



Avis technique

11-006

- À :** Participants de la Bourse de Montréal, rediffuseurs et fournisseurs indépendants de logiciels (FIL)
- DE :** Responsable de la connectivité des participants
- OBJET :** Anonymat post-transaction : retrait du code d'identification de la contrepartie et nouveau rapport d'opération de fin de journée (*End of Day Trade Report*)
- DATE :** Le 11 mars 2011

Dans le cadre d'une initiative en vue d'assurer une amélioration continue de ses marchés, la Bourse de Montréal (ci-après nommée « la Bourse ») introduira l'anonymat post-transaction pour son marché des options et son marché à terme le **25 avril 2011**. Le présent avis a pour but d'informer nos clients que la Bourse n'affichera plus en temps réel l'information sur la contrepartie et qu'elle enlèvera le code d'identification de la contrepartie des protocoles et services suivants :

- SAIL
- FIX
- FIXTT
- STAMP
- ATR
- TMS
- Rapports TMS DTMIIB (*TMS DTMIIB Reports*)

L'information sur la contrepartie sera offerte dans le rapport d'opération de fin de journée (*End of Day Trade Report*) qui sera disponible le jour ouvrable suivant l'exécution des opérations.

La Bourse conseille vivement à ses clients de s'assurer que leurs systèmes existants fonctionneront sans le code d'identification de la contrepartie offert dans les protocoles et services susmentionnés.

Incidences sur les divers messages et services

- **SAIL – le champ sur la contrepartie correspondant à chaque type de message sera vide**

Type de message (Message Type)	Message SAIL	Nom de champ (Field Name)	Type champ (Field Type)
NT	ExecutionNotice	Code d'identification de la contrepartie (<i>ID Code for the Counterpart Participant</i>)	Identification de la firme (Firm ID)
NX	ExecutionCancellationNotice	Code d'identification de la contrepartie (<i>ID Code for the Counterpart Participant</i>)	Identification de la firme (Firm ID)
NL	LegExecutionNotice	Code d'identification de la contrepartie (<i>ID Code for the Counterpart Participant</i>)	Identification de la firme (Firm ID)
NY	LegExecutionCancellationNotice	Code d'identification de la contrepartie (<i>ID Code for the Counterpart Participant</i>)	Identification de la firme (Firm ID)

- **FIX et FIXTT – le champ sur la contrepartie correspondant au type de message sera vide**

Type de message (Message Type)	Balise (Tag)	Nom de champ (Field Name)
Execution Report (8)	375	Contrepartie (ContraBroker)

- **STAMP – le champ sur la contrepartie correspondant au message STAMP sera vide**

Message STAMP (STAMP Message)	Balise (Tag)	Nom de champ (Field Name)
File Report	37	Contrepartie (OppositeBroker)

- **ATR – le champ sur la contrepartie correspondant à chaque type de message sera vide**

Type de message (Message Type)	Nom de champ (Field Name)	L	T	Type champ (Field Type)
30 - Trade	Contrepartie (Opposite Broker)	3	N	N contient le numéro de compensation de la contrepartie pour l'opération. Intervalle [1, 999], aligné à droite, aucun remplissage (zero-padded)
31 - Trade Cancel	Contrepartie (Opposite Broker)	3	N	N contient le numéro de compensation de la contrepartie pour l'opération. Intervalle [1, 999], aligné à droite, aucun remplissage (zero-padded)

- **Trade Management System (TMS) – les champs *OppositeFirmIdentification* seront vides**

Type de compensation (Clearing Type)	OppositeFirmIdentification
Trade line	Vide
Allocation line	Vide
Give-Up line	Vide

- **Rapports TMS DTMIIB**

Format Trex

Nom de champ (Field Name)	Identification
Contrepartie (Opposite Firm)	Vide
Contrepartie (Opposite Broker)	Vide

Format BSI

Nom de champ (Field Name)	Identification
Contrepartie (Opposite Firm)	Vide
Contrepartie (Opposite Broker)	Vide

Rapport d'opération quotidien (Daily Trade Report)

En vue de se conformer à la règle 6377 de la Bourse et à la règle 200 de l'OCRCVM, les participants doivent maintenir des registres de leurs opérations, y compris l'information sur la contrepartie. À cette fin, la Bourse créera un rapport d'opération de fin de journée pour chacun des participants dans lequel sera consignée l'information sur la contrepartie de chacune de leurs opérations. Les participants pourront télécharger ce rapport à partir d'un serveur FTP (*File Transfer Protocol*) sécurisé. **Veillez trouver ci-joint les caractéristiques du rapport d'opération de fin de journée (End-of-Day Report Specifications).**

La Bourse prévoit que les participants pourront accéder à leur rapport dès 6 h le jour ouvrable suivant l'exécution de leurs opérations. S'il n'y a pas d'exécution d'opération au cours d'une journée, la Bourse produira un rapport vide afin que les participants aient une trace continue de leurs activités.

Le fichier Excel ci-joint fournit un exemple du rapport d'opération quotidien (Daily Trade Report) auquel chaque participant aura accès.

Pour obtenir des renseignements sur l'accès au serveur FTP, de même que le formulaire de demande de numéro d'identification pour accéder au rapport d'opération de fin de journée, les participants doivent communiquer avec le centre d'assistance technique au 1 877 588-8489 ou à l'adresse suivante : samsupport@m-x.ca, **d'ici le 18 mars 2011.**

Environnement d'essai

Compte tenu des modifications susmentionnées, les clients qui souhaitent soumettre leurs systèmes à des tests pourront le faire dans l'environnement d'essai de la Bourse. Nous encourageons tous les participants au marché à tester leurs systèmes dans l'environnement d'essai. De cette façon, ils s'assureront d'être en mesure de les utiliser dans l'environnement de production.

Les clients peuvent tester leurs systèmes et obtenir de l'assistance technique du lundi au vendredi de 8 h (HNE) à 16 h 30 (HNE). Il sera possible d'effectuer des tests du lundi au vendredi de 16 h 30 (HNE) à 22 h 30 HNE) sans assistance technique.

Pour toutes demandes d'information supplémentaires à propos du présent avis, veuillez communiquer avec Mark Bourcier au 514 871-3581 ou à l'adresse suivante : mbourcier@m-x.ca.

Merci.

Responsable de la connectivité des participants