

chapitre I-14.01, r. 0.01

**RÈGLEMENT 94-101 SUR LA COMPENSATION OBLIGATOIRE DES DÉRIVÉS PAR
CONTREPARTIE CENTRALE**

Loi sur les instruments dérivés
(chapitre I-14.01, a. 175, 1^{er} al., par. 2°, 3°, 9°, 11°, 12°, 26°, 27° et 29°)

CHAPITRE 1
DÉFINITIONS ET INTERPRÉTATION

1. Définitions et interprétation

1) Dans le présent règlement, on entend par:

«chambre de compensation réglementée»: l'une des personnes suivantes:

a) en Alberta, à l'Île-du-Prince-Édouard, au Nouveau-Brunswick, en Nouvelle-Écosse, au Nunavut, en Saskatchewan, à Terre-Neuve-et-Labrador, dans les Territoires du Nord-Ouest et au Yukon, la personne reconnue ou dispensée de la reconnaissance à titre de chambre de compensation, d'agence de compensation ou d'agence de compensation et de dépôt en vertu de la législation en valeurs mobilières de tout territoire du Canada;

b) en Colombie-Britannique, au Manitoba et en Ontario, une personne reconnue ou dispensée de la reconnaissance à titre de chambre de compensation ou d'agence de compensation dans le territoire intéressé;

c) au Québec, une personne reconnue ou dispensée de la reconnaissance à titre de chambre de compensation;

«contrepartie locale»: une contrepartie à un dérivé qui, au moment de l'exécution de l'opération, répond à l'une des descriptions suivantes:

a) une personne, à l'exception d'une personne physique, qui remplit au moins l'une des conditions suivantes:

i) elle est constituée en vertu des lois du territoire intéressé;

ii) son siège est situé dans le territoire intéressé;

iii) son établissement principal est situé dans le territoire intéressé;

RÈGLEMENT EN VIGUEUR DU 20 AVRIL 2022 AU 31 AOÛT 2022

b) elle est une entité du même groupe qu'une personne visée au paragraphe a, cette personne étant responsable de la totalité ou de la quasi-totalité des passifs de cette partie;

NON EN VIGUEUR – Entrera en vigueur le 1^{er} septembre 2022

A.M. 2002-07, a. 1 – Modification par. b de la définition « contrepartie locale »

b) elle est une entité du même groupe qu'une personne visée au paragraphe a, cette personne étant responsable de la totalité ou de la quasi-totalité des passifs de ~~cette partie~~cette contrepartie;

«dérivé obligatoirement compensable»: un dérivé au sein d'une catégorie de dérivés énumérée à l'Annexe A;

NON EN VIGUEUR – Entrera en vigueur le 1^{er} septembre 2022

A.M. 2002-07, a. 1 – Ajout

«entité soumise à la réglementation prudentielle»: une personne qui est assujettie aux lois du Canada, d'un territoire du Canada ou d'un territoire étranger où le siège ou l'établissement principal d'une banque étrangère autorisée figurant à l'annexe III de la Loi sur les banques (L.C. 1991, c. 46) est situé, et de toute subdivision politique de ce territoire étranger, ou aux lignes directrices d'une autorité de réglementation du Canada ou d'un territoire du Canada en matière d'exigences minimales de fonds propres, de solidité financière et de gestion des risques;

«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);

«opération»: l'une des opérations suivantes:

a) la conclusion, une modification importante, la cession, la vente ou toute autre forme d'acquisition ou d'aliénation d'un dérivé;

b) la novation d'un dérivé, sauf la novation par l'intermédiaire d'une chambre de compensation;

«participant»: une personne qui a conclu une entente avec une chambre de compensation réglementée afin d'avoir accès à ses services et qui est liée par ses règles et procédures.

NON EN VIGUEUR – Entrera en vigueur le 1^{er} septembre 2022

A.M. 2002-07, a. 1 – Ajout

«période de référence»: la période allant du 1^{er} septembre d'une année donnée au 31 août de l'année suivante;

RÈGLEMENT EN VIGUEUR DU 20 AVRIL 2022 AU 31 AOÛT 2022

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

NON EN VIGUEUR – Entrera en vigueur le 1^{er} septembre 2022 A.M. 2002-07, a. 1 – Remplacement par. 2

2) Dans le présent règlement, une personne est considérée comme une entité du même groupe qu'une autre personne dans les cas suivants:

a) ses états financiers et ceux de l'autre personne sont consolidés dans des états financiers consolidés établis conformément à l'un des référentiels comptables suivants:

i) les IFRS;

ii) les principes comptables généralement reconnus des États-Unis d'Amérique;

b) les conditions suivantes sont réunies:

i) si ses états financiers et ceux d'une autre personne avaient été établis par elle, l'autre personne ou une tierce personne conformément aux normes ou aux principes visés au sous-paragraphe i ou ii du paragraphe a, ils auraient été, au moment pertinent, obligatoirement établis de façon consolidée;

ii) ni elle, ni l'autre personne, ni aucune tierce personne n'a établi ses états financiers conformément aux normes ou aux principes visés au sous-paragraphe i ou ii du paragraphe a;

c) sauf en Colombie-Britannique et au Québec, les deux personnes sont des entités soumises à la réglementation prudentielle et leurs états financiers sont consolidés à cette fin.

3) 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) dans le cas d'une société en commandite, elle en est le commandité;

d) dans le cas d'une fiducie, elle en est le fiduciaire.

RÈGLEMENT EN VIGUEUR DU 20 AVRIL 2022 AU 31 AOÛT 2022

NON EN VIGUEUR – Entrera en vigueur le 1^{er} septembre 2022

A.M. 2002-07, a. 1 – Abrogation par. 3

~~3) (paragraphe abrogé). 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) dans le cas d'une société en commandite, elle en est le commandité;~~

~~d) dans le cas d'une fiducie, elle en est le fiduciaire.~~

4) Dans le présent règlement, en Alberta, en Colombie-Britannique, à l'Île-du-Prince-Édouard, au Nouveau-Brunswick, en Nouvelle-Écosse, au Nunavut, en Saskatchewan, à Terre-Neuve-et-Labrador, dans les Territoires du Nord-Ouest et au Yukon, on entend par dérivé un dérivé désigné au sens de la Norme multilatérale 91-101 sur la détermination des dérivés.

A.M. 2017-01, a. 1.

Champ d'application

2. Le présent règlement s'applique à ce qui suit:

a) au Manitoba:

i) un dérivé autre qu'un contrat ou un instrument qui, à toute fin, est considéré comme n'étant pas un dérivé en vertu de l'article 2, 4 ou 5 de la Rule 91-506 Derivatives: Product Determination de la Commission des valeurs mobilières du Manitoba;

ii) un dérivé qui est par ailleurs une valeur mobilière et qui, à toute fin, est considéré comme n'étant pas une security en vertu de l'article 3 de la Rule 91-506 Derivatives: Product Determination de la Commission des valeurs mobilières du Manitoba;

b) en Ontario:

i) un dérivé autre qu'un contrat ou un instrument qui, à toute fin, est considéré comme n'étant pas un dérivé en vertu de l'article 2, 4 ou 5 de la Rule 91-506 Derivatives: Product Determination de la Commission des valeurs mobilières de l'Ontario;

RÈGLEMENT EN VIGUEUR DU 20 AVRIL 2022 AU 31 AOÛT 2022

ii) un dérivé qui est par ailleurs une valeur mobilière et qui, à toute fin, est considéré comme n'étant pas une security en vertu de l'article 3 de la Rule 91-506 Derivatives: Product Determination de la Commission des valeurs mobilières de l'Ontario;

c) au Québec, un dérivé visé à l'article 1.2 du Règlement 91-506 sur la détermination des dérivés (chapitre I-14.01, r. 0.1), à l'exception d'un contrat ou d'un instrument visé à l'article 2 de ce règlement.

A.M. 2017-01, a. 2.

CHAPITRE 2

OBLIGATION DE COMPENSATION PAR CONTREPARTIE CENTRALE

Obligation de soumettre les opérations pour compensation

NON EN VIGUEUR – Entrera en vigueur le 1^{er} septembre 2022

A.M. 2002-07, a. 2 – Ajout

3. 0.1) Malgré le paragraphe 2 de l'article 1, un fonds d'investissement n'est pas une entité du même groupe qu'une autre personne pour l'application des sous-paragraphes b et c du paragraphe 1.

0.2) Malgré le paragraphe 2 de l'article 1, une personne n'est pas une entité du même groupe qu'une autre personne pour l'application des sous-paragraphes b et c du paragraphe 1 si les conditions suivantes s'appliquent:

- a) son objectif principal est l'un des suivants:
- i) financer un ou plusieurs portefeuilles d'actifs;
 - ii) procurer aux investisseurs une exposition à un ensemble particulier de risques;
 - iii) acquérir des actifs immobiliers ou physiques, ou y investir;

b) si son objectif principal est celui visé au sous-paragraphe i ou ii du paragraphe a, tous ses emprunts, y compris ses obligations envers sa contrepartie à un dérivé, sont garantis uniquement par ses actifs.

3. 1) La contrepartie locale à une opération sur un dérivé obligatoirement compensable le soumet ou le fait soumettre pour compensation à une chambre de compensation réglementée qui offre des services de compensation pour ce dérivé si au moins l'une des situations suivantes s'applique à chaque contrepartie:

- a) elle remplit les conditions suivantes:
- i) elle est un participant à une chambre de compensation réglementée qui offre des services de compensation pour le dérivé obligatoirement compensable;

RÈGLEMENT EN VIGUEUR DU 20 AVRIL 2022 AU 31 AOÛT 2022

ii) elle est abonnée aux services de compensation pour la catégorie de dérivés à laquelle le dérivé obligatoirement compensable appartient;

b) elle remplit les conditions suivantes:

i) elle est une entité du même groupe que le participant visé au paragraphe a;

ii) à un moment quelconque après la date d'entrée en vigueur du présent règlement, le montant notionnel brut de l'ensemble de ses dérivés en cours à la fin du mois excède 1 000 000 000 \$, compte non tenu des dérivés auxquels le sous-paragraphe a du paragraphe 1 de l'article 7 s'applique;

c) elle remplit les conditions suivantes:

i) elle est une contrepartie locale dans un territoire du Canada, autre qu'une contrepartie à laquelle le sous-paragraphe b s'applique;

ii) à un moment quelconque après la date d'entrée en vigueur du présent règlement, le montant notionnel brut de l'ensemble de ses dérivés en cours à la fin du mois, combiné à celui de chaque entité du même groupe qui est une contrepartie locale dans un territoire du Canada, excède 500 000 000 000 \$, compte non tenu des dérivés auxquels le sous-paragraphe a du paragraphe 1 de l'article 7 s'applique.

NON EN VIGUEUR – Entrera en vigueur le 1^{er} septembre 2022

A.M. 2002-07, a. 2 – Modification par. 1

1) La contrepartie locale à une opération sur un dérivé obligatoirement compensable le soumet ou le fait soumettre pour compensation à une chambre de compensation réglementée qui offre des services de compensation pour ce dérivé si au moins l'une des situations suivantes s'applique à chaque contrepartie:

a) elle remplit les conditions suivantes:

i) elle est un participant à une chambre de compensation réglementée qui offre des services de compensation pour le dérivé obligatoirement compensable;

ii) elle est abonnée aux services de compensation pour la catégorie de dérivés à laquelle le dérivé obligatoirement compensable appartient;

b) elle remplit les conditions suivantes:

i) elle est une entité du même groupe que le participant visé au paragraphe a;

ii) durant les mois de mars, d'avril et de mai précédant la période de référence dans laquelle l'opération a été exécutée, le montant notionnel brut moyen de l'ensemble de ses dérivés en cours à la fin du mois excède 1 000 000 000 \$, compte non

RÈGLEMENT EN VIGUEUR DU 20 AVRIL 2022 AU 31 AOÛT 2022

~~tenu des dérivés visés au sous-paragraphe a du paragraphe 1 de l'article 7;ii) à un moment quelconque après la date d'entrée en vigueur du présent règlement, le montant notionnel brut de l'ensemble de ses dérivés en cours à la fin du mois excède 1 000 000 000 \$, compte non tenu des dérivés auxquels le sous-paragraphe a du paragraphe 1 de l'article 7 s'applique;~~

c) elle remplit les conditions suivantes:

i) elle est une contrepartie locale dans un territoire du Canada;

ii) durant la période antérieure de 12 mois, le montant notionnel brut de l'ensemble de ses dérivés en cours à la fin du mois, combiné à celui de chaque entité du même groupe qui est une contrepartie locale dans un territoire du Canada, excède 500 000 000 000 \$, compte non tenu des dérivés visés au sous-paragraphe a du paragraphe 1 de l'article 7;

iii) durant les mois de mars, d'avril et de mai précédant la période de référence dans laquelle l'opération a été exécutée, le montant notionnel brut moyen de l'ensemble de ses dérivés en cours à la fin du mois excède 1 000 000 000 \$, compte non tenu des dérivés visés au sous-paragraphe a du paragraphe 1 de l'article 7.elle remplit les conditions suivantes:

i) elle est une contrepartie locale dans un territoire du Canada, autre qu'une contrepartie à laquelle le sous-paragraphe b s'applique;

ii) à un moment quelconque après la date d'entrée en vigueur du présent règlement, le montant notionnel brut de l'ensemble de ses dérivés en cours à la fin du mois, combiné à celui de chaque entité du même groupe qui est une contrepartie locale dans un territoire du Canada, excède 500 000 000 000 \$, compte non tenu des dérivés auxquels le sous-paragraphe a du paragraphe 1 de l'article 7 s'applique.

2) Sauf si le sous-paragraphe a du paragraphe 1 s'applique, la contrepartie locale visée au sous-paragraphe b ou c de ce paragraphe n'est pas tenue de soumettre pour compensation un dérivé obligatoirement compensable à une chambre de compensation réglementée si l'opération sur le dérivé a été exécutée avant le 90^e jour suivant la fin du mois au cours duquel le montant notionnel brut à la fin du mois a excédé la première fois le montant visé à la disposition ii du sous-paragraphe b ou c du paragraphe 1, selon le cas.

NON EN VIGUEUR – Entrera en vigueur le 1^{er} septembre 2022

A.M. 2002-07, a. 2 – Modification par. 2

2) Sauf si le sous-paragraphe a du paragraphe 1 s'applique, la contrepartie locale visée au sous-paragraphe ~~b~~ ou c de ce paragraphe n'est pas tenue de soumettre pour compensation un dérivé obligatoirement compensable à une chambre de compensation réglementée si l'opération sur le dérivé a été exécutée avant le 90^e jour suivant la fin du mois au cours duquel le montant notionnel brut à la fin du mois a excédé la première fois

RÈGLEMENT EN VIGUEUR DU 20 AVRIL 2022 AU 31 AOÛT 2022

le montant visé au à la disposition ii du sous-paragraphe b ou c du paragraphe 1, selon le cas.

3) Sauf si le paragraphe 2 s'applique, la contrepartie locale visée au paragraphe 1 soumet pour compensation un dérivé obligatoirement compensable au plus tard dans les délais suivants:

a) à la fin du jour de son exécution, si l'opération est exécutée durant les heures d'ouverture de la chambre de compensation réglementée;

b) à la fin du jour ouvrable suivant, si l'opération est exécutée après la fermeture des bureaux de la chambre de compensation réglementée.

4) La contrepartie locale visée au paragraphe 1 soumet pour compensation le dérivé obligatoirement compensable conformément aux règles de la chambre de compensation réglementée et à leurs modifications.

5) La contrepartie locale qui répond uniquement au paragraphe b de la définition de l'expression « contrepartie locale » prévue à l'article 1 est dispensée de l'application du présent article si elle soumet pour compensation le dérivé obligatoirement compensable conformément aux lois d'un territoire étranger énumérées à l'Annexe B auxquelles elle est assujettie.

A.M. 2017-01, a. 3.

Avis de refus

4. La chambre de compensation réglementée qui refuse un dérivé obligatoirement compensable soumis pour compensation en avise immédiatement chaque contrepartie locale.

A.M. 2017-01, a. 4.

Publication des dérivés compensables et des dérivés obligatoirement compensables

5. La chambre de compensation réglementée prend toutes les mesures suivantes:

a) elle publie une liste des dérivés ou catégories de dérivés pour lesquels elle offre des services de compensation et indique, dans chaque cas, s'il s'agit ou non de dérivés obligatoirement compensables;

b) elle met la liste à la disposition du public, sans frais, sur son site Web.

A.M. 2017-01, a. 5.

**CHAPITRE 3
DISPENSES DE LA COMPENSATION OBLIGATOIRE PAR CONTREPARTIE
CENTRALE**

Non-application

6. Le présent règlement ne s'applique pas aux contreparties suivantes:

**NON EN VIGUEUR – Entrera en vigueur le 1^{er} septembre 2022
A.M. 2002-07, a. 3 – Modification par. 6**

6. Le présent règlement ne s'applique pas à la contrepartie à l'égard d'un dérivé obligatoirement compensable lorsque l'une des contreparties à ce dérivé est l'une des suivantes aux contreparties suivantes:

a) le gouvernement du Canada, le gouvernement d'un territoire du Canada ou le gouvernement d'un territoire étranger;

b) une société d'État dont la totalité ou la quasi-totalité des passifs est la responsabilité du gouvernement de son territoire de constitution;

c) une personne qui est la propriété exclusive d'un ou de plusieurs gouvernements visés au paragraphe a et dont la totalité ou la quasi-totalité des passifs est la responsabilité de celui-ci ou de ceux-ci;

d) la Banque du Canada ou la banque centrale d'un territoire étranger;

e) la Banque des règlements internationaux;

f) le Fonds monétaire international.

A.M. 2017-01, a. 6.

Dispense pour opération intragroupe

7. 1) La contrepartie locale est dispensée de l'application de l'article 3 à l'égard d'un dérivé obligatoirement compensable si les conditions suivantes sont réunies:

a) ce dérivé est conclu entre une contrepartie et une entité du même groupe, si leurs états financiers sont consolidés dans les mêmes états financiers consolidés audités établis 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) les contreparties à ce dérivé conviennent de se prévaloir de la présente dispense;

c) ce dérivé est encadré par un programme centralisé de gestion du risque raisonnablement conçu pour surveiller et gérer les risques associés au dérivé qui

RÈGLEMENT EN VIGUEUR DU 20 AVRIL 2022 AU 31 AOÛT 2022

surviennent entre les contreparties au moyen de procédures d'évaluation, de mesure et de contrôle;

d) *une entente écrite prévoyant les modalités de ce dérivé lie les contreparties.*

2) *La contrepartie locale qui se prévaut la première fois du paragraphe 1 à l'égard du dérivé obligatoirement compensable conclu avec une contrepartie transmet par voie électronique à l'agent responsable, sauf au Québec, ou à l'autorité en valeurs mobilières le formulaire prévu à l'Annexe 94-101A1 dans un délai de 30 jours.*

3) *La contrepartie locale transmet ou fait transmettre par voie électronique à l'agent responsable, sauf au Québec, ou à l'autorité en valeurs mobilières une version modifiée du formulaire prévu à l'Annexe 94-101A1 dans un délai de 10 jours à compter du moment où elle a eu connaissance que les renseignements figurant dans un tel formulaire déjà transmis ne sont plus exacts.*

NON EN VIGUEUR – Entrera en vigueur le 1^{er} septembre 2022

A.M. 2002-07, a. 4 – Modification par. 7

7. 1) *La contrepartie locale est dispensée de l'application de l'article 3 à l'égard d'un dérivé obligatoirement compensable si les conditions suivantes sont réunies:*

a) *ce dérivé est conclu entre une contrepartie et une entité du même groupe, si leurs états financiers sont consolidés dans les mêmes états financiers consolidés audités établis 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) *(paragraphe abrogé) les contreparties à ce dérivé conviennent de se prévaloir de la présente dispense;*

c) *ce dérivé est encadré par un programme centralisé de gestion du risque raisonnablement conçu pour surveiller et gérer les risques associés au dérivé qui surviennent entre les contreparties au moyen de procédures d'évaluation, de mesure et de contrôle;*

d) *une entente écrite prévoyant les modalités de ce dérivé lie les contreparties.*

2) *(paragraphe abrogé) La contrepartie locale qui se prévaut la première fois du paragraphe 1 à l'égard du dérivé obligatoirement compensable conclu avec une contrepartie transmet par voie électronique à l'agent responsable, sauf au Québec, ou à l'autorité en valeurs mobilières le formulaire prévu à l'Annexe 94-101A1 dans un délai de 30 jours.*

3) *(paragraphe abrogé) La contrepartie locale transmet ou fait transmettre par voie électronique à l'agent responsable, sauf au Québec, ou à l'autorité en valeurs mobilières une version modifiée du formulaire prévu à l'Annexe 94-101A1 dans un délai de 10 jours*

RÈGLEMENT EN VIGUEUR DU 20 AVRIL 2022 AU 31 AOÛT 2022

~~à compter du moment où elle a eu connaissance que les renseignements figurant dans un tel formulaire déjà transmis ne sont plus exacts.~~

A.M. 2017-01, a. 7.

Dispense pour compression multilatérale de portefeuille

8. La contrepartie locale est dispensée de l'application de l'article 3 à l'égard d'un dérivé obligatoirement compensable résultant d'un exercice multilatéral de compression de portefeuille si les conditions suivantes sont réunies:

a) ce dérivé est conclu par suite de la modification ou de la fin et du remplacement de dérivés existants par plus de 2 contreparties;

b) les dérivés existants n'incluent pas de dérivé obligatoirement compensable conclu après la date à laquelle la catégorie de dérivés est devenue obligatoirement compensable;

c) les dérivés existants n'ont pas été compensés par une chambre de compensation;

d) ce dérivé est conclu par les mêmes contreparties qu'aux dérivés existants;

e) l'exercice multilatéral de compression de portefeuille est effectué par un tiers indépendant.

NON EN VIGUEUR – Entrera en vigueur le 1^{er} septembre 2022

A.M. 2002-07, a. 5 – Modification par. d et e

~~d) l'exercice multilatéral de compression de portefeuille faisait intervenir les deux contreparties à ce dérivé; ce dérivé est conclu par les mêmes contreparties qu'aux dérivés existants;~~

~~e) l'exercice multilatéral de compression de portefeuille a été effectué par un tiers indépendant.~~

A.M. 2017-01, a. 8.

Conservation des dossiers

9. 1) La contrepartie locale à un dérivé obligatoirement compensable qui s'est prévalu de la dispense prévue à l'article 7 ou 8 à l'égard de celui-ci conserve des dossiers qui prouvent la conformité aux conditions prévues dans ces articles.

2) Les dossiers visés au paragraphe 1 sont conservés en lieu sûr et sous une forme durable pendant la période suivante:

a) sauf au Manitoba, 7 ans suivant la date d'expiration ou de fin du dérivé obligatoirement compensable;

RÈGLEMENT EN VIGUEUR DU 20 AVRIL 2022 AU 31 AOÛT 2022

b) au Manitoba, 8 ans suivant la date d'expiration ou de fin du dérivé obligatoirement compensable.

A.M. 2017-01, a. 9.

CHAPITRE 4 DÉRIVÉS OBLIGATOIREMENT COMPENSABLES

Soumission de renseignements sur les services de compensation de dérivés fournis par la chambre de compensation réglementée

10. Dans un délai de 10 jours suivant la première offre de services de compensation d'un dérivé ou d'une catégorie de dérivés, la chambre de compensation réglementée transmet par voie électronique à l'agent responsable, sauf au Québec, ou à l'autorité en valeurs mobilières le formulaire prévu à l'Annexe 94-101A2 indiquant le dérivé ou la catégorie de dérivés.

A.M. 2017-01, a. 10.

NON EN VIGUEUR – Entrera en vigueur le 1^{er} septembre 2022
A.M. 2002-07, a. 6 – Abrogation Chapitre 4 et article 10

~~CHAPITRE 4 (Abrogé) DÉRIVÉS OBLIGATOIREMENT COMPENSABLES~~

~~Soumission de renseignements sur les services de compensation de dérivés fournis par la chambre de compensation réglementée~~

10. ~~(Abrogé) Dans un délai de 10 jours suivant la première offre de services de compensation d'un dérivé ou d'une catégorie de dérivés, la chambre de compensation réglementée transmet par voie électronique à l'agent responsable, sauf au Québec, ou à l'autorité en valeurs mobilières le formulaire prévu à l'Annexe 94-101A2 indiquant le dérivé ou la catégorie de dérivés.~~

CHAPITRE 5 DISPENSE

Dispense

11. 1) L'agent responsable, sauf au Québec, ou l'autorité en valeurs mobilières peut accorder une dispense de l'application de tout ou partie du présent règlement, sous réserve des conditions ou restrictions auxquelles la dispense peut être subordonnée.

2) Malgré le paragraphe 1, en Ontario, seul l'agent responsable peut accorder une telle dispense.

RÈGLEMENT EN VIGUEUR DU 20 AVRIL 2022 AU 31 AOÛT 2022

3) *Sauf en Alberta et en Ontario, la dispense prévue au paragraphe 1 est accordée conformément à la loi visée à l'Annexe B du Règlement 14-101 sur les définitions (chapitre V-1.1, r. 3), vis-à-vis du nom du territoire intéressé.*

A.M. 2017-01, a. 11.

CHAPITRE 6 DISPOSITIONS TRANSITOIRES ET DATE D'ENTRÉE EN VIGUEUR

Dispositions transitoires – obligation de dépôt de la chambre de compensation réglementée

12. *Au plus tard le 4 mai 2017, la chambre de compensation réglementée transmet par voie électronique à l'agent responsable, sauf au Québec, ou à l'autorité en valeurs mobilières le formulaire prévu à l'Annexe 94-101A2 indiquant tous les dérivés ou toutes les catégories de dérivés pour lesquels elle offrait des services de compensation le 4 avril 2017.*

A.M. 2017-01, a. 12.

Dispositions transitoires – soumission pour compensation par certaines contreparties

13. *La contrepartie visée au sous-paragraphe b ou c du paragraphe 1 de l'article 3 à laquelle le sous-paragraphe a de ce paragraphe ne s'applique pas n'est pas tenue de soumettre pour compensation un dérivé obligatoirement compensable à une chambre de compensation réglementée avant le 4 octobre 2017.*

A.M. 2017-01, a. 13.

Date d'entrée en vigueur

14. *(Omis)*

A.M. 2017-01, a. 14.

RÈGLEMENT EN VIGUEUR DU 20 AVRIL 2022 AU 31 AOÛT 2022

ANNEXE A DÉRIVÉS OBLIGATOIREMENT COMPENSABLES

(paragraphe 1 de l'article 1)

Swaps de taux d'intérêt

Type	Taux variable de référence	Monnaie de règlement	Échéance	Type de monnaie de règlement	Optionalité	Type de notionnel
Fixe-variable	CDOR	CAD	28 jours à 30 ans	Mono-monnaie	Non	Constant ou variable
Fixe-variable	LIBOR	USD	28 jours à 50 ans	Mono-monnaie	Non	Constant ou variable
Fixe-variable	EURIBOR	EUR	28 jours à 50 ans	Mono-monnaie	Non	Constant ou variable
Fixe-variable	LIBOR	GBP	28 jours à 50 ans	Mono-monnaie	Non	Constant ou variable
Variable-variable	LIBOR	USD	28 jours à 50 ans	Mono-monnaie	Non	Constant ou variable
Variable-variable	EURIBOR	EUR	28 jours à 50 ans	Mono-monnaie	Non	Constant ou variable
Variable-variable	LIBOR	GBP	28 jours à 50 ans	Mono-monnaie	Non	Constant ou variable
Swap indexé sur le taux à un jour	CORRA	CAD	7 jours à 2 ans	Mono-monnaie	Non	Constant
Swap indexé sur le taux à un jour	FedFunds	USD	7 jours à 3 ans	Mono-monnaie	Non	Constant
Swap indexé sur le taux à un jour	EONIA	EUR	7 jours à 3 ans	Mono-monnaie	Non	Constant
Swap indexé sur le taux à un jour	SONIA	GBP	7 jours à 3 ans	Mono-monnaie	Non	Constant

RÈGLEMENT EN VIGUEUR DU 20 AVRIL 2022 AU 31 AOÛT 2022

Contrats de garantie de taux

Type	Taux variable de référence	Monnaie de règlement	Échéance	Type de monnaie de règlement	Optionalité	Type de notionnel
Contrat de garantie de taux	LIBOR	USD	3 jours à 3 ans	Mono-monnaie	Non	Constant
Contrat de garantie de taux	EURIBOR	EUR	3 jours à 3 ans	Mono-monnaie	Non	Constant
Contrat de garantie de taux	LIBOR	GBP	3 jours à 3 ans	Mono-monnaie	Non	Constant

A.M. 2017-01, Ann. A; A.M. 2022-07, a. 7.

ANNEXE B
LOIS OU RÈGLEMENTS DE TERRITOIRES ÉTRANGERS APPLICABLES
RELATIVEMENT À LA CONFORMITÉ DE SUBSTITUTION

(paragraphe 5 de l'article 3)

Territoire étranger	Lois ou règlements
<i>Union européenne</i>	<i>Règlement (UE) No 648/2012 du Parlement européen et du Conseil du 4 juillet 2012 sur les produits dérivés de gré à gré, les contreparties centrales et les référentiels, modifié par le Règlement (UE) 2019/2099</i>
<i>Royaume-Uni</i>	<p><i>Financial Services and Markets Act 2000 (Over the Counter Derivatives, Central Counterparties and Trade Repositories) Regulations 2013</i></p> <p><i>The Over the Counter Derivatives, Central Counterparties and Trade Repositories (Amendment, etc., and Transitional Provision) (EU Exit) Regulations 2020</i></p> <p><i>The Over the Counter Derivatives, Central Counterparties and Trade Repositories (Amendment etc., and Transitional Provision) (EU Exit) (No 2) Regulations 2019</i></p> <p><i>The Over the Counter Derivatives, Central Counterparties and Trade Repositories (Amendment, etc., and Transitional Provision) (EU Exit) Regulations 2019</i></p> <p><i>The Central Counterparties (Amendment, etc., and Transitional Provision) (EU Exit) Regulations 2018</i></p> <p><i>The Technical Standards (European Market Infrastructure Regulation) (EU Exit) (No 2) Instrument 2019</i></p> <p><i>The Technical Standards (European Market Infrastructure Regulation) (EU Exit) (No 3) Instrument 2019</i></p>
<i>États-Unis d'Amérique</i>	<i>Clearing Requirement and Related Rules, 17 CFR Part 50</i>

A.M. 2017-01, Ann. B; A.M. 2022-07, a. 7.

RÈGLEMENT EN VIGUEUR DU 20 AVRIL 2022 AU 31 AOÛT 2022

ANNEXE 94-101A1 DISPENSE POUR OPÉRATION INTRAGROUPE

Type de dépôt: INITIAL MODIFICATION

Rubrique 1 – Renseignements sur l'entité qui transmet le présent formulaire

1. Fournir les renseignements suivants sur l'entité qui transmet le présent formulaire:

Nom complet:

Nom sous lequel les activités sont exercées, s'il est différent:

Siège:

Adresse:

Adresse postale (si elle est différente):

Téléphone:

Site Web:

Personne-ressource:

Nom et titre:

Téléphone:

Courriel:

Autres bureaux:

Adresse:

Téléphone:

Courriel:

Avocat canadien (s'il y a lieu):

Cabinet:

Personne-ressource:

Téléphone:

Courriel:

RÈGLEMENT EN VIGUEUR DU 20 AVRIL 2022 AU 31 AOÛT 2022

2. En plus de fournir les renseignements demandés au paragraphe 1, si le présent formulaire est transmis pour déclarer un changement de nom pour le compte de l'entité visée au paragraphe 1, fournir les renseignements suivants:

Ancien nom complet:

Ancien nom sous lequel les activités étaient exercées:

Rubrique 2 – Avis conjoint au nom de membres du même groupe que l'entité qui transmet le présent formulaire

1. Pour les dérivés obligatoirement compensables auxquels le présent formulaire se rapporte, fournir tous les renseignements suivants dans le tableau ci-après:

a) l'identifiant d'entité juridique de chaque contrepartie de la façon requise dans les règlements suivants:

i) en Alberta, en Colombie-Britannique, à l'Île-du-Prince-Édouard, en Nouvelle-Écosse, au Nunavut, en Saskatchewan, à Terre-Neuve-et-Labrador, dans les Territoires du Nord-Ouest et au Yukon, le Multilateral Instrument 96-101 Trade Repositories and Derivatives Data Reporting et, au Nouveau-Brunswick, la Norme multilatérale 96-101 sur les répertoires des opérations et la déclaration de données sur les dérivés;

ii) au Manitoba, la Rule 91-507 Trade Repositories and Derivatives Data Reporting de la Commission des valeurs mobilières du Manitoba;

iii) en Ontario, la Rule 91-507 Trade Repositories and Derivatives Data Reporting de la Commission des valeurs mobilières de l'Ontario;

iv) au Québec, le Règlement 91-507 sur les référentiels centraux et la déclaration de données sur les dérivés (chapitre I-14.01, r. 1.1);

b) les territoires du Canada dans lesquels chaque contrepartie est une contrepartie locale.

Combinaisons	LEI de la contrepartie 1	Territoire(s) du Canada où la contrepartie 1 est une contrepartie locale	LEI de la contrepartie 2	Territoire(s) du Canada où la contrepartie 2 est une contrepartie locale
1				

RÈGLEMENT EN VIGUEUR DU 20 AVRIL 2022 AU 31 AOÛT 2022

2. Décrire la structure de propriété et de contrôle des contreparties indiquées au paragraphe 1.

Rubrique 3 – Attestation

J'atteste que je suis dûment autorisé à transmettre le présent formulaire au nom de l'entité qui le transmet et des contreparties indiquées à la rubrique 2 du présent formulaire et confirme que les renseignements figurant dans le présent formulaire sont exacts.

FAIT À _____ le _____ 20____

(Nom de la personne autorisée en lettres moulées)

(Titre de la personne autorisée en lettres moulées)

(Signature de la personne autorisée)

(Courriel)

(Numéro de téléphone)

**NON EN VIGUEUR – Entrera en vigueur le 1^{er} septembre 2022
A.M. 2002-07, a. 8 – Abrogation Annexe 94-101A1**

**ANNEXE 94-101A1
(Abrogée) DISPENSE POUR OPÉRATION INTRAGROUPE**

A.M. 2017-01, Ann. 94-101A1

**ANNEXE 94-101A2
SERVICES DE COMPENSATION DE DÉRIVÉS**

Type de dépôt: **INITIAL** **MODIFICATION**

Rubrique 1 – Renseignements sur la chambre de compensation réglementée

1. *Nom complet de la chambre de compensation réglementée:*
2. *Coordonnées de la personne autorisée à transmettre le présent formulaire:*

Nom et titre:

Téléphone:

Courriel:

Rubrique 2 – Description des dérivés

1. *Indiquer chaque dérivé ou catégorie de dérivés pour lesquels la chambre de compensation réglementée offre des services de compensation et pour lesquels le formulaire prévu à l'Annexe 94-101A2 n'a pas encore été transmis.*

2. *Décrire les principales caractéristiques de chaque dérivé ou catégorie de dérivés indiqué au paragraphe 1, notamment:*

a) *les pratiques courantes de gestion des événements du cycle de vie qui y sont associées, au sens des règlements suivants:*

i) *en Alberta, en Colombie-Britannique, à l'Île-du-Prince-Édouard, en Nouvelle-Écosse, au Nunavut, en Saskatchewan, à Terre-Neuve-et-Labrador, dans les Territoires du Nord-Ouest et au Yukon, le Multilateral Instrument 96-101 Trade Repositories and Derivatives Data Reporting et, au Nouveau-Brunswick, la Norme multilatérale 96-101 sur les répertoires des opérations et la déclaration de données sur les dérivés;*

ii) *au Manitoba, la Rule 91-507 Trade Repositories and Derivatives Data Reporting de la Commission des valeurs mobilières du Manitoba;*

iii) *en Ontario, la Rule 91-507 Trade Repositories and Derivatives Data Reporting de la Commission des valeurs mobilières de l'Ontario;*

iv) *au Québec, le Règlement 91-507 sur les référentiels centraux et la déclaration de données sur les dérivés (chapitre I-14.01, r. 1.1);*

b) *les possibilités de confirmation de l'opération par voie électronique;*

RÈGLEMENT EN VIGUEUR DU 20 AVRIL 2022 AU 31 AOÛT 2022

c) le degré de normalisation des clauses contractuelles et des processus opérationnels;

d) le marché et ses participants;

e) la disponibilité du prix et la liquidité du dérivé ou de la catégorie de dérivés au Canada et à l'étranger.

3. Décrire l'incidence de la fourniture de services de compensation pour chaque dérivé ou catégorie de dérivés indiqué au paragraphe 1 sur le cadre de gestion des risques et les ressources financières de la chambre de compensation réglementée, y compris la protection de cette dernière en cas de défaillance d'un participant et ses conséquences sur les autres participants.

4. Décrire l'incidence, le cas échéant, sur la capacité de la chambre de compensation réglementée à remplir ses obligations réglementaires qu'il y aurait à ce que l'agent responsable, sauf au Québec, ou l'autorité en valeurs mobilières détermine que le dérivé ou la catégorie de dérivés indiqué au paragraphe 1 est obligatoirement compensable.

5. Décrire les services de compensation offerts pour chaque dérivé ou catégorie de dérivés indiqué au paragraphe 1.

6. Le cas échéant, joindre un exemplaire de chaque avis que la chambre de compensation réglementée a transmis à ses participants aux fins de consultation sur le lancement du service de compensation du dérivé ou de la catégorie de dérivés indiqué au paragraphe 1 ainsi qu'un résumé des commentaires reçus.

Rubrique 3 – Attestation

ATTESTATION DE LA CHAMBRE DE COMPENSATION RÉGLEMENTÉE

J'atteste que je suis dûment autorisé à transmettre le présent formulaire au nom de la chambre de compensation réglementée nommée ci-après et confirme que les renseignements figurant dans le présent formulaire sont exacts.

FAIT À _____ le _____ 20__

(Nom de la chambre de compensation réglementée en lettres moulées)

(Nom de la personne autorisée en lettres moulées)

(Titre de la personne autorisée en lettres moulées)

(Signature de la personne autorisée)

EN VIGUEUR DU 20 AVRIL 2022 AU 31 AOÛT 2022

RÈGLEMENT EN VIGUEUR DU 20 AVRIL 2022 AU 31 AOÛT 2022

NON EN VIGUEUR – Entrera en vigueur le 1^{er} septembre 2022
A.M. 2002-07, a. 8 – Abrogation Annexe 94-101A2

ANNEXE 94-101A2
(Abrogée) SERVICES DE COMPENSATION DE DÉRIVÉS

A.M. 2017-01, Ann. 94-101A2.

Décision 2017-PDG-0031, 2017-03-15
Bulletin de l'Autorité: 2017-03-30, Vol. 14 n°12
A.M. 2017-01, 2017 G.O. 2, 913

Modifications

Décision 2022-PDG-0019, 2022-03-23
Bulletin de l'Autorité : 2022-04-21, Vol. 19 n° 15
A.M. 2022-07, 2022 G.O. 2, 2089

EN VIGUEUR DU 20 AVRIL 2022 AU 31 AOÛT 2022