

chapitre V-1.1, r. 8

RÈGLEMENT 24-101 SUR L'APPARIEMENT ET LE RÈGLEMENT DES OPÉRATIONS INSTITUTIONNELLES

Loi sur les valeurs mobilières

(chapitre V-1.1, a. 331.1 et 333)



À la suite de la publication de l'Avis 11-342 du personnel des ACVM : Avis de modifications locales dans certains territoires (Bulletin de l'Autorité du 6 août 2020, Vol. 17, n° 31), le présent règlement a été mis à jour.

PARTIE 1 DÉFINITIONS ET INTERPRÉTATION

1.1. Définitions

Dans le présent règlement, on entend par:

«chambre de compensation»: une chambre de compensation reconnue qui exerce la fonction de « système de règlement de titres » au sens de l'article 1.1 du Règlement 24-102 sur les obligations relatives aux chambres de compensation (chapitre V 1.1, r. 8.01);

«convention d'appariement»: une convention écrite intervenue entre les parties à l'appariement et fixant leurs rôles et responsabilités relativement à l'appariement des opérations exécutées avec un investisseur institutionnel ou pour son compte, notamment toute disposition en vertu de laquelle les parties à l'appariement conviennent d'établir, de conserver et d'appliquer des politiques et procédures conçues pour réaliser l'appariement dès que possible après l'exécution des opérations;

«déclaration relative à l'appariement»: une déclaration écrite signée en vertu de laquelle une partie à l'appariement confirme qu'elle a établi, conserve et applique des politiques et procédures conçues pour réaliser l'appariement dès que possible après l'exécution des opérations exécutées avec un investisseur institutionnel ou pour son compte;

«dépositaire»: la personne qui détient un titre pour le compte d'une autre personne en vertu d'une convention de garde ou de toute autre entente de garde;

«deuxième jour après l'opération»: le deuxième jour ouvrable suivant le jour de l'opération;

«fournisseur de services d'appariement»: une personne qui fournit des installations d'appariement centralisées, à l'exclusion de toute chambre de compensation;

«investisseur institutionnel»: un client d'un courtier auquel celui-ci a accordé des privilèges de négociation en mode livraison contre paiement ou réception contre paiement;

«jour de l'opération»: le jour où une opération est exécutée;

«marché»: un marché au sens du Règlement 21-101 sur le fonctionnement du marché (chapitre V-1.1, r. 5);

«opération LCP/RCP»: l'opération sur un titre qui réunit les conditions suivantes:

a) elle est exécutée dans un compte de négociation qui permet de faire le règlement en mode livraison contre paiement ou réception contre paiement au moyen des installations d'une chambre de compensation;

b) elle est réglée pour le compte du client par un dépositaire autre que le courtier qui a exécuté l'opération;

«partie à l'appariement»: relativement à une opération exécutée avec un investisseur institutionnel ou pour son compte, les personnes suivantes:

a) tout conseiller inscrit agissant pour l'investisseur institutionnel dans le traitement de l'opération;

b) si aucun conseiller inscrit n'agit pour l'investisseur institutionnel dans le traitement de l'opération, cet investisseur, à l'exception des personnes suivantes:

i) toute personne physique;

ii) toute personne qui assure l'administration ou la gestion de titres ayant une valeur totale inférieure à 10 000 000 \$;

c) tout courtier inscrit qui exécute ou compense l'opération;

d) tout dépositaire de l'investisseur institutionnel qui règle l'opération;

«premier jour après l'opération»: le jour ouvrable suivant le jour de l'opération;

«société inscrite»: une personne qui est inscrite à titre de courtier ou de conseiller en vertu de la législation en valeurs mobilières;

A.M. 2007-03, a. 1.1; A.M. 2009-05, a. 1; A.M. 2010-11, a. 1; A.M. 2017-07, a. 1.

1.2. Interprétation — appariement des opérations et heure normale de l'Est

1) Dans le présent règlement, l'appariement est le processus suivant:

a) la déclaration, la vérification, la confirmation et l'affirmation des modalités et des instructions de règlement d'une opération LCP/RCP exécutée ainsi que l'accord des parties à l'appariement à leur égard;

b) la déclaration des modalités appariées et des instructions de règlement à une chambre de compensation, sauf si le processus est exécuté au moyen des installations d'une chambre de compensation.

2) Pour l'application du présent règlement, au Québec, est assimilé à une chambre de compensation le système de règlement au sens de la Loi sur les valeurs mobilières (chapitre V 1.1).

A.M. 2007-03, a. 1.2; A.M. 2017-07, a. 2.

PARTIE 2 CHAMP D'APPLICATION

2.1. Le présent règlement ne s'applique pas aux opérations suivantes:

a) toute opération sur un titre d'un émetteur qui n'a pas encore été émis ou au sujet duquel un prospectus doit être envoyé ou transmis au souscripteur ou à l'acquéreur en vertu de la législation en valeurs mobilières;

b) toute opération exécutée avec l'émetteur sur ses propres titres;

c) toute opération effectuée dans le cadre d'une offre publique d'achat ou de rachat, une fusion, une réorganisation, un arrangement ou une opération analogue;

d) toute opération exécutée conformément aux conditions de conversion, d'échange ou d'exercice d'un titre émis antérieurement par l'émetteur;

e) toute opération de prêt, de mise en pension ou de prise en pension de titres ou toute opération de financement analogue;

f) toute acquisition visée à la partie 9 ou tout rachat visé à la partie 10 du Règlement 81-102 sur les fonds d'investissement (chapitre V-1.1, r. 39);

g) toute opération qui doit être réglée à l'étranger;

- h) toute opération sur une option, un contrat à terme ou un dérivé analogue;
- i) toute opération sur un billet à ordre, un papier commercial ou un autre titre de créance à court terme similaire négociable qui serait normalement réglée au Canada le jour de l'opération.

A.M. 2007-03, a. 2.1; A.M. 2010-11, a. 2; A.M. 2017-07, a. 3.

PARTIE 3 OBLIGATIONS D'APPARIEMENT DES OPÉRATIONS

3.1. Heure limite d'appariement des opérations applicables au courtier inscrit

- 1) Le courtier inscrit ne peut exécuter d'opérations LCP/RCP avec un investisseur institutionnel ou pour son compte que s'il a établi, conserve et applique des politiques et procédures conçues pour réaliser l'appariement dès que possible après l'exécution de cette opération, mais au plus tard à midi, heure de l'Est, le premier jour après l'opération.
- 2) *(paragraphe abrogé).*

A.M. 2007-03, a. 3.1; A.M. 2010-11, a. 3; A.M. 2017-07, a. 4.

3.2. Obligations de documentation du courtier avant une opération LCP/RCP

Le courtier inscrit ne peut ouvrir de compte pour un investisseur institutionnel en vue d'exécuter une opération LCP/RCP ni accepter l'ordre d'exécuter une opération LCP/RCP pour le compte d'un investisseur institutionnel que si ses politiques et procédures sont conçues pour encourager chaque partie à l'appariement à prendre l'une des mesures suivantes:

- a) conclure une convention d'appariement avec le courtier;
- b) fournir au courtier une déclaration relative à l'appariement.

A.M. 2007-03, a. 3.2; A.M. 2010-11, a. 4.

3.3. Heure limite d'appariement des opérations applicables au conseiller inscrit

- 1) Le conseiller inscrit ne peut donner à un courtier l'ordre d'exécuter une opération LCP/RCP pour le compte d'un investisseur institutionnel que s'il a établi, conserve et applique des politiques et procédures conçues pour réaliser l'appariement dès que

possible après son exécution, mais au plus tard à midi, heure de l'Est, le premier jour après l'opération.

2) (paragraphe abrogé).

A.M. 2007-03, a. 3.3; A.M. 2010-11, a. 5; A.M. 2017-07, a. 5.

3.4. Obligations de documentation du conseiller avant une opération LCP/RCP

Le conseiller inscrit ne peut ouvrir de compte pour un investisseur institutionnel en vue d'exécuter une opération LCP/RCP ni donner à un courtier l'ordre d'exécuter une opération LCP/RCP pour le compte d'un investisseur institutionnel que si ses politiques et procédures sont conçues pour encourager chaque partie à l'appariement à prendre l'une des mesures suivantes:

- a) conclure une convention d'appariement avec le conseiller;
- b) fournir au conseiller une déclaration relative à l'appariement.

A.M. 2007-03, a. 3.4; A.M. 2010-11, a. 6.

PARTIE 4 RAPPORT DE LA SOCIÉTÉ INSCRITE

A.M. 2009-05, a. 2; A.M. 2010-11, a. 7.

4.1. Rapport sur les anomalies

La société inscrite transmet le rapport prévu à l'Annexe 24-101A1 à l'autorité en valeurs mobilières au plus tard 45 jours après la fin du trimestre civil dans les cas suivants:

- a) moins de 90% des opérations LCP/RCP exécutées par elle ou pour son compte au cours du trimestre ont été appariées avant l'heure limite prévue à la partie 3;
- b) les opérations LCP/RCP exécutées par elle ou pour son compte au cours du trimestre qui ont été appariées avant l'heure limite prévue à la partie 3 représentent moins de 90% de la valeur globale des titres achetés et vendus dans ces opérations.

A.M. 2007-03, a. 4.1; A.M. 2009-05, a. 2; A.M. 2010-11, a. 7.

4.1.1. Moratoire

En Ontario, malgré la paragraphe 1 de l'article 2 des la *Rule 11-501 Electronic Delivery of Documents to the Ontario Securities Commission* de la Commission des valeurs

mobilières de l'Ontario, l'article 4.1 ne s'applique pas à une société inscrite du 1^{er} juillet 2020 au 1^{er} juillet 2023.

N.I. 2020-05-01.

PARTIE 5 OBLIGATIONS DE DÉCLARATION APPLICABLES À LA CHAMBRE DE COMPENSATION

5.1. Rapport d'activité trimestriel sur la déclaration et l'appariement des opérations institutionnelles

La chambre de compensation transmet le rapport prévu à l'Annexe 24-101A2 à l'autorité en valeurs mobilières au plus tard 30 jours après la fin du trimestre civil.

A.M. 2007-03, a. 5.1; A.M. 2017-07, a. 6.

PARTIE 6 OBLIGATIONS APPLICABLES AU FOURNISSEUR DE SERVICES D'APPARIEMENT

6.1. Déclaration initiale

1) Une personne ne peut exercer l'activité de fournisseur de services d'appariement que si elle remplit les conditions suivantes:

a) elle a transmis l'avis prévu à l'Annexe 24-101A3 à l'autorité en valeurs mobilières;

b) elle a attendu l'expiration d'un délai de 90 jours après avoir transmis l'avis prévu à l'Annexe 24-101A3 pour commencer son activité.

2) Au cours du délai de 90 jours prévu au paragraphe 1, la personne qui a transmis l'avis prévu à l'Annexe 24-101A3 avise immédiatement par écrit l'autorité en valeurs mobilières de tout changement significatif dans l'information fournie dans cet avis en lui transmettant une modification conformément à cette annexe.

A.M. 2007-03, a. 6.1.

6.2. Changements prévus dans l'exploitation

Au moins 45 jours avant de mettre en œuvre un changement significatif sur un élément de l'avis prévu à l'Annexe 24-101A3, le fournisseur de services d'appariement transmet une modification de cet avis conformément à cette annexe.

A.M. 2007-03, a. 6.2.

6.3. Cessation d'activité du fournisseur de services d'appariement

- 1) Le fournisseur de services d'appariement qui entend cesser son activité d'appariement transmet l'avis prévu à l'Annexe 24-101A4 à l'autorité en valeurs mobilières au moins 30 jours avant la cessation de son activité.
- 2) Le fournisseur de services d'appariement qui cesse son activité involontairement transmet l'avis prévu à l'Annexe 24-101A4 dès que possible après la cessation de son activité.

A.M. 2007-03, a. 6.3.

6.4. Obligations permanentes de déclaration et de tenue des dossiers

- 1) Le fournisseur de services d'appariement transmet le rapport prévu à l'Annexe 24-101A5 à l'autorité en valeurs mobilières au plus tard 30 jours après la fin du trimestre civil.
- 2) Le fournisseur de services d'appariement tient les dossiers nécessaires pour rendre compte de son activité.

A.M. 2007-03, a. 6.4.

6.5. Obligations relatives aux systèmes

Le fournisseur de services d'appariement a, en ce qui concerne ses systèmes de base servant à l'appariement des opérations, les obligations suivantes:

- a) il doit, conformément à la pratique commerciale prudente, 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 tests avec charge élevée pour déterminer leur capacité de traiter les opérations de manière exacte, rapide et efficace;
 - iii) mettre en œuvre des procédures raisonnables pour réviser et tenir à jour la méthode d'essai de ces systèmes;
 - iv) examiner la vulnérabilité de ces systèmes et des opérations informatiques du centre de données face aux menaces informatiques provenant tant de l'interne que de l'externe, y compris les infractions à la sécurité, les risques matériels et les catastrophes naturelles;

v) mettre à jour des plans raisonnables de secours et de continuité des activités;

b) il doit, une fois par année, faire effectuer un examen indépendant des objectifs déclarés de contrôle interne de ces systèmes et faire établir un rapport écrit, conformément aux normes de vérification généralement reconnues;

c) il doit aviser rapidement l'autorité en valeurs mobilières de toute panne importante des systèmes.

A.M. 2007-03, a. 6.5.

PARTIE 7 RÈGLEMENT DES OPÉRATIONS

7.1. Règlement des opérations par le courtier inscrit

1) Le courtier inscrit ne peut exécuter d'opération que s'il a établi, conserve et applique des politiques et des procédures conçues pour en faciliter le règlement au plus tard à la date de règlement standard prévue par un OAR ou le marché visé pour le type de titre faisant l'objet de l'opération.

2) Le paragraphe 1 ne s'applique pas à l'opération dont les modalités de règlement ont été expressément convenues par les parties à l'opération au moment de l'exécution ou avant.

A.M. 2007-03, a. 7.1.

PARTIE 8 OBLIGATIONS DES ORGANISMES D'AUTORÉGLEMENTATION ET DES AUTRES ENTITÉS

8.1. Règles, textes ou procédures d'une chambre de compensation ou d'un fournisseur de services d'appariement

La chambre de compensation et le fournisseur de services d'appariement se dotent de règles, de textes ou de procédures conformes aux parties 3 et 7.

A.M. 2007-03, a. 8.1.

8.2. Règles ou textes d'un organisme d'autoréglementation

Une disposition du présent règlement ne s'applique pas au membre d'un OAR qui se conforme aux règles ou aux textes de ce dernier lorsqu'ils portent sur le même sujet, ont été publiés par celui-ci et ont été approuvés par l'autorité en valeurs mobilières ou n'ont pas été rejetés par celle-ci ou auxquels celle-ci ne s'oppose pas.

A.M. 2007-03, a. 8.2.

PARTIE 9 DISPENSE

9.1. Dispense

1) 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.

3) Sauf en Ontario, cette dispense 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. 2007-03, a. 9.1.

PARTIE 10 DATES D'ENTRÉE EN VIGUEUR ET DISPOSITIONS TRANSITOIRES

10.1. Dates d'entrée en vigueur

1) Les dispositions du présent règlement entrent en vigueur le 1^{er} avril 2007, à l'exception de celles visées aux paragraphes 2 et 3.

2) Les dispositions suivantes entrent en vigueur le 1^{er} octobre 2007:

- a) l'article 3.2;
- b) l'article 3.4;
- c) la partie 4;
- d) la partie 6.

3) Malgré le sous-paragraphe *d* du paragraphe 2, en Ontario, la partie 6 entre en vigueur à la plus éloignée des dates suivantes:

- a) le 1^{er} octobre 2007;
- b) le 1^{er} octobre 2007, date d'entrée en vigueur du *Rule 24-501 — Designation as Market Participant (2007) 30 OSCB 7860*.

A.M. 2007-03, a. 10.1.

10.2. Dispositions transitoires

1) Malgré le paragraphe 1 des articles 3.1 et 3.3, toute opération visée à ce paragraphe et exécutée avant le 1^{er} juillet 2008 doit être appariée au plus tard à 12 heures le premier jour après l'opération.

2) Malgré le paragraphe 2 des articles 3.1 et 3.3, toute opération visée à ce paragraphe et exécutée avant le 1^{er} juillet 2008 doit être appariée au plus tard à 12 heures le deuxième jour après l'opération.

3) Malgré les paragraphes *a* et *b* de l'article 4.1, les pourcentages suivants s'appliquent lorsque les opérations visées à ces paragraphes sont exécutées dans l'une des périodes suivantes:

- a) 80% pour les opérations exécutées après le 30 septembre 2007, mais avant le 1^{er} janvier 2008;

- b) 90% pour les opérations exécutées après le 31 décembre 2007, mais avant le 1^{er} juillet 2008;

- c) 70% pour les opérations exécutées après le 30 juin 2008, mais avant le 1^{er} janvier 2009;

- d) 80% pour les opérations exécutées après le 31 décembre 2008, mais avant le 1^{er} juillet 2009;

- e) 90% pour les opérations exécutées après le 30 juin 2009, mais avant le 1^{er} janvier 2010.

4) Malgré l'article 6.1, une personne peut exercer l'activité de fournisseur de services d'appariement si elle remplit les conditions suivantes:

- a) elle exerce déjà l'activité de fournisseur de services d'appariement le 1^{er} octobre 2007;

b) elle transmet l'avis prévu à l'Annexe 24-101A3 à l'autorité en valeurs mobilières dans un délai de 45 jours à compter du 1^{er} octobre 2007.

A.M. 2007-03, a. 10.2.

**ANNEXE 24-101A1 RAPPORT DE LA SOCIÉTÉ INSCRITE SUR LES
ANOMALIES DE DÉCLARATION ET D'APPARIEMENT DES OPÉRATIONS
LCP/RCP**

TRIMESTRE CIVIL VISÉ

Du _____ au _____

IDENTIFICATION ET COORDONNÉES DE LA SOCIÉTÉ INSCRITE

1. Nom complet, en indiquant dans le cas d'un propriétaire unique, le nom de famille, le prénom et le second prénom:

2. Nom sous lequel l'activité est exercée, s'il est différent de celui indiqué à la rubrique 1:

3a. Adresse de l'établissement principal:

3b. Territoire de l'autorité principale au sens du Règlement 31-103 sur les obligations et dispenses d'inscription et les obligations continues des personnes inscrites (chapitre V-1.1, r. 10):

- Alberta
- Colombie-Britannique
- Île-du-Prince-Édouard
- Manitoba
- Nouveau-Brunswick
- Nouvelle-Écosse
- Nunavut
- Ontario
- Québec
- Saskatchewan
- Terre-Neuve-et-Labrador
- Territoires du Nord-Ouest
- Yukon

3c. Territoires dans lesquels la société est inscrite:

- Alberta
- Colombie-Britannique
- Île-du-Prince-Édouard
- Manitoba
- Nouveau-Brunswick
- Nouvelle-Écosse
- Nunavut
- Ontario

- Québec
- Saskatchewan
- Terre-Neuve-et-Labrador
- Territoires du Nord-Ouest
- Yukon

4. Adresse postale, si elle est différente de l'adresse de l'établissement principal:

5. Type d'activité: courtier conseiller

6. Catégorie d'inscription:

7. a) Numéro BDNI:

b) IDUC, si la personne est adhérente d'une chambre de compensation:

8. Nom de la personne-ressource:

Numéro de téléphone:

Adresse électronique:

INSTRUCTIONS

Transmettre ce rapport, pour les opérations LCP/RCP sur titres de capitaux propres et de créance, avec les Annexes A, B et C, conformément à l'article 4.1 du règlement, dans les 45 jours de la fin du trimestre civil visé, dans les cas suivants:

a) moins de 90% des opérations LCP/RCP sur titres de capitaux propres ou de créance, ou les 2, exécutées par la société inscrite ou pour son compte au cours du trimestre ont été appariées avant l'heure limite prévue à la partie 3 du règlement;

b) les opérations LCP/RCP sur titres de capitaux propres ou de créance exécutées, ou les 2, par la société inscrite ou pour son compte au cours du trimestre qui ont été appariées avant l'heure limite prévue à la partie 3 représentent moins de 90% de la valeur globale des titres achetés et vendus dans ces opérations.

Inclure les opérations LCP/RCP sur titres de fonds négociés en bourse (FNB) dans les statistiques des opérations LCP/RCP sur titres de capitaux propres. Le paragraphe 1 de l'Annexe A ne s'applique qu'aux opérations sur titres de capitaux propres et titres de FNB. Le paragraphe 2 de l'Annexe A ne s'applique qu'aux opérations sur titres de créance et autres titres à revenu fixe.

ANNEXES

Annexe A – Statistiques des opérations LCP/RCP au cours du trimestre

Le cas échéant, remplir le tableau 1 ou 2, ou les 2, pour chaque trimestre civil. L'«heure limite» s'entend de midi, heure de l'Est, le lendemain de l'opération.

1) *Opérations LCP/RCP sur titres de capitaux propres (y compris les opérations sur FNB)*

<i>Opérations saisies dans le système de la chambre de compensation avant l'heure limite (réservé à l'usage des courtiers)</i>				<i>Opérations appariées (à l'usage des courtiers et des conseillers)</i>							
Nombre	%	Valeur	%	Nombre	%	Valeur	%	Nombre (avant l'heure limite)	%	Valeur (avant l'heure limite)	%

2) *Opérations LCP/RCP sur titres de créance*

<i>Opérations saisies dans le système de la chambre de compensation avant l'heure limite (réservé à l'usage des courtiers)</i>				<i>Opérations appariées (à l'usage des courtiers et des conseillers)</i>							
Nombre	%	Valeur	%	Nombre	%	Valeur	%	Nombre (avant l'heure limite)	%	Valeur (avant l'heure limite)	%

Légende

«Nombre»: le nombre total d'opérations exécutées au cours du trimestre civil;
 «Valeur»: la valeur totale des opérations, soit les achats et les ventes, exécutées au cours du trimestre civil.

Annexe B – Raisons du non-respect des seuils de déclaration des anomalies

Décrire les circonstances ou les causes qui ont empêché d'atteindre le pourcentage prévu d'opérations LCP/RCP sur titres de capitaux propres ou de créance

appariées avant l'heure limite la plus éloignée prévue à la partie 3 du règlement, que le responsable soit la société inscrite, une autre partie à l'appariement ou un fournisseur de services. En l'absence d'information suffisante pour établir les pourcentages, en indiquer les raisons. Se reporter également à l'Instruction générale relative au Règlement 24-101 sur l'appariement et le règlement des opérations institutionnelles (Décision 2007-PDG-0056, 2007-03-06) (l'«instruction générale»). Au Québec, cette instruction générale est établie par l'Autorité des marchés financiers.

Annexe C – Mesures prises pour empêcher les retards

Indiquer les mesures prises pour empêcher les retards dans la déclaration et l'appariement des opérations LCP/RCP sur titres de capitaux propres ou de créance à l'avenir. Indiquer la date à laquelle ces mesures doivent être mises en œuvre. Il peut s'agir de mesures internes consistant par exemple à mettre en œuvre un nouveau système ou une nouvelle procédure, ou de mesures tournées vers l'extérieur comme la tenue d'une réunion avec une partie à l'appariement en vue de déterminer les mesures que celle-ci devrait prendre. En l'absence d'information suffisante pour établir les pourcentages, indiquer les mesures prises pour obtenir l'information. Se reporter également à l'instruction générale.

ATTESTATION DE LA SOCIÉTÉ INSCRITE

Le soussigné atteste que l'information fournie dans le présent rapport au nom de la société inscrite est exacte.

FAIT à _____ le, _____ 20_____

(Nom de la société inscrite en caractères d'imprimerie)

(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. 2007-03, Ann. 24-101A1; A.M. 2009-05, a. 2; A.M. 2010-11, a. 8; A.M. 2017-07, a. 7.

ANNEXE 24-101A2 RAPPORT D'ACTIVITÉ TRIMESTRIEL DE LA CHAMBRE DE COMPENSATION SUR LA DÉCLARATION ET L'APPARIEMENT DES OPÉRATIONS INSTITUTIONNELLES

TRIMESTRE CIVIL VISÉ

Du _____ au _____

IDENTIFICATION ET COORDONNÉES DE LA CHAMBRE DE COMPENSATION

1. Nom complet:
2. Nom sous lequel l'activité est exercée, s'il est différent de celui indiqué à la rubrique 1:
3. Adresse de l'établissement principal:
4. Adresse postale, si elle est différente de l'adresse de l'établissement principal:
5. Nom de la personne-ressource:

Numéro de téléphone:

Adresse électronique:

INSTRUCTIONS

Transmettre ce rapport avec toutes les annexes conformément à l'article 5.1 du règlement, dans les 30 jours de la fin du trimestre civil visé.

Inclure les opérations de clients sur titres de fonds négociés en bourse (FNB) dans les statistiques des opérations sur titres de capitaux propres.

Fournir les annexes dans un fichier électronique en format «CSV», c'est-à-dire séparateur «point-virgule», par exemple le format produit par le programme Excel de Microsoft.

ANNEXES

1. RAPPORTS SUR LES DONNÉES

Annexe A – Statistiques globales sur les opérations appariées

Dans les tableaux 1 et 2 ci-dessous, donner pour chaque mois du trimestre l'information relative aux opérations de clients. Ces 2 tableaux peuvent être intégrés dans un seul rapport. Fournir séparément l'information globale pour les opérations

déclarées ou saisies dans le système comme appariées par un fournisseur de services d'appariement.

Mois/année: _____ (MM/AAAA)

Tableau 1 – Opérations sur titres de capitaux propres

	<u>Opérations saisies dans le système de la chambre de compensation par les courtiers</u>				<u>Opérations appariées dans le système de la chambre de compensation par les dépositaires</u>			
	Nombre	% du secteur	Valeur	% du secteur	Nombre	% du secteur	Valeur	% du secteur
Jour de l'op.								
Midi le 1 ^{er} jour après l'op.								
1 ^{er} jour après l'op.								
2 ^e jour après l'op.								
+ de 2 jours								
Total								

Tableau 2 – Opérations sur titres de créance

	<u>Opérations saisies dans le système de la chambre de compensation par les courtiers</u>				<u>Opérations appariées dans le système de la chambre de compensation par les dépositaires</u>			
	Nombre	% du secteur	Valeur	% du secteur	Nombre	% du secteur	Valeur	% du secteur
Jour de l'op.								
Midi le 1 ^{er} jour après l'op.								
1 ^{er} jour après l'op.								
2 ^e jour après l'op.								
+ de 2 jours								
Total								

Légende

«Nombre»: le nombre total d'opérations exécutées au cours du mois;

«Valeur»: la valeur totale des opérations, soit les achats et les ventes, exécutées au cours du mois.

Annexe B – Statistiques individuelles sur les opérations appariées

Dans le format de l'Annexe A, ci-dessus, fournir pour chaque adhérent de la chambre de compensation l'information relative aux opérations de clients qui ont été

saisies par l'adhérent et appariées dans les délais prévus à cette annexe au cours du trimestre.

ATTESTATION DE LA CHAMBRE DE COMPENSATION

Le soussigné atteste que l'information fournie dans le présent rapport au nom de la chambre de compensation est exacte.

FAIT à _____ le, _____ 20_____

(Nom de la chambre de compensation en caractères d'imprimerie)

(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. 2007-03, Ann. 24-101A2; A.M. 2010-11, a. 9; A.M. 2017-07, a. 8.

ANNEXE 24-101A3 AVIS CONCERNANT L'ACTIVITÉ DE FOURNISSEUR DE SERVICES D'APPARIEMENT

INFORMATION RELATIVE À LA DATE DE COMMENCEMENT D'ACTIVITÉ

Date de commencement de l'activité: _____ (JJ/MM/AAAA)

TYPE D'INFORMATION: AVIS INITIAL MODIFICATION

IDENTIFICATION ET COORDONNÉES DU FOURNISSEUR DE SERVICES D'APPARIEMENT

1. Nom complet:
2. Nom sous lequel l'activité est exercée, s'il est différent de celui indiqué à la rubrique 1:
3. Adresse de l'établissement principal:
4. Adresse postale, si elle est différente de l'adresse de l'établissement principal:
5. Nom de la personne-ressource:
Numéro de téléphone:
Adresse électronique:
6. Conseiller juridique:
Nom du cabinet:
Numéro de téléphone:
Adresse électronique:

INFORMATION GÉNÉRALE

7. Adresse du site Web:
8. Date de clôture de l'exercice: _____ (JJ/MM/AAAA)

9. Indiquer la forme juridique de la société, par exemple, société par actions, société en commandite ou société en nom collectif, ainsi que la date et le territoire de constitution:

Forme juridique: Société par actions Société de personnes
 Autre (préciser)

- a) Date de constitution: _____ (JJ/MM/AAAA)
- b) Territoire et mode de constitution:

10. Indiquer les types de titres généraux dont le fournisseur de services d'appariement reçoit et traite ou recevra et traitera les données en vue de la transmission des opérations appariées à une chambre de compensation, par exemple, titres de capitaux propres ou de créance canadiens cotés, titres de capitaux propres ou de créance étrangers cotés, titres de capitaux propres ou de créance hors cote.

INSTRUCTIONS

Transmettre l'avis avec toutes les annexes conformément à l'article 6.1 du règlement.

Sur chacune des annexes, inscrire le nom du fournisseur de services d'appariement, la date de transmission de l'annexe et la date à laquelle l'information est arrêtée si elle est différente de la date de transmission. Si une annexe est sans application, fournir à la place une explication des raisons. Si l'information à fournir en vertu d'une annexe est identique à celle qui est fournie en vertu d'une autre annexe déposée ou transmise conformément au Règlement 21-101 sur le fonctionnement du marché (chapitre V-1.1, r. 5), il suffit de joindre un exemplaire de l'autre annexe en indiquant dans la présente annexe où l'information se trouve dans l'autre annexe.

Le fournisseur de services d'appariement qui transmet, conformément au paragraphe 2 de l'article 6.1 ou à l'article 6.2 du règlement, une modification du présent avis concernant l'une de ses annexes doit fournir une description de la modification et transmettre une annexe à jour.

ANNEXES

1. GOUVERNANCE

Annexe A – Documents constitutifs

Fournir un exemplaire des documents constitutifs, notamment des statuts et autres textes similaires, avec toutes leurs modifications successives.

Annexe B – Propriété

Fournir la liste des personnes qui possèdent 10% ou plus des titres avec droit de vote du fournisseur de services d'appariement ou qui, directement ou indirectement, par convention ou autrement, peuvent exercer un contrôle sur la direction de celui-ci. Donner leur nom et leur adresse et joindre un exemplaire de la convention ou, en l'absence de convention écrite, décrire brièvement la convention ou le fondement leur permettant d'exercer un contrôle.

Annexe C – Responsables

Fournir la liste des associés, dirigeants, administrateurs ou personnes exerçant des fonctions semblables qui sont en poste pendant l'année civile en cours ou l'ont été pendant l'année civile précédente, en indiquant pour chacun les éléments suivants:

1. son nom;
2. son titre;
3. les dates du début et de la fin de ses fonctions actuelles et la durée totale de ces fonctions;
4. le type d'activité principale et son employeur actuel;
5. le type d'activité principale exercée au cours des 5 dernières années, si elle diffère de celle décrite à la rubrique 4;
6. le fait qu'il est considéré ou non comme administrateur indépendant.

Annexe D – Structure organisationnelle

Fournir un texte ou un schéma présentant la structure organisationnelle du fournisseur de services d'appariement.

Annexe E – Entités du même groupe

Donner l'information suivante relativement à chaque personne du même groupe que le fournisseur de services d'appariement:

1. ses nom et adresse;
2. sa forme juridique, par exemple, association, société par actions, société de personnes;
3. son territoire de constitution et sa loi constitutive;
4. la date de sa constitution dans sa forme actuelle;
5. une brève description de la nature et de la portée de son affiliation ou du contrat ou de toute autre convention avec le fournisseur de services d'appariement;
6. une brève description de son activité ou de ses fonctions;
7. dans le cas où, au cours de l'exercice précédent, la personne a cessé de faire partie du même groupe que le fournisseur de services d'appariement ou d'être partie à un contrat ou à toute autre convention portant sur le fonctionnement de ce dernier, une brève description des raisons de la fin de la relation.

2. VIABILITÉ FINANCIÈRE

Annexe F – États financiers vérifiés

Fournir les états financiers vérifiés du fournisseur de services d'appariement pour le dernier exercice, accompagnés d'un rapport établi par un vérificateur indépendant.

3. DROITS

Annexe G – Barème des droits

Fournir le barème des droits et autres frais imposés ou à imposer par le fournisseur de services d'appariement pour ses services, notamment le coût d'établissement de la connexion avec ses systèmes.

4. ACCÈS

Annexe H – Utilisateurs

Fournir la liste complète des utilisateurs ou abonnés auxquels le fournisseur de services d'appariement offre ou se propose d'offrir ses services, en indiquant le ou les

types d'activités exercées par chacun d'eux, par exemple, dépositaire, courtier, conseiller ou autre.

Le cas échéant, indiquer le nom de chaque utilisateur ou abonné à qui l'accès aux services offerts par le fournisseur de services d'appariement a été interdit ou restreint au cours du dernier exercice ainsi que les raisons de cette décision.

Annexe I – Contrat d'utilisation

Fournir un exemplaire de tout modèle de contrat d'abonnement des utilisateurs ou abonnés aux services du fournisseur de services d'appariement.

5. SYSTÈMES ET FONCTIONNEMENT

Annexe J – Description des systèmes

Décrire le mode de fonctionnement des systèmes du fournisseur de services d'appariement, notamment les systèmes de collecte et de traitement des données sur l'exécution des modalités et des instructions de règlement aux fins d'appariement des opérations. Cette description doit comprendre les éléments suivants:

1. les heures de fonctionnement des systèmes, y compris la communication avec une chambre de compensation;
2. l'endroit où les systèmes sont exploités, par exemple, les pays et villes où se trouvent les ordinateurs principaux et de secours;
3. une brève description de chaque service ou fonction exécuté par le fournisseur de services d'appariement.

6. CONFORMITÉ DES SYSTÈMES

Annexe K – Sécurité

Fournir une brève description des processus et procédures mis en œuvre par le fournisseur de services d'appariement pour assurer la sécurité de tout système utilisé pour offrir ses services.

Annexe L – Planification et mesure de la capacité

1. Fournir une brève description des techniques de planification de la capacité ou de mesure du rendement et des méthodes d'essai des systèmes et d'essai avec charge élevée.

2. Fournir une brève description des méthodes d'essai avec les utilisateurs ou les abonnés. Indiquer notamment le moment et la portée des essais.

Annexe M – Continuité des activités

Fournir une brève description des plans de secours et de continuité des activités en cas de catastrophe.

Annexe N – Pannes importantes des systèmes

Fournir une brève description des politiques et procédures permettant de signaler aux autorités en valeurs mobilières les pannes importantes des systèmes. Les pannes de systèmes importantes sont notamment les incidents graves qui entraînent l'interruption de l'appariement des opérations pendant plus de 30 minutes pendant les heures normales de fonctionnement.

Annexe O – Vérification indépendante des systèmes

1. Décrire brièvement les mesures prises pour exécuter une vérification annuelle indépendante des systèmes.
2. Le cas échéant, fournir un exemplaire du dernier rapport de vérification externe des systèmes.

7. INTEROPÉRABILITÉ

Annexe P – Conventions d'interopérabilité

Fournir la liste complète des autres fournisseurs de services d'appariement avec lesquels le fournisseur de services d'appariement a conclu une convention d'interopérabilité. Joindre un exemplaire de chaque convention.

8. SOUS-TRAITANCE

Annexe Q – Sous-traitants

Fournir les renseignements suivants relativement à chaque sous-traitant avec lequel le fournisseur de services d'appariement a conclu une convention pour la prestation de ses services:

1. ses nom et adresse;
2. une brève description de ses services ou fonctions;

3. une brève description de ses plans de secours ou de continuité de ses activités en cas de catastrophe.

ATTESTATION DU FOURNISSEUR DE SERVICES D'APPARIEMENT

Le soussigné atteste que l'information fournie dans le présent avis au nom du fournisseur de services d'appariement est exacte.

FAIT à _____ le, _____ 20 _____

(Nom du fournisseur de services d'appariement en caractères d'imprimerie)

(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. 2007-03, Ann. 24-101A3; A.M. 2017-07, a. 9.

ANNEXE 24-101A4 AVIS DE CESSATION D'ACTIVITÉ DU FOURNISSEUR DE SERVICES D'APPARIEMENT

INFORMATION RELATIVE À LA DATE DE CESSATION D'ACTIVITÉ

Type d'information: CESSATION VOLONTAIRE
 CESSATION INVOLONTAIRE

Date de cessation de l'activité: _____ (JJ/MM/AAAA)

IDENTIFICATION ET COORDONNÉES DU FOURNISSEUR DE SERVICES D'APPARIEMENT

1. Nom complet:
2. Nom sous lequel l'activité est exercée, s'il est différent de celui indiqué à la rubrique 1:
3. Adresse de l'établissement principal:
4. Adresse postale, si elle est différente de l'adresse de l'établissement principal:
5. Conseiller juridique:
Nom du cabinet:
Numéro de téléphone:
Adresse électronique:

INSTRUCTIONS

Transmettre l'avis avec toutes les annexes conformément à l'article 6.3 du règlement.

Sur chacune des annexes, inscrire le nom du fournisseur de services d'appariement, la date de transmission de l'annexe et la date à laquelle l'information est arrêtée si elle est différente de la date de transmission. Si une annexe est sans application, fournir à la place une explication des raisons.

ANNEXES

Annexe A

Indiquer les raisons de la cessation de l'activité du fournisseur de services d'appariement.

Annexe B

Fournir la liste complète des utilisateurs ou abonnés auxquels des services ont été fournis au cours des 30 jours précédant la cessation d'activité en indiquant le ou les types d'activités exercées par chacun d'eux, par exemple, dépositaire, courtier, conseiller en valeurs ou autre.

Annexe C

Fournir la liste complète des autres fournisseurs de services d'appariement auxquels le fournisseur de services d'appariement était lié par une convention d'interopérabilité avant la cessation de ses activités.

ATTESTATION DU FOURNISSEUR DE SERVICES D'APPARIEMENT

Le soussigné atteste que l'information fournie dans le présent avis au nom du fournisseur de services d'appariement est exacte.

FAIT à _____ le, _____ 20_____

(Nom du fournisseur de services d'appariement en caractères d'imprimerie)

(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. 2007-03, Ann. 24-101A4.

**ANNEXE 24-101A5 RAPPORT D'ACTIVITÉ TRIMESTRIEL DU
FOURNISSEUR DE SERVICES D'APPARIEMENT SUR LA DÉCLARATION ET
L'APPARIEMENT DES OPÉRATIONS INSTITUTIONNELLES**

TRIMESTRE CIVIL VISÉ

Du _____ au _____

**IDENTIFICATION ET COORDONNÉES DU FOURNISSEUR DE SERVICES
D'APPARIEMENT**

1. Nom complet:
2. Nom sous lequel l'activité est exercée, s'il est différent de celui indiqué à la rubrique 1:
3. Adresse de l'établissement principal:
4. Adresse postale, si elle est différente de l'adresse de l'établissement principal:
5. Nom de la personne-ressource:

Numéro de téléphone:

Adresse électronique:

INSTRUCTIONS

Transmettre ce rapport avec toutes les annexes conformément à l'article 6.4 du règlement, dans les 30 jours de la fin du trimestre civil visé.

Inclure les opérations LCP/RCP sur titres de fonds négociés en bourse (FNB) dans les statistiques des opérations LCP/RCP sur titres de capitaux propres.

Fournir les annexes dans un fichier électronique en format «CSV», c'est-à-dire séparateur «point-virgule», par exemple le format produit par le programme Excel de Microsoft. Si l'information prescrite n'est pas disponible, en expliquer les raisons séparément.

ANNEXES

1. RAPPORTS SUR LES SYSTÈMES

Annexe A – Vérification externe des systèmes

Fournir un exemplaire de tout rapport établi à l'issue d'une vérification externe des systèmes de base au cours du trimestre.

Annexe B – Pannes importantes des systèmes

Fournir un bref sommaire des pannes importantes des systèmes survenues au cours du trimestre et dont le fournisseur de services d'appariement est tenu d'aviser l'autorité en valeurs mobilières en vertu du paragraphe c de l'article 6.5 du règlement.

2. RAPPORTS SUR LES DONNÉES

Annexe C – Statistiques globales sur les opérations appariées

Dans les tableaux 1 et 2 ci-dessous, donner pour chaque mois du trimestre l'information prévue. Ces 2 tableaux peuvent être intégrés dans un seul rapport.

Mois/année: _____ (MM/AAAA)

Tableau 1 – Opérations sur titres de capitaux propres

	<u>Opérations saisies dans le système du fournisseur de services d'appariement par des courtiers utilisateurs ou abonnés</u>				<u>Opérations appariées dans le système du fournisseur de services d'appariement par d'autres utilisateurs ou abonnés</u>			
	Nombre	% du secteur	Valeur	% du secteur	Nombre	% du secteur	Valeur	% du secteur
Jour de l'op.								
Midi le 1 ^{er} jour après l'op.								
1 ^{er} jour après l'op.								
2 ^e jour après l'op.								
+ de 2 jours								
Total								

Tableau 2 – Opérations sur titres de créance

	<u>Opérations saisies dans le système du fournisseur de services d'appariement par des courtiers utilisateurs ou abonnés</u>				<u>Opérations appariées dans le système du fournisseur de services d'appariement par d'autres utilisateurs ou abonnés</u>			
	Nombre	% du secteur	Valeur	% du secteur	Nombre	% du secteur	Valeur	% du secteur
Jour de l'op.								
Midi le 1 ^{er} jour après l'op.								
1 ^{er} jour après l'op.								
2 ^e jour après l'op.								
+ de 2 jours								
Total								

Légende

«Nombre»: le nombre total d'opérations exécutées au cours du mois;

«Valeur»: la valeur totale des opérations, soit les achats et les ventes, exécutées au cours du mois.

Annexe D – Statistiques individuelles sur les opérations appariées

Dans le format de l'Annexe C, ci-dessus, fournir pour chaque utilisateur ou abonné l'information relative aux opérations qui ont été saisies par l'utilisateur ou l'abonné et appariées dans les délais prévus à cette annexe au cours du trimestre.

ATTESTATION DU FOURNISSEUR DE SERVICES D'APPARIEMENT

Le soussigné atteste que l'information fournie dans le présent rapport au nom du fournisseur de services d'appariement est exacte.

FAIT à _____ le, _____ 20_____

(Nom du fournisseur de services d'appariement en caractères d'imprimerie)

(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. 2007-03, Ann. 24-101A5; A.M. 2010-11, a. 10; A.M. 2017-07, a. 10.

DISPOSITONS TRANSITOIRES

M.O. 2017-07, 2017 G.O. 2569

12. Transition – rapport sur les anomalies de la société inscrite – application des anciennes dispositions au premier trimestre suivant le 5 septembre 2017

1) Aux fins des calculs prévus par le Règlement 24-101 sur l'appariement et le règlement des opérations institutionnelles (chapitre V-1.1, r. 8), qui visent à établir si, pour le premier trimestre civil se terminant après le 5 septembre 2017, elle est tenue de transmettre le rapport prévu à l'Annexe 24 101A1 en vertu de l'article 4.1 de ce règlement, la société inscrite peut se fonder sur le texte de ce règlement qui était en vigueur le jour précédant le 5 septembre 2017, sauf si le 5 septembre 2017 tombe le premier jour d'un trimestre civil.

2) Le cas échéant, et si le 5 septembre 2017 ne tombe pas le premier jour d'un trimestre civil, la société inscrite peut se conformer à cette obligation en transmettant la version du rapport prévu à l'Annexe 24-101A1 qui était en vigueur le jour précédant le 5 septembre 2017.

13. Transition – rapport d’activité de la chambre de compensation – application des anciennes dispositions au premier trimestre civil se terminant après le 5 septembre 2017

Pour l’application de l’article 5.1 du Règlement 24-101 sur l’appariement et le règlement des opérations institutionnelles (chapitre V-1.1, r. 8), la chambre de compensation peut se conformer à l’obligation de transmission du rapport prévu à l’Annexe 24-101A2 pour le premier trimestre civil se terminant après le 5 septembre 2017 en transmettant la version de ce rapport qui était en vigueur le jour précédant le 5 septembre 2017, sauf si le 5 septembre 2017 tombe le premier jour d’un trimestre civil.

14. Transition – rapport d’activité du fournisseur de services d’appariement – application des anciennes dispositions au premier trimestre civil se terminant après le 5 septembre 2017

Pour l’application du paragraphe 1 de l’article 6.4 du Règlement 24-101 sur l’appariement et le règlement des opérations institutionnelles (chapitre V-1.1, r. 8), le fournisseur de services d’appariement peut se conformer à l’obligation de transmission du rapport prévu à l’Annexe 24 101A5 pour le premier trimestre civil se terminant après le 5 septembre 2017 en transmettant la version de ce rapport qui était en vigueur le jour précédant le 5 septembre 2017, sauf si le 5 septembre 2017 tombe le premier jour d’un trimestre civil.

Décision 2007-PDG-0055, 2007-03-06
Bulletin de l’Autorité: 2007-03-23, Vol. 4 n° 12
A.M. 2007-03, 2007 G.O. 2, 1743

Modifications

Décision 2009-PDG-0123, 2009-09-04
Bulletin de l’Autorité: 2009-09-25, Vol. 6 n° 38
A.M. 2009-05, 2009 G.O. 2, 4824A

Décision 2010-PDG-0083, 2010-05-10
Bulletin de l’Autorité: 2010-06-18, Vol. 7 n° 24
A.M. 2010-11, 1^{er} juin 2010, G.O. 16 juin 2010

Décision 2017-PDG-0077, 2017-05-24
Bulletin de l’Autorité: 2017-06-29, Vol. 14 n° 25
A.M. 2017-07, 2017 G.O. 2, 2569

Avis 11-342 du personnel des ACVM
Bulletin de l’Autorité : 2020-08-06, Vol. 17 n° 31
N.I. 2020-05-01