



## REFONDUE JUSQU'AU 12 AVRIL 2022

***Cette refonte vous est fournie à titre de commodité seulement et ne doit pas être considérée comme un document qui fait autorité***

---

### NORME CANADIENNE 94-101 SUR LA COMPENSATION OBLIGATOIRE DES DÉRIVÉS PAR CONTREPARTIE CENTRALE

#### CHAPITRE 1 DÉFINITIONS ET INTERPRÉTATION

##### 1. Définitions et interprétation

1) Dans la présente règle, on entend par :

« agence de compensation et de dépôt 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 ou société reconnue ou dispensée de la reconnaissance à titre d'agence de compensation et de dépôt, 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 ou société reconnue ou dispensée de la reconnaissance à titre d'agence de compensation et de dépôt ou d'agence de compensation dans le territoire intéressé;
- c) au Québec, une personne reconnue ou dispensée de la reconnaissance à titre d'agence de compensation et de dépôt;

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

- a) une personne ou société, 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;
- b) elle est une entité du même groupe qu'une personne ou société visée au paragraphe a, cette personne ou société

étant responsable de la totalité ou de la quasi-totalité des passifs de cette partie;

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

« transaction » : l'une des transactions 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 agence de compensation et de dépôt;

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

- 2) Dans la présente règle, 2 personnes sont des entités du même groupe si l'une contrôle l'autre ou si elles sont contrôlées par la même personne.
- 3) Dans la présente règle, une personne ou société est considérée comme exerçant le contrôle d'une autre personne ou société dans les cas suivants :
  - a) elle a la propriété véritable de titres de cette autre personne ou société 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 la présente règle, 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.

### **Champ d'application**

2. La présente règle 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 *derivative* 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 *derivative* 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;
  - 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.

*Dans chacun des autres territoires intéressés, la présente règle s'applique à un dérivé, au sens du paragraphe 4 de l'article 1 de la présente règle. Cet encadré ne fait pas partie de la présente règle et n'a pas de valeur officielle.*

## **CHAPITRE 2 OBLIGATION DE COMPENSATION PAR CONTREPARTIE CENTRALE**

### **Obligation de soumettre les transactions pour compensation**

- 3. 1) La contrepartie locale à une transaction sur un dérivé obligatoirement compensable le soumet ou le fait soumettre pour compensation à une agence de compensation et de dépôt 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 agence de compensation et de dépôt 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) à un moment quelconque après la date d'entrée en vigueur de la présente règle, 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 l'alinéa 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 l'alinéa b s'applique;

- ii) à un moment quelconque après la date d'entrée en vigueur de la présente règle, 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 l'alinéa a du paragraphe 1 de l'article 7 s'applique.
- 2) Sauf si l'alinéa a du paragraphe 1 s'applique, la contrepartie locale visée à l'alinéa b ou c de ce paragraphe n'est pas tenue de soumettre pour compensation un dérivé obligatoirement compensable à une agence de compensation et de dépôt réglementée si la transaction sur le dérivé a été exécutée avant le 90<sup>e</sup> 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 au sous-alinéa ii de l'alinéa 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 la transaction est exécutée durant les heures d'ouverture de l'agence de compensation et de dépôt réglementée;
  - b) à la fin du jour ouvrable suivant, si la transaction est exécutée après la fermeture des bureaux de l'agence de compensation et de dépôt réglementée.
- 4) La contrepartie locale visée au paragraphe 1 soumet pour compensation le dérivé obligatoirement compensable conformément aux règles de l'agence de compensation et de dépôt 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.

#### **Avis de refus**

- 4. L'agence de compensation et de dépôt réglementée qui refuse un dérivé obligatoirement compensable soumis pour compensation en avise immédiatement chaque contrepartie locale.

#### **Publication des dérivés compensables et des dérivés obligatoirement compensables**

- 5. L'agence de compensation et de dépôt 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.

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

### Non-application

6. La présente règle ne s'applique pas 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 ou société 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.

### Dispense pour transaction 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 de la Norme canadienne 52-107 sur les *principes comptables et normes d'audit acceptables*;
  - 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 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.

### **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 agence de compensation et de dépôt;
  - 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.

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

## **CHAPITRE 4 DÉRIVÉS OBLIGATOIREMENT COMPENSABLES**

### **Soumission de renseignements sur les services de compensation de dérivés fournis par l'agence de compensation et de dépôt 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, l'agence de compensation et de dépôt 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 de la présente règle, 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 Alberta et en Ontario, la dispense prévue au paragraphe 1 est accordée conformément à la loi visée à l'Annexe B de la Norme canadienne 14-101 sur les *définitions*, vis-à-vis du nom du territoire intéressé.

## **CHAPITRE 6 DISPOSITIONS TRANSITOIRES ET DATE D'ENTRÉE EN VIGUEUR**

### **Dispositions transitoires – obligation de dépôt de l'agence de compensation et de dépôt**

12. Au plus tard le 4 mai 2017, l'agence de compensation et de dépôt 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.

### **Dispositions transitoires – soumission pour compensation par certaines contreparties**

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

### **Date d'entrée en vigueur**

14.
  - 1) La présente règle entre en vigueur le 4 avril 2017.
  - 2) En Saskatchewan, malgré le paragraphe 1, la présente règle entre en vigueur à la date de son dépôt auprès du registraire des règlements si celle-ci tombe après le 4 avril 2017.

**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

**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	EURIBOR	EUR	3 jours à 3 ans	Mono-monnaie	Non	Constant

garantie de taux						
Contrat de garantie de taux	LIBOR	GBP	3 jours à 3 ans	Mono-monnaie	Non	Constant

**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
Union européenne	Règlement (UE) N° 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
Royaume-Uni	<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>
États-Unis d'Amérique	<i>Clearing Requirement and Related Rules, 17 CFR Part 50</i>

## 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 :

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;
- 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				

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)

**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 l'agence de compensation et de dépôt 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;
  - b) les possibilités de confirmation de l'opération par voie électronique;
  - 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 l'agence de compensation et de dépôt 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 l'agence de compensation et de dépôt 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 l'agence de compensation et de dépôt 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 L'AGENCE DE COMPENSATION ET DE DÉPÔT RÉGLEMENTÉE**

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

FAIT À \_\_\_\_\_ le \_\_\_\_\_ 20\_\_\_\_

\_\_\_\_\_  
(Nom de l'agence de compensation et de dépôt 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)