

**DÉCISION N° 2024-PDG-0007**

**KOR Reporting Inc.**

**(Reconnaissance à titre de référentiel central en vertu de la *Loi sur les instruments dérivés*)**

Vu la demande déposée par KOR Reporting Inc. (« KOR ») auprès de l'Autorité des marchés financiers (l'« Autorité ») le 13 octobre 2023, afin d'obtenir la reconnaissance à titre de référentiel central (la « demande ») en vertu de l'article 12 de la *Loi sur les instruments dérivés*, RLRQ, c. I-14.01 (la « LID »);

Vu les déclarations et l'information fournie par KOR au soutien de la demande, notamment :

1. KOR est une personne morale constituée le 22 avril 2021 en vertu des lois du Delaware et dont le siège est situé à Marietta, dans l'état de Géorgie, États-Unis;
2. KOR est une filiale en propriété exclusive de KOR US Holdings Inc., une société constituée en vertu des lois du Delaware;
3. KOR est liée par un contrat intragroupe à une société dénommée KOR Financial Inc. également détenue par KOR US Holdings Inc. Le contrat prévoit les modalités et la nature des services que KOR Financial Inc. fournit à KOR, soit, entre autres, les services de technologie, de soutien à la clientèle, de comptabilité ainsi que les services juridiques;
4. KOR est un référentiel central inscrit provisoirement auprès de la Commodity Futures Trading Commission (la « CFTC ») à titre de *Swap Data Repository* (un « SDR ») en vue de fournir, à ce titre, des services pour la déclaration de transactions sur dérivés ayant les catégories d'actifs sous-jacents suivants : le crédit, les taux d'intérêt, le change, les actions et les marchandises;
5. KOR a obtenu la reconnaissance de la Australian Securities and Investments Commission à titre de *Australian Derivative Trade Depository* le 9 novembre 2023;
6. KOR offrira ses services de référentiel central, permettant aux contreparties déclarantes telles que définies dans le *Règlement 91-507 sur les référentiels centraux et la déclaration de données sur les dérivés*, RLRQ, c. I-14.01, r. 1.1 (le « Règlement 91-507 »), de déclarer leurs opérations sur dérivés de gré à gré ayant les catégories d'actifs sous-jacents suivants : le crédit, les taux d'intérêt, le change, les actions et les marchandises;

7. KOR n'a pas de bureaux ni d'autres installations physiques au Québec ou dans une autre province ou territoire du Canada et ne prévoit pas en établir;
8. KOR se conformera à toutes les exigences de la LID et de ses règlements d'application, y compris les exigences figurant dans le Règlement 91-507;

Vu la surveillance de la CFTC à laquelle est actuellement assujettie KOR à titre de SDR;

Vu le protocole d'entente en matière de coopération et d'échange d'information concernant la supervision d'entités réglementées transfrontalières conclu par la CFTC, l'Alberta Securities Commission, la British Columbia Securities Commission, la Commission des valeurs mobilières de l'Ontario et l'Autorité en date du 25 mars 2014;

Vu la publication pour commentaires de la demande au Bulletin de l'Autorité le 19 octobre 2023 [(2023) vol. 20, n°41, B.A.M.F., section 7.3] pour une période de 30 jours conformément à l'article 14 de la LID;

Vu l'absence de commentaires à la suite de cette publication;

Vu le pouvoir de l'Autorité de reconnaître un référentiel central aux conditions qu'elle détermine conformément à l'article 15 de la LID;

Vu le dépôt par KOR auprès de l'Autorité de l'information et des documents requis lors de la demande de reconnaissance en vertu du chapitre 2 du Règlement 91-507;

Vu les exigences applicables de la LID et de ses règlements d'application, y compris les exigences figurant dans le Règlement 91-507 auxquelles KOR sera assujettie lorsqu'elle sera reconnue à titre de référentiel central par l'Autorité;

Vu la confirmation par KOR de l'acceptation des conditions énoncées dans la présente décision;

Vu l'analyse effectuée par la Direction principale de l'encadrement des activités de marché et des dérivés ainsi que la recommandation du surintendant des valeurs mobilières de reconnaître KOR à titre de référentiel central;

Vu l'Autorité qui, sur le fondement de l'information fournie et des déclarations qui lui ont été faites par KOR, juge qu'il est opportun et n'est pas contraire à l'intérêt public de reconnaître KOR à titre de référentiel central;

En conséquence, l'Autorité reconnaît KOR à titre de référentiel central en vertu de l'article 12 de la LID aux conditions suivantes :

### **1. Obligation générale**

KOR se conforme à toutes les exigences applicables de la LID et de ses règlements d'application, y compris les exigences figurant dans le Règlement 91-507.

## **2. Supervision et conformité aux États-Unis**

KOR maintient sa qualité de SDR auprès de la CFTC aux États-Unis et demeure assujettie à la surveillance réglementaire de la CFTC.

KOR continue de se conformer à la législation et à la réglementation des États-Unis applicables aux référentiels centraux et aux exigences des autorités de réglementation des États-Unis qui s'appliquent à son exploitation et à ses activités.

KOR avise rapidement l'Autorité par écrit de tout changement important ou projet de changement important dans sa qualité de SDR aux États-Unis ou dans la surveillance réglementaire de la CFTC.

## **3. Propriété**

KOR remet à l'Autorité un avis écrit ainsi qu'une description détaillée et une évaluation de l'incidence de tout changement de contrôle de sa société mère, KOR US Holdings Inc., 90 jours avant la prise d'effet du changement.

## **4. Services offerts**

KOR est reconnue au Québec à titre de référentiel central auquel les contreparties déclarantes communiquent des données sur les opérations sur dérivés basés sur les catégories d'actifs sous-jacents suivants : le crédit, les taux d'intérêt, le taux de change, les actions et les marchandises. KOR obtient l'approbation écrite préalable de l'Autorité pour agir à titre de référentiel central pour d'autres catégories d'actifs sous-jacents.

## **5. Confidentialité**

KOR protège la confidentialité de l'information qu'elle reçoit dans l'exercice de ses activités au Québec, en conformité avec la législation sur l'accès à l'information et sur la protection des renseignements personnels y étant applicable.

## **6. Accès et participation**

Trente jours après la fin de chaque semestre à compter de la date de la présente décision, KOR remet à l'Autorité une liste des contreparties locales, au sens prévu dans le Règlement 91-507 (les « contreparties locales »), auto-identifiées auxquelles elle a donné accès à ses services. Si une contrepartie locale demande l'accès aux services de KOR et que cet accès lui est refusé, KOR en avise rapidement l'Autorité.

## **7. Déclaration des données**

### *a) Collecte des données*

KOR avise l'Autorité de tout changement important apporté aux spécifications des méthodes (y compris les modèles et les systèmes) de collecte des données qui lui

sont déclarées par les participants en vertu du Règlement 91-507, ou à la définition, à la structure et au format des données, au moins 45 jours avant la mise en œuvre du changement; si le changement apporté n'est pas important, le délai est d'au moins une semaine.

KOR ne modifie, ne crée, ne supprime, ne définit ou ne change autrement les champs de données que doivent déclarer les participants qui sont des contreparties déclarantes ou qui déclarent des données au nom de contreparties déclarantes en vertu du Règlement 91-507 que d'une manière et dans un délai jugés acceptables par l'Autorité après avoir consulté KOR et pris en compte toute implication pratique de telles modifications sur KOR.

KOR détermine l'ordre des données sur les événements du cycle de vie à déclarer en vertu du Règlement 91-507 et relie les événements du cycle de vie aux données à communiquer à l'exécution de l'opération initiale. Pour les champs de données concernant une catégorie d'actifs sous-jacents ou un produit en particulier à déclarer en vertu du Règlement 91-507 pour chaque opération, KOR collabore avec l'Autorité pour donner aux participants qui sont des contreparties locales le choix de donner une valeur indiquant qu'un champ n'est pas pertinent pour l'opération.

KOR n'accepte pas les opérations à déclarer en vertu du Règlement 91-507 si des champs de données qui doivent obligatoirement être remplis en vertu du Règlement 91-507 ont été laissés en blanc.

b) *Mise à la disposition du public des données en vertu de l'article 39 du Règlement 91-507*

KOR s'assure que les données devant être mises à la disposition du public en vertu de l'article 39 du Règlement 91-507, s'il y a lieu, sont présentées dans un format et diffusées d'une manière que l'Autorité juge acceptables. Sans que soit limitée la portée générale de ce qui précède, KOR s'assure que le public peut facilement se procurer ces données ou y avoir accès en se rendant à la page d'accueil de son site Web.

KOR s'assure que les données globales devant être mises à la disposition du public en vertu de l'article 39 du Règlement 91-507 remplissent les critères indiqués à l'annexe A de la présente décision. KOR s'assure que toutes les autres données devant être mises à la disposition du public en vertu de l'article 39 du Règlement 91-507 ne sont pas mises à la disposition du public avant que l'Autorité n'ait approuvé la méthode et le format de diffusion.

KOR anonymise les données devant être mises à la disposition du public en vertu de l'article 39 du Règlement 91-507.

KOR exclut des données devant être mises à la disposition du public en vertu de l'article 39 du Règlement 91-507 les opérations désignées comme « intragroupe » qui lui sont soumises.

KOR ne modifie, ne crée, ne supprime, ne définit ou ne change autrement les données qui doivent être mises à la disposition du public en vertu de l'article 39 du Règlement 91-507 que d'une manière et dans un délai jugés acceptables par l'Autorité après avoir consulté KOR et pris en compte toute incidence pratique de telles modifications sur KOR.

Sur demande de l'Autorité, KOR reporte puis reprend ultérieurement la mise à la disposition du public des données à déclarer en vertu de l'article 39 du Règlement 91-507, d'une manière et dans un délai jugés acceptables par l'Autorité.

c) *Accès aux données*

Il est entendu que selon l'article 37 du Règlement 91-507, KOR fournit à l'Autorité un accès direct, continu et rapide aux données qui lui ont été déclarées en vertu du Règlement 91-507 qu'elle a en sa possession et qui sont nécessaires à l'Autorité dans l'accomplissement de son mandat, y compris, sans limitation, les données à communiquer à l'exécution, les données sur les événements du cycle de vie et les données de valorisation, au moyen d'un portail sécurisé d'une manière et dans un délai jugés acceptables par l'Autorité.

De plus, au moins une fois par jour, KOR fournit à l'Autorité les données à communiquer à l'exécution qui correspondent aux événements du cycle de vie survenus jusqu'au plus récent événement du cycle de vie, inclusivement, ainsi que les données de valorisation, au moyen d'un portail sécurisé pour les données qui lui sont déclarées en vertu du Règlement 91-507.

KOR collabore avec l'Autorité en fournissant les rapports que cette dernière pourrait demander, y compris, sans limitation, des rapports sur les événements du cycle de vie et sur les opérations ayant trait aux données qui lui ont été déclarées en vertu du Règlement 91-507, d'une manière et dans un délai jugés acceptables par l'Autorité.

KOR applique des mesures exemplaires du secteur pour faire en sorte qu'un numéro de la version et une mention de la date identifient clairement les changements apportés aux méthodes d'extraction et de chargement des données à déclarer à l'Autorité en vertu du Règlement 91-507. Sauf si, en vertu de l'article 3 de ce règlement, elle doit déposer une modification de l'information fournie au formulaire prévu à l'Annexe 91-507A1, KOR fournit à l'Autorité un résumé des modifications apportées aux méthodes d'extraction et de chargement des données une semaine avant la mise en œuvre de ces modifications.

Lorsqu'une opération est subdivisée en une série d'unités comportant de multiples dates de règlement, KOR établit la valeur du prix de règlement de chaque unité en fonction des modalités de ces produits. La valeur globale de toutes les unités prises individuellement dans la position d'un produit doit être égale au cours de l'ensemble équivalent de positions ouvertes pour chaque participant.

## **8. Modification de l'information**

Si KOR est tenue de déposer une modification à l'information fournie au formulaire prévu à l'Annexe 91-507A1 conformément au paragraphe 1 de l'article 3 du Règlement 91-507 et que la modification projetée doit également être déposée auprès de la CFTC, elle peut satisfaire à cette obligation de dépôt en fournissant simultanément à l'Autorité l'information déposée auprès de la CFTC.

Si un changement significatif touchant l'information fournie au formulaire prévu à l'Annexe 91-507A1 n'est pas à déposer auprès de la CFTC par ailleurs ou qu'il ne concerne que le Canada en ce qu'il ne porte que sur les activités de référentiel central de KOR au Canada, celle-ci doit se conformer à l'obligation de dépôt prévue au paragraphe 1 de l'article 3 du Règlement 91-507.

## **9. Changements dans les règles**

Conformément à l'article 3 du Règlement 91-507, KOR ne peut mettre en œuvre un changement significatif touchant l'information fournie au formulaire prévu à l'Annexe 91-507A1, incluant celle fournie dans le cadre de sa demande de reconnaissance que si elle a déposé auprès de l'Autorité la modification du formulaire comportant cette information 45 jours avant sa mise en œuvre.

KOR n'applique à ses participants du Canada que les règles énoncées dans le manuel de règles Canadien (*Rulebook*) ou dans tout autre document spécifique aux participants au Canada. Si KOR est tenue de déposer des changements aux règles applicables aux participants au Canada auprès de la Commission des valeurs mobilières de l'Ontario pour approbation, elle fournit à l'Autorité, au moment du dépôt et au plus tard 10 jours ouvrables avant la date de prise d'effet prévue, tout changement dans les règles applicables aux participants au Canada.

KOR fournit à l'Autorité, dans les 30 jours suivant la fin de chaque trimestre, un exemplaire du manuel de règles canadien ou de tout autre document spécifique aux participants au Canada indiquant les changements cumulatifs qui y ont été apportés au cours du trimestre.

## **10. Systèmes**

KOR donne à l'Autorité un préavis d'au moins 30 jours avant la finalisation de l'examen prévu au paragraphe 6 de l'article 21 du Règlement 91-507, et après consultation avec

l'Autorité, apporte à la portée de cet examen toute modification raisonnable que demande l'Autorité.

## **11. Tarification**

Sur demande de l'Autorité, KOR examine la tarification de ses services au Québec. Elle fournit à l'Autorité un rapport écrit sur les conclusions de cet examen dans les 30 jours suivant la fin de l'examen.

## **12. Commercialisation des données**

KOR ne limite pas sans motif valable l'accès aux données qui lui sont déclarées en vertu du Règlement 91-507 et qui doivent être mises à la disposition du public en vertu de l'article 39 de ce règlement, ni l'utilisation qui est faite de ces données, sans l'approbation préalable écrite de l'Autorité.

Conformément au sous-paragraphe a du paragraphe 2 de l'article 22 du Règlement 91-507, il est entendu que KOR ne peut communiquer à des fins commerciales ou d'affaires les données qui lui ont été déclarées, avant que ces données soient mises à la disposition du public.

KOR ne doit pas, comme condition à l'obtention de la qualité de participant ou à la communication des données qui lui sont déclarées en vertu du Règlement 91-507 par un participant, exiger le consentement du participant à la publication des données déclarées à des fins commerciales ou d'affaires.

Si les données déclarées à KOR en vertu du Règlement 91-507 contiennent des renseignements exclusifs de tiers, KOR a la responsabilité d'obtenir tous les consentements nécessaires de ces tiers avant de communiquer les données à des fins commerciales ou d'affaires.

Lorsque KOR apporte un changement aux modalités d'accès ou d'utilisation concernant les données qui lui sont déclarées et qui doivent être mises à la disposition du public, il donne à l'Autorité un avis de ces changements 30 jours avant leur prise d'effet et y inclut une description détaillée de ceux-ci.

En plus de se conformer au paragraphe 2 de l'article 22 du Règlement 91-507, KOR ne peut communiquer les données qui lui sont déclarées en vertu du Règlement 91-507 à des fins commerciales ou d'affaires relativement à une gamme de produits ou de services sans d'abord obtenir l'approbation écrite préalable de l'Autorité quant au type et à la nature de la gamme de produits ou de services commerciaux ou d'affaires, de la manière suivante :

- a) KOR donne à l'Autorité un avis écrit du type et de la nature de la gamme de produits ou de services commerciaux ou d'affaires au moins 10 jours ouvrables avant la date prévue de lancement de la gamme;

- b) si l'Autorité ne s'oppose pas à la gamme de produits ou de services dans les 10 jours ouvrables de la réception de l'avis, la gamme est réputée approuvée par elle;
- c) si l'Autorité s'oppose à la gamme de produits ou de services dans les 10 jours ouvrables de la réception de l'avis, elle procède à un examen et prend une décision concernant l'approbation de la gamme dans les 30 jours suivant la remise de l'avis de KOR visé au paragraphe a ci-dessus.

### **13. Dispositions transitoires**

KOR facilite, à la satisfaction de l'Autorité, la mise à l'essai de l'accès et de la connectivité à ses systèmes par l'Autorité.

KOR effectue des essais relativement aux participants qui sont des contreparties locales et obtient des résultats que l'Autorité juge satisfaisants pour s'assurer que les données et les rapports à communiquer à l'Autorité par l'entremise de ses services de référentiel central au Québec donnent une image exacte et complète de l'ensemble des données qui doivent être communiquées par les participants qui sont des contreparties locales. KOR remet à l'Autorité un compte rendu des résultats rapidement après la fin des essais.

Pendant les deux années qui suivent la date de la présente décision, KOR remet à l'Autorité, 30 jours après la fin de chaque trimestre, un rapport résumant le nombre de demandes d'accès à ses services de référentiel central qui sont en cours au Québec à la fin de chaque trimestre et tout problème important rencontré au cours du trimestre en ce qui a trait à l'accueil de nouveaux participants ou aux déclarations d'information de contreparties locales, ainsi que les mesures prévues par KOR pour régler tout problème rencontré.

KOR veille à ce que soit fourni à l'Autorité un accès approprié, y compris un accès direct, des flux de données, un navigateur et des interfaces Internet, des rapports ou toute autre forme pertinente d'accès.

KOR suit les activités de développement des fournisseurs de services qu'elle engage pour tous les systèmes (y compris les applications) de soutien à ses fonctions de référentiel central, et veille à ce que ses systèmes soient sécuritaires et à ce que les vulnérabilités en matière de sécurité des systèmes soient surveillées et rapidement corrigées.

KOR veille à ce que les travaux nécessaires de maintenance et de mise à niveau de ses services et systèmes de référentiel central soient effectués dans le bon ordre de priorité et par des effectifs suffisants et à ce que, au besoin, les problèmes rencontrés soient transmis à la haute direction.

### **14. Obligations d'information**

KOR signale rapidement à l'Autorité tout événement, toute circonstance ou toute situation qui pourrait sensiblement l'empêcher de continuer de se conformer aux conditions de la



présente décision. Dès qu'elle peut raisonnablement le faire, KOR avise l'Autorité de toute intervention d'urgence prévue qui aurait pour effet de modifier, de limiter, de suspendre ou d'interrompre ses services. KOR fournit rapidement à l'Autorité l'information concernant toute enquête ou action en justice connue d'importance entamée contre elle, à la condition qu'aucune loi applicable ne lui interdise de le faire. KOR fournit rapidement à l'Autorité les détails concernant, s'il y a lieu, la nomination d'un séquestre ou la conclusion d'un arrangement volontaire avec ses créanciers.

#### **15. Échange d'informations et coopération entre les autorités de réglementation**

KOR fournit à l'Autorité l'information concernant ses activités à titre de référentiel central reconnu et les documents qui lui sont demandés à l'occasion, et coopère par ailleurs avec l'Autorité, sous réserve de la législation, notamment la législation en matière de protection des renseignements personnels (y compris le privilège du secret professionnel de l'avocat), qui régit l'échange d'informations et la protection des renseignements personnels.

KOR fournit aux autorités autres que l'Autorité l'accès aux données à déclarer en vertu du Règlement 91-507, conformément aux lois et aux règlements pertinents régissant cet accès.

Fait le 28 février 2024.

---

Yves Ouellet  
Président-directeur général

## ANNEXE A

### Modèle de données globales à mettre à la disposition du public

Un référentiel central reconnu au Québec (un « référentiel central reconnu ») est tenu de faire connaître au public l'étendue et le type des données globales indiquées dans la présente annexe pour remplir ses obligations en vertu de l'article 39 du Règlement 91-507.

#### Partie I Notionnel courant et nombre de positions ouvertes

1. Pour chaque période de référence, un référentiel central reconnu doit publier les données qui suivent à la date du rapport :
  - a) le notionnel brut de toutes les positions ouvertes;
  - b) le nombre total de positions ouvertes.
2. Un référentiel central reconnu doit publier au moins les données visées à la rubrique 1 pour les périodes de référence suivantes :
  - a) la semaine courante;
  - b) la semaine précédente;
  - c) les quatre semaines précédant la semaine courante.
3. Un référentiel central reconnu doit publier les données visées à la rubrique 1 selon les ventilations suivantes :
  - a) catégories d'actifs : marchandises, taux d'intérêt, crédit, change et capitaux propres;
  - b) catégories d'actifs du paragraphe a selon la durée : 0 à 3 mois, 3 à 6 mois, 6 à 12 mois, 12 à 24 mois, 24 à 60 mois, et plus de 60 mois;
  - c) catégories d'actifs du paragraphe a selon que l'opération est compensée ou non.

4. Un référentiel central reconnu doit publier les données visées à la rubrique 1 selon les catégories de produits suivantes pour chaque catégorie d'actifs :

<b>Marchandises</b>	<b>Taux d'intérêt</b>	<b>Crédit</b>	<b>Change</b>	<b>Capitaux propres</b>
Métaux	Swap sur taux d'intérêt	Référencé à une seule entité souveraine	Contrats à terme de gré à gré non livrables	Swap référencé à une seule entité
Électricité	Contrat de garantie de taux	Référencé à une seule entité non souveraine	Options non livrables	Swap référencé à un seul indice
Gaz naturel	Échange de devises	Indice (y compris tranche d'indice)	Contrat à terme de gré à gré	Swap sur panier
Pétrole	Option (y compris plafond/plancher)	Swap sur rendement total	Option classique	Contrat sur différence
Charbon	Exotique	Swaptions	Exotique	Option
	Autre	Exotique	Autre	Contrat à terme de gré à gré
Agriculture		Autre		Exotique
Environnement				Autre
Fret				
Exotique				
Autre				

5. Malgré la rubrique 4, un référentiel central reconnu doit publier les données visées à la rubrique 1 pour une catégorie de produits en particulier précisée à la rubrique 4 dans la catégorie « Autre » s'il y a moins de 30 positions ouvertes dans cette catégorie de produits pour une période donnée.
6. Malgré les rubriques 3 et 4, un référentiel central reconnu n'est pas tenu de déclarer le notionnel brut de toutes les positions ouvertes pour la catégorie d'actif « marchandises ».
7. Un référentiel central reconnu doit commencer la publication des données requises en vertu du paragraphe a de la rubrique 2 de la présente partie, à partir de la première semaine où il accepte des données dans son environnement de production.

## Partie II Notionnel de renouvellement et nombre d'opérations

1. Pour chaque période de référence, un référentiel central reconnu doit publier les données qui suivent à la date du rapport :
  - a) le notionnel de renouvellement brut (c'est-à-dire le notionnel brut de toutes les nouvelles opérations conclues pendant la période en question);
  - b) le nombre total d'opérations.
2. Un référentiel central reconnu doit publier au moins les données visées à la rubrique 1 pour les périodes de référence suivantes :
  - a) la semaine courante;
  - b) la semaine précédente;
  - c) les quatre dernières semaines.
3. Un référentiel central reconnu doit publier les données visées par la rubrique 1 selon les ventilations suivantes :
  - a) catégories d'actifs : marchandises, taux d'intérêt, crédit, change et capitaux propres;
  - b) catégories d'actifs du paragraphe a selon la durée : 0 à 3 mois, 3 à 6 mois, 6 à 12 mois, 12 à 24 mois, 24 à 60 mois, et plus de 60 mois;
  - c) catégories d'actifs du paragraphe a selon que l'opération est compensée ou non.
4. Un référentiel central reconnu doit publier les données visées à la rubrique 1 selon les catégories de produits suivantes pour chaque catégorie d'actifs :

<b>Marchandises</b>	<b>Taux d'intérêt</b>	<b>Crédit</b>	<b>Change</b>	<b>Capitaux propres</b>
Métaux	Swap sur taux d'intérêt	Référencé à une seule entité souveraine	Contrats à terme de gré à gré non livrables	Swap référencé à une seule entité
Électricité	Contrat de garantie de taux	Référencé à une seule entité non-souveraine	Options non livrables	Swap référencé à un seul indice
Gaz naturel	Échange de devises	Indice (y compris tranche d'indice)	Contrat à terme de gré à gré	Swap sur panier

Marchandises	Taux d'intérêt	Crédit	Change	Capitaux propres
Pétrole	Option (y compris plafond/plancher)	Swap sur rendement total	Option classique	Contrat sur différence
Charbon	Exotique	Swaptions	Exotique	Option
Indice	Autre	Exotique	Autre	Contrat à terme de gré à gré
Agriculture		Autre		Exotique
Environnement				Autre
Fret				
Exotique				
Autre				

5. Malgré la rubrique 4, un référentiel central reconnu doit publier les données visées à la rubrique 1 pour une catégorie de produits en particulier précisée à la rubrique 4 dans la catégorie « Autre » lorsqu'il y a eu moins de cinq nouvelles opérations dans cette catégorie de produits au cours des quatre semaines précédentes.
6. Malgré les rubriques 3 et 4, un référentiel central reconnu n'est pas tenu de déclarer le notionnel de renouvellement pour la catégorie d'actifs « marchandises ».
7. Un référentiel central reconnu doit commencer la publication des données requises en vertu de la présente partie à partir de la première semaine où il accepte des données dans son environnement de production.

### Notes explicatives

<b>Monnaie</b>	La monnaie de libellé des déclarations est le <b>dollar canadien</b> . Les référentiels centraux sont libres de choisir le taux de conversion, mais doivent indiquer la source dans les déclarations. Si la monnaie de libellé d'une opération n'est pas le dollar canadien, le notionnel équivalent en dollars canadiens doit être établi au moyen du taux de conversion en vigueur à la date de publication de la déclaration.
<b>Nombre d'opérations</b>	Représente le nombre de nouvelles opérations uniques déclarées à un référentiel central au cours d'une semaine.  Chaque opération est inscrite une seule fois, et les accords de compensation (y compris de compression) ne sont pas pris en compte.

<b>Opérations préexistantes</b>	Les opérations préexistantes devraient être incluses dans le calcul du notionnel en cours total et du nombre de positions ouvertes, mais exclues du calcul du notionnel de renouvellement et du nombre de nouvelles positions.
<b>Position ouverte</b>	S'entend d'un aperçu des positions ouvertes à la fin de la période de référence.
<b>Date de publication</b>	Les référentiels centraux devraient publier des données globales au plus tard le mercredi suivant la semaine de référence.
<b>Durée</b>	<p>Pour le notionnel courant et les positions ouvertes, utiliser la durée restante du contrat, c'est-à-dire la différence entre <b>la date de la fin de la semaine de la période de référence</b> et la date d'expiration de la position.</p> <p>Pour le notionnel de renouvellement et/ou le nombre d'opérations, utiliser l'échéance initiale, qui correspond à la différence entre la date de fin et la date de début.</p> <p>La durée doit être arrondie au mois. La limite supérieure d'une catégorie est incluse dans la catégorie (c'est-à-dire que la catégorie 0-3 M comprend 0, 1, 2 et 3M et la catégorie 3-6M n'inclut pas 3M.).</p>
<b>Semaine</b>	Une semaine se définit comme ayant une heure d'exécution se situant dans la période du samedi 0 h 0 min 0 s UTC au vendredi 23 h 59 min 59 s UTC. Les opérations exécutées pendant cette période, mais qui sont déclarées dans les deux jours suivants la fin de la semaine doivent être incluses dans le rapport hebdomadaire. Les opérations exécutées pendant la période susmentionnée, mais qui sont déclarées après les deux jours suivants a fin de la semaine ne doivent pas être incluses dans le rapport hebdomadaire.
<b>Critère d'évaluation de la convivialité des données publiques</b>	<p>Les données pourraient être téléchargées.</p> <p>Les données sont dans un format convivial (par exemple csv) plutôt qu'en pdf.</p> <p>Les données des périodes de la section 2 des parties 1 et 2 peuvent être consultées sans qu'il soit nécessaire de s'inscrire, de faire une demande ou de remplir une autre condition.</p>
<b>Identité de la contrepartie</b>	Le référentiel central reconnu ne doit pas divulguer l'identité des contreparties à l'opération.