

DESTINATAIRES : Participants, départements de conformité et fournisseurs de la Bourse de Montréal

EXPÉDITEUR : Gestionnaire, accès au marché

OBJET : Nouveau Service - Rapports d'activité des participants (RAP)

DATE : Le 10 mars 2014

La Bourse de Montréal (la « Bourse ») planifie le lancement d'un nouveau service de production de rapports le lundi 28 avril 2014.

Les rapports d'activité des participants sont des fichiers de valeurs séparées par des virgules (format CSV) faciles à lire et à importer dans toute base de données et qui contiennent des champs prédéfinis.

Les fichiers des rapports d'activité des participants peuvent être téléchargés à partir d'un serveur FTP à la fin de chaque jour ouvrable. Faciles à intégrer à d'autres applications, ils peuvent être liés au moyen de clés primaires et secondaires afin de constituer une base de données que les participants peuvent interroger en utilisant leurs propres requêtes personnalisées.

Le service de rapports d'activité des participants s'avérera particulièrement utile aux divisions de la conformité, car il facilite à la fois le suivi de l'activité de négociation et la création de bases de données aux fins des fonctions de surveillance. Les participants peuvent aussi utiliser ces rapports pour réconcilier les ordres et les opérations qu'ils ont effectués au moyen de diverses applications. Les fournisseurs indépendants de logiciels et de données qui n'ont pas accès au dictionnaire des données de marché du service HSVF peuvent également avoir recours à ces fichiers pour obtenir une liste quotidienne des instruments actifs.

APERÇU DES RAPPORTS D'ACTIVITÉ DU PARTICIPANT

On trouvera ci-dessous une brève description des cinq fichiers.

1. **Liste des instruments** : Ce fichier fait état de tous les instruments actifs.
2. **Transactions anonymes** : Ce fichier fait état de l'activité de négociation quotidienne sur une base anonyme.
3. **Ordres ouverts de la firme** : Ce fichier fait état de tous les ordres ouverts de la firme.
4. **Activités sur les ordres de la firme** : Ce fichier fait état de l'ensemble des messages de modification de saisie d'ordre et d'annulation d'ordre de la firme.
5. **Activités post-négociation de la firme** : Ce fichier fait état des renseignements sur les opérations, les allocations et la répartition (y compris les renseignements de contrepartie).

On peut obtenir le document des caractéristiques techniques du service de rapports d'activité des participants en faisant la demande par courriel au Centre d'assistance technique (CAT), à samsupport@m-x.ca. Ce document (disponible en anglais seulement) comprend la structure détaillée de chaque fichier.

Les fichiers peuvent être télé chargés à partir d'un site FTP sécurisé. Les firmes doivent communiquer avec le CAT pour obtenir les formulaires nécessaires aux fins de la connectivité au serveur et les justificatifs pour accéder à leur répertoire FTP. La Bourse n'accordera les justificatifs d'accès au serveur qu'à la confirmation d'une connexion physique à son serveur FTP sécurisé et une fois que les formulaires de demande d'identifiant appropriés auront été remplis et présentés.

Il est à noter que la Bourse ne gèrera pas les restrictions d'accès aux rapports dans le répertoire FTP de la firme. *Tous* les utilisateurs configurés auront accès à *tous* les fichiers.

BARÈME DES DROITS DU SERVICE DE RAPPORTS D'ACTIVITÉ DES PARTICIPANTS

RAPPORT	DESCRIPTION	DROITS MENSUELS	
Liste des instruments	Tous les instruments actifs	200 \$	Le fichier de la liste des instruments sera offert gratuitement avec un abonnement à tout autre rapport RAP.
Transactions anonymes	Toutes les opérations anonymes de la journée	200 \$	
Ordres ouverts de la firme	Renseignements côté firme	200 \$	
Activités sur les ordres de la firme		200 \$	
Activités post-négociation de la firme		200 \$	
Les cinq rapports		700 \$	

UNE DISPENSE INTÉGRALE DES DROITS D'ABONNEMENT SERA ACCORDÉE JUSQU'AU 30 JUIN 2014.

ENVIRONNEMENT D'ESSAI GÉNÉRAL (GTE)

Les rapports d'activité des participants ne seront pas offerts dans l'environnement d'essai général étant donné que ce dernier ne reflète pas nécessairement l'activité de négociation d'une firme telle que dans l'environnement de production. Un échantillon des cinq fichiers pourra néanmoins être fourni gratuitement à compter de la date de mise en œuvre.

COORDONNÉES

Pour obtenir de plus amples renseignements sur le présent avis ou de l'assistance technique, veuillez communiquer avec le Centre d'assistance technique.

CENTRE D'ASSISTANCE TECHNIQUE	
Sans frais	1 877 588-8489
Appels locaux	514 871-7872
Courriel	samsupport@m-x.ca

Nous vous remercions de votre collaboration.

Gestionnaire, accès au marché