

Avis informationnel 21-013

Nouvelle mise à jour du protocole d'API de compensation

Bourse de Montréal Inc. (la « Bourse ») mettra en œuvre son mécanisme d'établissement du prix moyen par le biais d'une mise à jour du protocole d'API de compensation à compter du 1^{er} novembre 2021. Consultez l'[avis](#) annonçant le lancement initial du mécanisme en octobre 2020 pour en apprendre davantage sur le sujet.

Le présent avis informationnel a pour objet la publication d'une version mise à jour du guide intitulé *Clearing Access Services Messaging Protocol Guide v. 1.16*. Des modifications mineures et des précisions ont été apportées au guide pour le rendre plus cohérent.

INTERFACE API DE COMPENSATION

Les modifications apportées aux spécifications du protocole d'API de compensation sont résumées ci-dessous.

- **Business Error** : ajout des étiquettes 6204 et 5190 au message de type BusinessError.

NOM DU CHAMP	ÉTIQUETTE	EXIGENCE	COMMENTAIRES
Operation	6204	C	<ul style="list-style-type: none">● 0 : Ajouter / créer● 1 : Mettre à jour● 2 : Annuler / supprimer

			Cette étiquette sert aux fins d'une erreur de PricingGroupInstruction en vue d'indiquer l'opération demandée dans le message PricingGroupInstruction.
TradeAllocReportId	5190	C	Cette étiquette fait référence à un identifiant de rapport sur les opérations. Elle sert aux fins d'une erreur de PricingGroupInstruction en vue de faire ressortir l'opération dans la liste des opérations (TradeList) qui a causé l'erreur.

- **Trade Report** : Ce message apporte un complément d'information sur les étiquettes 6084, 6146 et 6147 en vue de différencier les instruments négociés des instruments attribués.

NOM DU CHAMP	ÉTIQUETTE	EXIGENCE	COMMENTAIRES
ExternalSymbol	6146	R	Le symbole externe de l'instrument négocié. Il s'agit du symbole attribué à l'instrument négocié dans le cadre d'une stratégie ou d'une opération sur la base.
AllocationSymbol	6147	R	Le symbole externe de l'instrument attribué. Il s'agit du symbole attribué à la composante d'une stratégie dans le cadre d'une stratégie de négociation. Il s'agit du symbole attribué à l'instrument dérivé associé à la base dans le cadre d'une opération sur la base.
Sico	6084	R	L'identifiant attribué par la Bourse à l'instrument négocié. Il s'agit de l'identifiant attribué à une stratégie dans le cadre d'une stratégie de négociation. Il s'agit de l'identifiant attribué à l'instrument associé à la base dans le cadre d'une opération sur la base. Format IIIIGG III : Instrument ID (formé de caractères alphanumériques et sensible à la casse) GG : Group ID (formé de caractères alphanumériques et sensible à la casse)

- **Give-Up Agreement Report** : L'étiquette 5193 est maintenant considérée comme conditionnelle étant donné que les rapports acheminés après un message d'invitation à la lecture ne comportent plus l'étiquette 5193.

NOM DU CHAMP	ÉTIQUETTE	EXIGENCE	COMMENTAIRES
InstAct	5193	C	Cette étiquette sert aux fins de la gestion des ententes « Give-Up » au niveau du client lorsque celui-ci reçoit un rapport.

- **Quick ID Instruction** : Ce message apporte un complément d'information sur les étiquettes 5198 (QuickId Name) et 604 (QuickId).

NOM DU CHAMP	ÉTIQUETTE	EXIGENCE	COMMENTAIRES
QuickId Name	5198	C	Nom unique de client servant à identifier un Quick ID. Cette étiquette est requise pour une opération de création ou de mise à jour. (5193 = 0 ou 2)
QuickId	604	C	Identifiant unique de système faisant référence à un Quick ID existant. Cette étiquette est requise pour une opération de mise à jour ou de suppression (5193 = 2 ou 3)

- **Quick ID Report** : L'étiquette 5193 est maintenant considérée comme conditionnelle étant donné que les rapports acheminés après un message d'invitation à la lecture ne comportent plus l'étiquette 5193.

NOM DU CHAMP	ÉTIQUETTE	EXIGENCE	COMMENTAIRES
InstAct	5193	C	Cette étiquette sert aux fins de la gestion des ententes « Give-Up » au niveau du client lorsque celui-ci reçoit un rapport.

- **Champ Sico** : Ce champ sert à indiquer une description de format.

NOM DU CHAMP	ÉTIQUETTE	DESCRIPTION / VALEURS	FORMAT
Sico	6084	L'identifiant attribué par la Bourse à l'instrument négocié. Il s'agit de l'identifiant attribué à une stratégie dans le cadre d'une stratégie de	Chaîne

		<p>négociation. Il s'agit de l'identifiant attribué à l'instrument associé à la base dans le cadre d'une opération sur la base.</p> <p>Format IIIIGG</p> <p>III : Instrument ID (formé de caractères alphanumériques et sensible à la casse)</p> <p>GG : Group ID (formé de caractères alphanumériques et sensible à la casse)</p>	
--	--	--	--

CALENDRIER

<p>Clearing Access Services Messaging Protocol Guide v. 1.16</p>	<p>Ce guide est disponible dès maintenant à l'adresse www.tmxwebstore.com</p>
--	--

Veillez communiquer avec le Centre de soutien technique pour toute question, tout commentaire ou toute demande de renseignements supplémentaires.

Centre de soutien technique

Numéro sans frais : 1 877 588-8489

Téléphone : 514 871-7872

Courriel : MarketOps@tmx.com