type d'identifiant de la contrepartie 2.	N
4	Identifiant de l'acheteur	L'identifiant de la contrepartie qui est l'acheteur.	N
5	Identifiant du vendeur	L'identifiant de la contrepartie qui est le vendeur.	N
6	Identifiant du payeur	L'identifiant de la contrepartie de la branche du payeur.	N
7	Identifiant du receveur	L'identifiant de la contrepartie de la branche receveuse.	N

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à la disposition du public
8	Identifiant du courtier	L'identifiant d'un courtier qui agit comme intermédiaire pour la contrepartie 1 sans devenir lui-même une contrepartie.	N
9	Pays et province ou territoire de la personne physique  (contrepartie non déclarante)	Si la personne physique est une contrepartie non déclarante, son pays de résidence, et si elle réside au Canada, la province ou le territoire.	N
10	Territoire de la contrepartie 1	Chaque territoire dans lequel la contrepartie 1 est :  <ul style="list-style-type: none"> <li>• une contrepartie locale conformément au paragraphe <i>a</i> ou <i>c</i> de la définition de cette expression dans les règlements sur la déclaration des données sur les dérivés de tout territoire du Canada;</li> <li>• une contrepartie locale conformément au paragraphe <i>b</i> de la définition de cette expression dans les règlements sur la déclaration des données sur les dérivés de tout territoire du Canada, si la contrepartie non déclarante est une personne physique résidant dans le territoire en question; et/ou</li> <li>• une contrepartie locale conformément au paragraphe <i>b</i> de la définition de cette expression qui est une personne agréée en vertu de l'article 82 de la Loi.</li> </ul>	N
11	Territoire de la contrepartie 2	Chaque territoire dans lequel la contrepartie 2 est :  <ul style="list-style-type: none"> <li>• une contrepartie locale conformément au paragraphe <i>a</i> ou <i>c</i> de la définition de cette expression dans les règlements sur la déclaration des données sur les dérivés de tout territoire du Canada;</li> <li>• une contrepartie locale conformément au paragraphe <i>b</i> de la définition de cette expression qui est une personne agréée en vertu de l'article 82 de la Loi.</li> </ul>	N

## Éléments de données relatifs aux dérivés

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à la disposition du public
12	Date d'entrée en vigueur	La date non ajustée, indiquée dans la confirmation, à laquelle les obligations relatives au dérivé entrent en vigueur.	O
13	Date d'expiration	La date non ajustée, indiquée dans la confirmation, à laquelle les obligations relatives au dérivé cessent d'avoir effet.	O
14	Horodatage de l'exécution	La date et l'heure de l'exécution d'une transaction.	O
15	Horodatage de la déclaration	La date et l'heure de soumission de la déclaration au référentiel central.	N
16	Identifiant unique de transaction (UTI)	L'identifiant unique qui identifie un dérivé ou une position pendant tout son cycle de vie.	N
17	UTI antérieur (pour les relations d'une à une et d'une à plusieurs entre les transactions)	L'UTI attribué à un dérivé avant la survenance d'un événement du cycle de vie ayant donné lieu au dérivé actuel.	N
18	UTI de la position subséquente	L'UTI de la position dans laquelle le dérivé est inclus.	N
19	USI antérieur (pour les relations d'une à une et d'une à plusieurs entre les transactions)	L'identifiant unique de swap (USI) attribué à un dérivé avant la survenance d'un événement du cycle de vie ayant donné lieu au dérivé actuel.	N
20	Indicateur intragroupe	L'indication que le dérivé est conclu ou non entre deux entités du même groupe.	N
21	Identifiant de l'initiateur	L'identifiant de l'entité soumettant les données sur les dérivés au référentiel central.	N
22	Identifiant de la plateforme	L'identifiant de la plateforme de négociation sur laquelle la transaction a été exécutée.	O

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à la disposition du public
23	Indicateur d'exécution anonyme sur une plateforme	L'indication que la transaction a été exécutée anonymement ou non sur une plateforme de négociation.	N
24	Type d'accord-cadre	Le type d'accord-cadre.	N
25	Version de l'accord-cadre	L'année de la version de l'accord-cadre.	N

### Éléments de données relatifs aux montants et quantités notionnels

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à la disposition du public
26	Montant notionnel	Montant notionnel à l'égard de chaque branche d'un dérivé : <ul style="list-style-type: none"> <li>• si le dérivé est négocié en montant monétaire, le montant qui y est stipulé;</li> <li>• si le dérivé est négocié en montant non monétaire, le convertir en montant monétaire.</li> </ul>	O
27	Monnaie notionnelle	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, la monnaie du montant notionnel.	O
28	Montant d'achat	Le montant monétaire qu'une personne a le droit d'acheter en vertu d'une option.	N
29	Monnaie d'achat	La monnaie du montant d'achat d'une option.	N
30	Montant de vente	Le montant monétaire qu'une personne a le droit de vendre en vertu d'une option.	N
31	Monnaie de vente	La monnaie du montant de vente d'une option.	N
32	Quantité notionnelle	À l'égard de chaque branche d'un dérivé négocié en montant non monétaire, la quantité notionnelle fixe pour chaque période du tableau.	N

<b>Numéro de l'élément de données</b>	<b>Nom de l'élément de données</b>	<b>Description de l'élément de données</b>	<b>Mis à la disposition du public</b>
33	Fréquence de cotation de la quantité	La période pour laquelle la quantité est cotée.	N
34	Fréquence de cotation de la quantité – multiplicateur	Le nombre de périodes de fréquence de cotation de la quantité.	N
35	Unité de mesure de la quantité	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, l'unité de mesure de la quantité notionnelle totale et de la quantité notionnelle.	N
36	Quantité notionnelle totale	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, la quantité notionnelle globale de l'élément sous-jacent pendant la durée du dérivé.	N
37	Tableau de la quantité notionnelle – Date non ajustée de prise d'effet de la quantité notionnelle associée	Pour chaque quantité notionnelle indiquée dans le tableau, la date de prise d'effet (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) de la quantité notionnelle.	N
38	Tableau de la quantité notionnelle – Date de fin non ajustée de la quantité notionnelle	Pour chaque quantité notionnelle indiquée dans le tableau, la date de fin (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) de la quantité notionnelle.	N
39	Tableau de la quantité notionnelle – Quantité notionnelle en vigueur à la date de prise d'effet associée	Chaque quantité notionnelle, indiquée dans un tableau, à compter de la date précisée dans l'élément de données 37 jusqu'à celle stipulée dans l'élément de données 38.	N
40	Tableau de montants notionnels – montant notionnel en vigueur à la	Chaque montant notionnel, indiqué dans un tableau, en vigueur à compter de la date précisée dans l'élément de données 41 jusqu'à celle stipulée dans l'élément de données 42.	N

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à la disposition du public
	date de prise d'effet associée		
41	Tableau de montants notionnels – date de prise d'effet non ajustée du montant notionnel	Pour chaque montant notionnel indiqué dans un tableau, la date de prise d'effet (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du montant notionnel.	N
42	Tableau de montants notionnels – date de fin non ajustée du montant notionnel	Pour chaque montant notionnel indiqué dans le tableau, la date de fin (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du montant notionnel.	N

### Éléments de données relatifs aux prix

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à la disposition du public
43	Taux de change	Le taux de change de deux monnaies stipulées au dérivé.	N
44	Base du taux de change	La paire et l'ordre des monnaies dans lesquelles le taux de change est libellé.	N
45	Taux fixe	À l'égard de chaque branche d'un dérivé prévoyant des paiements périodiques, le taux annuel de la branche fixe.	O
46	Prix	Le prix indiqué dans le dérivé.	O
47	Monnaie du prix	La monnaie dans laquelle le prix est libellé.	O
48	Notation du prix	La manière dont le prix est exprimé.	O
49	Unité de mesure du prix	L'unité de mesure dans laquelle le prix est exprimé.	N
50	Tableau de prix – date de prise	Pour chaque prix indiqué dans un tableau, la date de prise d'effet (non	N

<b>Numéro de l'élément de données</b>	<b>Nom de l'élément de données</b>	<b>Description de l'élément de données</b>	<b>Mis à la disposition du public</b>
	d'effet non ajustée du prix	ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix.	
51	Tableau de prix – date de fin non ajustée du prix	Pour chaque prix indiqué dans un tableau, la date de fin (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix.	N
52	Tableau de prix – prix	Chaque prix, indiqué dans un tableau, en vigueur à compter de la date précisée dans l'élément de données 50 jusqu'à celle stipulée dans l'élément de données 51.	
53	Écart	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, l'écart précisé sur le prix de référence.	O
54	Monnaie de l'écart	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, la monnaie dans laquelle un écart est libellé.	O
55	Notation de l'écart	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, la manière dont est exprimé un écart.	O
56	Prix d'exercice	Pour le dérivé qui est une option, le prix auquel son titulaire peut acheter ou vendre l'élément sous-jacent.	O
57	Monnaie du prix d'exercice/de la paire de monnaies	La monnaie ou la paire et l'ordre des monnaies dans lesquelles le prix d'exercice est libellé.	N
58	Notation du prix d'exercice	La manière dont le prix d'exercice est exprimé.	O
59	Date de prise d'effet non ajustée du prix	La date de prise d'effet (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix.	N
60	Date de fin non ajustée du prix	La date de fin (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix.	N
61	Prix en vigueur entre la date de prise d'effet non ajustée et la date de fin non ajustée	Le prix en vigueur à compter de la date indiquée dans l'élément de données 59 jusqu'à celle stipulée dans l'élément de données 60.	N

<b>Numéro de l'élément de données</b>	<b>Nom de l'élément de données</b>	<b>Description de l'élément de données</b>	<b>Mis à la disposition du public</b>
62	Date de prise d'effet du prix d'exercice	La date de prise d'effet (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix d'exercice.	N
63	Date de fin du prix d'exercice	La date de fin (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix d'exercice.	N
64	Prix d'exercice en vigueur à la date de prise d'effet associée	Le prix d'exercice en vigueur à compter de la date indiquée dans l'élément de données 62 jusqu'à celle stipulée dans l'élément de données 63.	N
65	Tableau de prix d'exercice – date de prise d'effet non ajustée du prix d'exercice	Pour chaque prix d'exercice indiqué dans un tableau, la date de prise d'effet (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix d'exercice.	N
66	Tableau de prix d'exercice – date de fin non ajustée du prix d'exercice	Pour chaque prix d'exercice indiqué dans un tableau, la date de fin (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix d'exercice.	N
67	Tableau de prix d'exercice – prix d'exercice	Chaque prix d'exercice, indiqué dans un tableau, en vigueur à compter de la date précisée dans l'élément de données 65 jusqu'à celle stipulée dans l'élément de données 66.	
68	Indicateur de modalités non normalisées	L'indication que le dérivé comporte ou non au moins une disposition qui influe considérablement sur son prix, et qu'elle n'a pas été diffusée dans le public.	O
69	Convention de calcul des jours	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, la convention de calcul des jours utilisée pour établir le mode de calcul des paiements d'intérêts.	O
70	Fréquence de révision du taux variable – unité de temps	À l'égard de chaque branche variable d'un dérivé, l'unité de temps de la fréquence des révisions.	O
71	Fréquence de révision du taux variable – multiplicateur	À l'égard de chaque branche variable d'un dérivé, le nombre par lequel est multiplié l'unité de temps de la fréquence de révision du taux variable afin de déterminer la fréquence des	O

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à la disposition du public
		dates de révision du taux des paiements périodiques.	

### 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	Mis à la disposition du public
72	Compensé	Indique si un dérivé a été ou sera compensé par une chambre de compensation.	O
73	Identifiant de la contrepartie centrale	Identifie la chambre de compensation qui a compensé le dérivé.	N
74	Origine du compte de compensation	Indique si le membre compensateur agit comme contrepartiste ou comme mandataire.	N
75	Identifiant du membre compensateur	Identifie le membre compensateur qui fait compenser le dérivé auprès d'une chambre de compensation.	N
76	Horodatage de la réception pour compensation	La date et l'heure, exprimées en temps universel coordonné, auxquelles le dérivé initial a été enregistré comme reçu par la chambre de compensation aux fins de compensation.	N
77	Exceptions et dispenses de compensation – contrepartie 1	Le type de dispense ou d'exception de compensation applicable à la contrepartie 1.	N
78	Exceptions et dispenses de compensation – contrepartie 2	Le type de dispense ou d'exception de compensation applicable à la contrepartie 2.	N

## Éléments de données relatifs aux sûretés et aux marges

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à la disposition du public
79	Catégorie de sûreté	Indique s'il existe une convention de sûreté entre les contreparties et précise la nature de la sûreté.	N
80	Portefeuille contenant un indicateur de composante à ne pas déclarer	Dans le cas où les sûretés sont déclarées au niveau du portefeuille, indique si ce portefeuille inclut des dérivés visés par une dispense ou une exception de déclaration	N
81	Marge initiale déposée par la contrepartie déclarante (avant décote)	La valeur monétaire de la marge initiale déposée par la contrepartie déclarante avant l'application d'une décote.	N
82	Marge initiale déposée par la contrepartie déclarante (après décote)	La valeur monétaire de la marge initiale déposée par la contrepartie déclarante après l'application d'une décote.	N
83	Monnaie de la marge initiale déposée	La monnaie dans laquelle la marge initiale déposée est libellée.	N
84	Marge initiale collectée par la contrepartie déclarante (avant décote)	La valeur monétaire de la marge initiale collectée par la contrepartie déclarante avant l'application d'une décote.	N
85	Marge initiale collectée par la contrepartie déclarante (après décote)	La valeur monétaire de la marge initiale collectée par la contrepartie déclarante après l'application d'une décote.	N
86	Monnaie de la marge initiale collectée	La monnaie dans laquelle la marge initiale collectée est libellée.	N
87	Marge de variation déposée par la contrepartie déclarante (avant décote)	La valeur monétaire de la marge de variation déposée par la contrepartie déclarante avant l'application d'une décote.	N

<b>Numéro de l'élément de données</b>	<b>Nom de l'élément de données</b>	<b>Description de l'élément de données</b>	<b>Mis à la disposition du public</b>
88	Marge de variation déposée par la contrepartie déclarante (après décote)	La valeur monétaire de la marge de variation déposée par la contrepartie déclarante après l'application d'une décote.	N
89	Monnaie de la marge de variation déposée	La monnaie dans laquelle la marge de variation déposée est libellée.	N
90	Marge de variation collectée par la contrepartie déclarante (avant décote)	La valeur monétaire de la marge de variation collectée par la contrepartie déclarante avant l'application d'une décote.	N
91	Marge de variation collectée par la contrepartie déclarante (après décote)	La valeur monétaire de la marge de variation collectée par la contrepartie déclarante après l'application d'une décote.	N
92	Monnaie de la marge de variation collectée	La monnaie dans laquelle la marge de variation collectée est libellée.	N
93	Code du portefeuille de sûretés – marge de variation	Si les sûretés sont déclarées au niveau du portefeuille, le code unique attribué par la contrepartie déclarante qui identifie la marge de variation relative aux transactions ouvertes incluses dans le portefeuille.	N
94	Code du portefeuille de sûretés – marge initiale	Si les sûretés sont déclarées au niveau du portefeuille, le code unique attribué par la contrepartie déclarante qui identifie la marge initiale relative aux transactions ouvertes incluses dans le portefeuille.	N

### **Éléments de données relatifs aux actions et aux événements**

<b>Numéro de l'élément de données</b>	<b>Nom de l'élément de données</b>	<b>Description de l'élément de données</b>	<b>Mis à la disposition du public</b>
95	Horodatage de l'événement	La date et l'heure de l'événement relatif à un dérivé.	O

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à la disposition du public
96	Niveau	Indique si la déclaration se rapporte au dérivé ou à la position.	N
97	Identifiant d'événement	L'identifiant unique qui lie les dérivés se rapportant à un événement.	N
98	Type d'action	Indique le type d'action ou de déclaration qui se rapporte au dérivé ou à la position.	O
99	Type d'événement	Indique le type d'événement du cycle de vie ou le motif de l'action dont il est question à l'élément de données 98.	O
100	Indicateur de modification	Indique si une modification du dérivé se rapporte à un événement.	O

### Éléments de données relatifs à la valorisation

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à la disposition du public
101	Montant de valorisation	La valeur du dérivé.	N
102	Monnaie de valorisation	La monnaie dans laquelle le montant de valorisation est libellé.	N
103	Méthode de valorisation	La source et la méthode utilisées pour valoriser le dérivé.	N
104	Horodatage de la valorisation	La date et l'heure auxquelles a été établie la valeur du dérivé visé dans l'élément de données 101.	N
105	Prochaine date de révision du taux variable de référence	La prochaine date à laquelle le taux variable de référence sera révisé.	N
106	Dernière valeur du taux variable de référence	La valeur du taux variable de référence à la date visée dans l'élément de données 107.	N
107	Dernière date de révision du taux	La date la plus récente de la révision du taux variable de référence.	N

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à la disposition du public
	variable de référence		
108	Delta	Le coefficient exprimant le rapport entre la variation du prix du dérivé et la variation du prix de l'élément sous-jacent du dérivé.	N

### Éléments de données relatifs aux paquets

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à la disposition du public
109	Indicateur de paquet de dérivés	L'indication que le dérivé est ou non une composante d'un paquet qui inclut l'un des éléments suivants :  a) au moins deux dérivés déclarés séparément par la contrepartie déclarante sont conclus en vertu d'une seule entente;  b) au moins deux déclarations relatives au même dérivé si une seule ne peut suffire en raison des obligations de déclaration d'au moins un territoire du Canada ou étranger.	N
110	Identifiant de paquet de dérivés	Identifie le paquet visé à l'élément de données 109.	N
111	Prix du paquet de dérivés	Le prix du paquet visé à l'élément de données 109.	N
112	Monnaie du prix du paquet de dérivés	La monnaie dans laquelle le prix du paquet de dérivés est libellé.	N
113	Écart du paquet de dérivés	Le prix du paquet visé à l'élément de données 109, exprimé sous forme d'écart.	N
114	Monnaie de l'écart du paquet de dérivés	La monnaie dans laquelle l'écart du paquet de dérivés est libellé.	N

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à la disposition du public
115	Notation de l'écart du paquet de dérivés	La manière dont l'écart du paquet de dérivés est exprimé.	N
116	Notation du prix du paquet de dérivés	La manière dont le prix du paquet de dérivés est exprimé.	N

### Éléments de données relatifs au produit

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à la disposition du public
117	Identifiant unique de produit	Un code unique attribué par le Derivatives Service Bureau qui identifie un type de dérivé.	O
118	Point d'attachement de l'indice de swaps sur défaillance	Le point auquel le niveau de pertes du portefeuille sous-jacent d'un swap sur défaillance réduit le notionnel d'une tranche.	N
119	Point de détachement de l'indice de swaps sur défaillance	Le point au-delà duquel les pertes du portefeuille sous-jacent d'un swap sur défaillance ne réduisent plus le notionnel d'une tranche.	N
120	Facteur d'indice	Le facteur de la version de l'indice ou le pourcentage utilisé pour établir le montant notionnel d'un swap sur défaillance.	O
121	Indicateur de cryptoactif sous-jacent	L'indication que l'élément sous-jacent du dérivé est ou non un cryptoactif.	N
122	Code du panier sur mesure	Un identifiant unique pour le panier sur mesure de l'actif de référence.	N
123	Indicateur de panier sur mesure	L'indication que l'élément sous-jacent du dérivé est ou non un panier sur mesure.	N
124	Identifiant des composantes du panier	Identifie un actif de référence composant le panier sur mesure.	N

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à la disposition du public
125	Source de l'identifiant des composantes du panier	La source de l'identifiant des composantes du panier visé à l'élément de données 124.	N
126	Nombre d'unités des composantes du panier	Le nombre d'unités de chaque actif de référence composant le panier sur mesure.	N
127	Unité de mesure des composantes du panier	L'unité de mesure dans laquelle est exprimé le nombre d'unités visé dans l'élément de données 126.	N
128	Identifiant du sous-jacent (Autre)	Identifie chaque élément sous-jacent du dérivé.	N
129	Source de l'identifiant du sous-jacent (Autre)	La source de l'identifiant du sous-jacent (Autre) visé dans l'élément de données 128.	N
130	Identifiant de la plateforme de négociation de l'actif sous-jacent	Identifie la plateforme sur laquelle est négocié l'élément sous-jacent visé dans l'élément de données 128.	N
131	Source du prix de l'actif sous-jacent	La source du prix utilisé pour établir la valeur ou le niveau de l'élément sous-jacent visé dans l'élément de données 128.	N
132	Type d'option incorporée	Le type de disposition facultative dans un dérivé.	O

### Éléments de données relatifs aux paiements et au règlement

Numéro de l'élément de données	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Mis à la disposition du public
133	Date contractuelle de règlement définitif	La date précisée dans la convention à laquelle il faut avoir rempli toutes les obligations prévues par le dérivé.	N

<b>Numéro de l'élément de données</b>	<b>Nom de l'élément de données</b>	<b>Description de l'élément de données</b>	<b>Mis à la disposition du public</b>
134	Lieu de règlement	Le lieu de règlement du dérivé.	N
135	Monnaie de règlement	À l'égard de chaque branche du dérivé, la monnaie dans laquelle le règlement en espèces est libellé.	O
136	Montant de l'autre paiement	Le montant de chaque paiement prévu par un dérivé, à l'exception du montant de la prime de l'option visé dans l'élément de données 144.	O
137	Monnaie de l'autre paiement	La monnaie dans laquelle le montant de l'autre paiement visé dans l'élément de données 136 est libellé.	O
138	Date de l'autre paiement	La date à laquelle le montant de l'autre paiement visé dans l'élément de données 136 sera payé.	N
139	Payeur de l'autre paiement	Identifie le payeur du montant de l'autre paiement visé dans l'élément de données 136.	N
140	Receveur de l'autre paiement	Identifie le receveur du montant de l'autre paiement visé dans l'élément de données 136.	N
141	Type de l'autre paiement	Le motif du paiement visé dans l'élément de données 136.	O
142	Fréquence des paiements – unité de temps	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, l'unité de temps de la fréquence des paiements.	O
143	Fréquence des paiements – multiplicateur	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, le nombre par lequel les unités de temps de la fréquence des paiements sont multipliées afin d'établir la fréquence des dates des paiements périodiques.	O
144	Montant de la prime de l'option	La prime payée par l'acheteur d'une option ou d'une swaption.	O
145	Monnaie de la prime de l'option	La monnaie dans laquelle la prime visée dans l'élément de données 144 est libellée.	O

<b>Numéro de l'élément de données</b>	<b>Nom de l'élément de données</b>	<b>Description de l'élément de données</b>	<b>Mis à la disposition du public</b>
146	Date de paiement de la prime de l'option	La date à laquelle la prime visée dans l'élément de données 144 est payée.	N
147	Première date d'exercice	La première date à laquelle une option peut être exercée.	O
148	Date de fixation	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, la date à laquelle le taux de référence est établi.	N

A.M. 2013-21, Ann. A; N.I. 2014-03-01; A.M. 2014-08, a. 7; A.M. 2016-10, a. 16; A.M. 2024-15, a. 38.

**ANNEXE B  
(ABROGÉE)**

A.M. 2013-21, Ann. B; A.M. 2014-08, a. 8.

## ANNEXE C

### OBLIGATIONS DU RÉFÉRENTIEL CENTRAL RECONNU EN MATIÈRE DE DIFFUSION PUBLIQUE DES DONNÉES SUR LES DÉRIVÉS

A.M. 2016-10, a. 17.

1. Sous réserve des rubriques 2 à 6, le référentiel central reconnu met à la disposition du public, sans frais, pour chaque élément de données figurant à l'Annexe A vis-à-vis duquel apparaît un « O » dans la colonne intitulée « Mis à la disposition du public », les éléments de données compris dans le Tableau 1 relatifs à chaque catégorie d'actifs et identifiant de l'actif sous-jacent indiqué dans le Tableau 2 dans les cas suivants:

a) tout dérivé déclaré au référentiel central reconnu en vertu du présent règlement;

b) tout événement du cycle de vie qui modifie le prix d'un dérivé existant déclaré au référentiel central reconnu en vertu du présent règlement;

c) toute annulation d'une transaction déclarée ou toute correction de données relatives à une transaction déjà mises à la disposition du public, dans chaque cas découlant d'un dérivé visé au paragraphe a ou d'un événement du cycle de vie visé au paragraphe b.

**Tableau 1**

#	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Format de l'élément de données	Valeurs admissibles pour l'élément de données
D1	Identifiant de diffusion	L'identifiant unique et aléatoire attribué par un référentiel central reconnu pour chaque message de données mis à la disposition du public.	Varchar(52)	Jusqu'à 52 caractères alphanumériques
D2	Identifiant de diffusion initiale	Pour les types d'actions suivants déclarés au référentiel central reconnu conformément à l'élément de données 98 de l'Annexe A, l'Identifiant de diffusion attribué conformément à l'élément de données D1 : a) Corriger b) Mettre fin c) Erreur d) Relancer e) Modifier, si l'indicateur de modification de l'élément de données 100 dans l'Annexe A est déclaré au référentiel central reconnu comme étant True.	Varchar(52)	Jusqu'à 52 caractères alphanumériques

#	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données	Format de l'élément de données	Valeurs admissibles pour l'élément de données
D3	Horodatage de la diffusion	La date et l'heure, à la seconde près, à laquelle un référentiel central reconnu met les données à la disposition du public.	YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ, exprimé en temps universel coordonné	Toute représentation valide de la date et de l'heure selon le format de la norme ISO 8601.
D4	Nom abrégé de l'identifiant unique de produit	Une description lisible par l'humain que fournit le Derivatives Service Bureau et qui correspond à l'identifiant unique de produit.	Une liste contenant les valeurs admissibles et leur format sera publiée par le Derivatives Service Bureau.	Une liste contenant les valeurs admissibles et leur format sera publiée par le Derivatives Service Bureau.

**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

## Dispenses

2. La rubrique 1 ne s'applique pas à ce qui suit:
- a) un dérivé qui nécessite plusieurs opérations de change;
  - b) un dérivé résultant d'un exercice bilatéral ou multilatéral de compression de portefeuille;
  - c) un dérivé résultant d'une novation par une chambre de compensation.

## Arrondissement

3. Le référentiel central reconnu arrondit le montant notionnel de chaque dérivé sur lequel il met des données à la disposition du public en vertu du présent règlement et de

la rubrique 1 de la présente annexe conformément aux conventions d'arrondissement énoncées dans le Tableau 3.

**Tableau 3**

<b>Montant notionnel de la branche 1 ou 2 déclaré</b>	<b>Montant notionnel arrondi</b>
< 1 000	Arrondir à la tranche de 5 la plus proche
≥1 000, <10 000	Arrondir à la tranche de 100 la plus proche
≥10 000, <100 000	Arrondir à la tranche de 1 000 la plus proche
≥100 000, <1 million	Arrondir à la tranche de 10 000 la plus proche
≥1 million, <10 millions	Arrondir à la tranche de 100 000 la plus proche
≥10 millions, <50 millions	Arrondir à la tranche de 1 million la plus proche
≥50 millions, <100 millions	Arrondir à la tranche de 10 millions la plus proche
≥100 millions, <500 millions	Arrondir à la tranche de 50 millions la plus proche
≥500 millions, <1 milliard	Arrondir à la tranche de 100 millions la plus proche
≥1 milliard, <100 milliards	Arrondir à la tranche de 500 millions la plus proche
>100 milliards	Arrondir à la tranche de 50 milliards la plus proche

### **Plafonnement**

**4.** Si le montant notionnel arrondi conformément à la rubrique 3 concernant un dérivé visé à la rubrique 1 excède le montant notionnel arrondi plafonné, en dollars canadiens, en fonction de la catégorie d'actifs et de la date d'expiration moins la date de prise d'effet indiquée au Tableau 4, le référentiel central reconnu met à la disposition du public le montant notionnel arrondi plafonné au lieu du montant notionnel arrondi.

**5.** Le référentiel central reconnu qui met à la disposition du public des données sur un dérivé auquel la rubrique 4 s'applique indique que le montant notionnel du dérivé a été plafonné.

**6.** Pour chaque dérivé visé à la rubrique 1 dont le montant notionnel arrondi plafonné est mis à la disposition du public, si les données devant être mises à la disposition du public incluent la prime d'une option, le référentiel central reconnu ajuste la prime d'une manière qui soit conforme et proportionnée à l'arrondissement et au plafonnement du montant notionnel déclaré.

**Tableau 4**

<b>Catégorie d'actifs</b>	<b>Date d'expiration moins la date de prise d'effet</b>	<b>Montant notionnel arrondi plafonné en dollars CA</b>
Taux d'intérêt	2 ans ou moins	250 millions
Taux d'intérêt	Plus de 2 ans et au plus 10 ans	100 millions
Taux d'intérêt	Plus de 10 ans	50 millions
Crédit	Toutes les dates	50 millions
Capitaux propres	Toutes les dates	50 millions

**Délais de diffusion**

**7.** Le référentiel central reconnu met l'information visée à la rubrique 1 à la disposition du public 48 heures après l'heure à laquelle l'élément de données 14 indiqué à l'Annexe A est déclaré pour le dérivé.

**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» du dérivé 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.

A.M. 2016-10, a. 17 ; A.M. 2024-15, a. 39.

**ANNEXE 91-507A1  
DEMANDE DE RECONNAISSANCE À TITRE DE RÉFÉRENTIEL CENTRAL –  
FICHE D'INFORMATION**

**Déposant :**  **RÉFÉRENTIEL CENTRAL**

**Type de document :**  **INITIAL**  **MODIFICATION**

1. Nom complet du référentiel central:
2. Nom sous lequel les activités sont exercées, s'il est différent de celui indiqué à la rubrique 1:
3. Dans le cas d'une modification du nom du référentiel central indiqué à la rubrique 1 ou 2, inscrire le nom antérieur ainsi que le nouveau.

Nom antérieur:

Nouveau nom:

4. Siège

Adresse:

Téléphone:

Télécopieur:

5. Adresse postale (si elle est différente):

6. Autres bureaux

Adresse:

Téléphone:

Télécopieur:

7. Adresse du site Web:

8. Personne-ressource

Nom et titre:

Téléphone:

Télécopieur:

Courrier électronique:

9. Avocat

Cabinet:

Personne-ressource:

Téléphone:

Télécopieur:

Courrier électronique:

10. Avocat canadien

Cabinet:

Personne-ressource:

Téléphone:

Télécopieur:

Courrier électronique:

## **ANNEXES**

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

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

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

### ***Annexe A – Gouvernance***

1. Forme juridique:

Société par actions

Société de personnes

Autre (préciser) :

2. Indiquer ce qui suit:

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

2. Lieu de constitution.

3. Loi en vertu de laquelle le référentiel central a été constitué.

4. Statut réglementaire dans d'autres territoires.

3. Fournir un exemplaire des documents constitutifs (y compris les règlements de la société), des conventions entre actionnaires, des conventions de société et des autres documents semblables ainsi que de toutes les modifications apportées ultérieurement.

4. Fournir les politiques et les procédures de règlement des conflits d'intérêts potentiels découlant du fonctionnement du référentiel central et des services qu'il offre, notamment ceux liés aux intérêts commerciaux du référentiel central, aux intérêts de ses propriétaires et de ses exploitants, aux responsabilités et au bon fonctionnement du référentiel central et ceux pouvant survenir entre les activités du référentiel central et ses responsabilités réglementaires.

5. Le candidat qui demande la reconnaissance à titre de référentiel central conformément aux articles 12 et 14 de la Loi et qui est situé à l'extérieur du Québec doit également fournir les documents suivants:

1. un avis juridique indiquant que, en droit, le candidat a le pouvoir de mettre rapidement ses dossiers à la disposition de l'Autorité et de se soumettre aux inspections et examens effectués sur place par l'Autorité;

2. l'Annexe 91-507A2 dûment remplie.

### ***Annexe B – Propriété***

Fournir la liste des porteurs inscrits ou des propriétaires véritables des titres du référentiel central ou des détenteurs d'autres participations dans celui-ci. Fournir les renseignements suivants sur chaque personne énumérée dans l'annexe:

1. Nom.

2. Principale activité ou occupation et titre.

3. Participation.

4. Nature de la participation, notamment une description du type de titre.

Si le référentiel central est une société par actions cotée, fournir une liste indiquant uniquement les actionnaires qui sont directement propriétaires d'au moins 5% d'une catégorie de ses titres comportant droit de vote.

### ***Annexe C – Constitution***

1. Fournir la liste des associés, dirigeants, gouverneurs et membres du conseil d'administration et de ses comités permanents, ou des personnes exerçant des fonctions semblables, qui occupent actuellement ces postes ou qui les ont occupés au cours de l'année précédente, en indiquant pour chacun les éléments suivants:

1. Nom.
2. Principale activité ou occupation et titre.
3. Dates de début et de fin du mandat ou du poste actuel.
4. Type d'activités principales et employeur actuel.
5. Type d'activités principales au cours des 5 dernières années, si elles diffèrent de celles indiquées à la rubrique 4.
6. Le cas échéant, le fait que la personne est considérée comme un administrateur indépendant.

2. Fournir la liste des comités du conseil en indiquant leur mandat.

3. Fournir le nom du chef de la conformité du référentiel central.

### ***Annexe D – Membres du même groupe***

1. Fournir le nom et l'adresse du siège de chaque membre du même groupe que le référentiel central et décrire sa principale activité.

2. Fournir les renseignements ci-après sur chaque membre du même groupe que le référentiel central qui remplit l'une des conditions suivantes:

*i)* le référentiel central lui a imparti l'un de ses services ou systèmes clés décrit à l'Annexe E, notamment la tenue des dossiers relatifs aux activités, la tenue des dossiers de données sur les opérations, la déclaration des données sur les opérations, la comparaison des données sur les opérations et les listes de données;

*ii)* le référentiel central entretient avec lui toute autre relation d'affaires importante, notamment des prêts et des cautionnements réciproques;

1. Nom et adresse du membre du même groupe.
2. Nom et titre des administrateurs et dirigeants du membre du même groupe ou des personnes exerçant des fonctions semblables.

3. Une description de la nature et de la portée de toute entente contractuelle ou autre conclue avec le référentiel central, et des rôles et responsabilités du membre du même groupe en vertu de celle-ci.

4. Un exemplaire de chaque contrat important lié à des fonctions imparties ou à d'autres relations importantes.

5. Un exemplaire des documents constitutifs (y compris les règlements de la société), des conventions entre actionnaires, des conventions de société et des autres documents semblables.

6. Pour le dernier exercice de tout membre du même groupe avec lequel le référentiel central a conclu des prêts ou des cautionnements réciproques qui sont en cours, les états financiers, qui n'ont pas à être audités, établis conformément aux principes suivants, selon le cas:

a) les PCGR canadiens applicables aux entreprises ayant une obligation d'information du public;

b) les IFRS;

c) les PCGR américains, si le membre du même groupe est constitué en vertu des lois des États-Unis d'Amérique ou d'un territoire des États-Unis d'Amérique.

### ***Annexe E – Fonctionnement du référentiel central***

Décrire en détail le mode de fonctionnement du référentiel central et ses fonctions associées. Cette description devrait notamment comprendre ce qui suit:

1. La structure du référentiel central.

2. Les moyens par lesquels les participants du référentiel central et, s'il y a lieu, leurs clients accèdent aux installations et aux services du référentiel central.

3. Les heures de fonctionnement.

4. La description des installations et des services offerts par le référentiel central, notamment la collecte et la mise à jour des données sur les dérivés.

5. La liste des types de dérivés pour lesquels des dossiers de données sont conservés, qui décrit notamment les caractéristiques des dérivés.

6. Les procédures concernant la saisie, l'affichage et la déclaration des données sur les dérivés.

7. La description des procédures de tenue de dossiers qui permettent de consigner les données sur les dérivés de façon exacte et complète et en temps opportun.

8. Les mesures de protection et les procédures mises en place pour protéger les données sur les dérivés des participants du référentiel central, notamment les politiques et les procédures qui permettent raisonnablement de protéger les renseignements personnels et préserver la confidentialité des données.

9. La formation offerte aux participants et un exemplaire de la documentation qui leur est remise concernant les systèmes, les règles et les autres exigences du référentiel central.

10. Les mesures prises pour s'assurer que les participants du référentiel central sont informés des exigences du référentiel central et s'y conforment.

11. La description du cadre de gestion globale des risques du référentiel central, notamment les risques d'entreprise, juridiques et opérationnels.

Le déposant doit fournir toutes les politiques et procédures ainsi que tous les manuels relatifs au fonctionnement du référentiel central.

### ***Annexe F – Impartition***

Si le référentiel central a imparti à un tiers sans lien de dépendance l'exploitation de services ou de systèmes clés dont il est question à l'Annexe E, notamment la collecte et la mise à jour des données sur les dérivés, fournir les renseignements suivants:

1. Le nom et l'adresse de la personne (y compris tout membre du même groupe que le référentiel central) à qui la fonction a été impartie.

2. Une description de la nature et de la portée de toute entente contractuelle ou autre conclue avec le référentiel central, et des rôles et responsabilités du tiers sans lien de dépendance en vertu de celle-ci.

3. Un exemplaire de chaque contrat important relatif à toute fonction impartie.

### ***Annexe G – Systèmes et élaboration de plans de secours***

Pour chacun des systèmes servant à la collecte et au maintien des déclarations sur les dérivés, décrire ce qui suit:

1. Les estimations de la capacité actuelle et future.

2. Les procédures d'examen de la capacité du système.

3. Les procédures d'examen de la sécurité du système.

4. Les procédures pour effectuer des simulations de crise.

5. Une description des plans de continuité des activités et de reprise après sinistre du déposant, notamment toute documentation pertinente.

6. Les procédures de mise à l'essai des plans de continuité des activités et de reprise après sinistre.

7. La liste des données à déclarer par tous les types de participants.

8. La description du ou des formats de données qui seront mis à la disposition de l'Autorité et des autres personnes qui reçoivent des données sur les opérations.

### ***Annexe H – Accès aux services***

1. Fournir l'ensemble des formulaires, des ententes ou des autres documents portant sur l'accès aux services du référentiel central décrits à la rubrique 4 de l'Annexe E.

2. Décrire les types de participants du référentiel central.

3. Décrire les critères établis par le référentiel central pour accéder à ses services.

4. Décrire les différences en ce qui a trait à l'accès aux services offerts par le référentiel central à différents groupes ou types de participants.

5. Décrire les conditions aux termes desquelles les participants du référentiel central peuvent être suspendus ou exclus en ce qui concerne l'accès aux services du référentiel central.

6. Décrire les procédures suivies en cas de suspension ou d'exclusion d'un participant.

7. Décrire les dispositions prises par le référentiel central pour permettre aux clients des participants d'accéder à celui-ci. Fournir un exemplaire des ententes ou de la documentation relatives à ces dispositions.

### ***Annexe I – Droits***

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

## ATTESTATION DU RÉFÉRENTIEL CENTRAL

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

FAIT à \_\_\_\_\_ le \_\_\_\_\_ 20\_\_\_\_\_.

\_\_\_\_\_  
(Nom du référentiel central)

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

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

\_\_\_\_\_  
(Titre officiel – en caractères d'imprimerie)

### S'IL Y A LIEU, ATTESTATION ADDITIONNELLE DU RÉFÉRENTIEL CENTRAL SITUÉ À L'EXTÉRIEUR DU QUÉBEC

Le soussigné atteste ce qui suit:

a) il mettra ses dossiers à la disposition de l'Autorité et se soumettra aux inspections et examens effectués sur place par l'Autorité;

b) en droit, il a le pouvoir:

i) de mettre ses dossiers à la disposition de l'Autorité;

ii) de se soumettre aux inspections et examens effectués sur place par l'Autorité.

FAIT à \_\_\_\_\_ le \_\_\_\_\_ 20\_\_\_\_\_.

\_\_\_\_\_  
(Nom du référentiel central)

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

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

\_\_\_\_\_  
(Titre officiel – en caractères d'imprimerie)

A.M. 2013-21, Ann. 91-507A1; A.M. 2016-10, a. 18 ; A.M. 2024-15, a. 40.

## **ANNEXE 91-507A2**

### **ACTE D'ACCEPTATION DE COMPÉTENCE ET DE DÉSIGNATION D'UN MANDATAIRE AUX FINS DE SIGNIFICATION PAR LE RÉFÉRENTIEL CENTRAL**

1. Nom du référentiel central (le «référentiel central»):

---

2. Territoire de constitution, ou équivalent, du référentiel central:

---

3. Adresse de l'établissement principal du référentiel central:

---

4. Nom du mandataire aux fins de signification du référentiel central (le «mandataire»):

---

5. Adresse du mandataire aux fins de signification au Québec :

---

6. Le référentiel central désigne et nomme le mandataire comme mandataire à qui signifier tout avis, acte de procédure, citation à comparaître, sommation ou autre acte dans toute action, enquête ou instance administrative, criminelle, quasi criminelle ou autre découlant de ses activités au Québec. Il renonce irrévocablement à tout droit de contester la signification à son mandataire au motif qu'elle ne le lie pas.

7. Le référentiel central accepte sans conditions la compétence non exclusive *i)* des tribunaux judiciaires et administratifs du Québec et *ii)* de toute instance intentée dans une province ou un territoire et découlant de la réglementation et de la supervision des activités du référentiel central au Québec ou s'y rattachant.

8. Le référentiel central s'engage à déposer, au moins 30 jours avant de cesser d'être reconnu ou dispensé par l'Autorité, un nouvel acte d'acceptation de compétence et de désignation d'un mandataire aux fins de signification établi conformément à la présente annexe qui restera en vigueur pendant 6 ans après qu'il aura cessé d'être reconnu ou dispensé, sauf modification conforme à l'article 9.

9. Le référentiel central s'engage à déposer une version modifiée du présent acte d'acceptation de compétence et de désignation d'un mandataire aux fins de signification au moins 30 jours avant tout changement de nom ou d'adresse du mandataire, pendant 6 ans après qu'il aura cessé d'être reconnu ou dispensé par l'Autorité de la reconnaissance prévue à l'article 12 de la Loi.

10. Le présent acte d'acceptation de compétence et de désignation d'un mandataire aux fins de signification est régi par les lois du Québec et s'interprète conformément à ces lois.

Date : \_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_  
Signature du référentiel central de données

\_\_\_\_\_  
Nom et titre du signataire autorisé du référentiel central

## MANDATAIRE

### CONSENTEMENT À AGIR COMME MANDATAIRE AUX FINS DE SIGNIFICATION

Je, \_\_\_\_\_ (nom complet du mandataire), résidant au \_\_\_\_\_ (adresse), accepte la désignation comme mandataire aux fins de signification de \_\_\_\_\_ (insérer le nom du référentiel central) et consens à agir en cette qualité selon les modalités de l'acte de désignation signé par \_\_\_\_\_ (insérer le nom du référentiel central) le \_\_\_\_\_ (date).

Date : \_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_  
Signature du mandataire

\_\_\_\_\_  
Écrire en lettres moulées le nom du signataire autorisé et, si le mandataire n'est pas une personne physique, son titre

A.M. 2013-21, Ann. 91-507A2, A.M. 2016-10, a. 19 ; A.M. 2024-15, a. 41.

## **ANNEXE 91-507A3**

### **RAPPORT DE CESSATION D'ACTIVITÉ DU RÉFÉRENTIEL CENTRAL**

1. Identification:
  - A. Nom complet du référentiel central reconnu:
  - B. Nom sous lequel l'activité est exercée, s'il est différent du nom indiqué au point 1A:
2. Date probable de cessation d'activité du référentiel central reconnu:
3. Si la cessation d'activité a été involontaire, date à laquelle le référentiel central a cessé son activité:

#### **Annexes**

Déposer toutes les annexes avec le rapport de cessation d'activité. Sur chacune des annexes, inscrire le nom du référentiel central, la date du dépôt de l'annexe ainsi que la date à laquelle l'information est arrêtée (si cette date est différente de la date du dépôt). Si une annexe ne s'applique pas, l'indiquer.

#### **Annexe A**

Les raisons de la cessation d'activité du référentiel central reconnu.

#### **Annexe B**

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

#### **Annexe C**

La liste de tous les participants qui sont des contreparties à des transactions dont les données sur les dérivés sont à déclarer en vertu du présent règlement et auxquels le référentiel central a fourni des services au cours des 30 jours précédant la cessation de son activité.

## ATTESTATION DU RÉFÉRENTIEL CENTRAL

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

FAIT à \_\_\_\_\_ le \_\_\_\_\_ 20 \_\_\_\_\_.

\_\_\_\_\_  
(Nom du référentiel central)

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

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

\_\_\_\_\_  
(Titre officiel – en caractères d'imprimerie)

A.M. 2013-21, Ann. 91-507A3 ; A.M. 2024-15, a. 42.

Décision 2013-PDG-0192, 2013-11-13  
Bulletin de l'Autorité: 2013-12-19, Vol. 10, n° 50  
A.M. 2013-21, 2013 G.O. 2, 5581

### **Modifications**

Décision 2014-PDG-0113, 2014-09-25  
Bulletin de l'Autorité: 2014-10-31, Vol. 11, n° 43  
A.M. 2014-08, 2014 G.O. 2, 3950

Décision 2016-PDG-0072, 2016-05-18  
Bulletin de l'Autorité : Vol. 13, n° 25  
A.M. 2016-10, 2016 G.O. 2, 2998

Décision 2023-PDG-0039, 2023-08-09  
Bulletin de l'Autorité : 2023-09-14, Vol. 20 n° 36  
A.M. 2023-16, 2023 G.O. 2, 4119A

Décision 2025-PDG-0046, 2024-09-25  
Bulletin de l'Autorité : 2025-10-24, Vol. 21, n° 42  
A.M. 2024-15, 2024 G.O. 2, 6386

N.I. 2025-04-01