

**BOURSE DE MONTRÉAL**

# **Formulaire de rapport d'opérations avec termes spéciaux**

Guide de l'utilisateur



## TABLE DES MATIÈRES

|   |    |
|---|----|
| 1. Objet du Formulaire de rapport d'opérations avec termes spéciaux.....  | 3  |
| 2. Processus de soumission des opérations avec termes spéciaux, des opérations en bloc et des opérations BIC .....                  | 3  |
| 3. Pour commencer .....   | 3  |
| 4. Procédures relatives aux formulaires de rapport d'opérations avec termes spéciaux, d'opérations en bloc et d'opérations BIC..... | 4  |
| 4.1. Écran d'ouverture de session .....   | 4  |
| 4.2. Création d'un nouveau profil d'utilisateur .....   | 4  |
| 4.3. Modification ou désactivation des profils d'utilisateur.....   | 4  |
| 4.4. Nouvelle soumission.....   | 5  |
| 4.5. Processus à suivre pour les nouvelles soumissions.....   | 5  |
| Étape 1.....  | 6  |
| Étape 2.....  | 6  |
| Étape 2.a .....   | 6  |
| Étape 2.a.1 .....   | 7  |
| Étape 2.a.2 .....   | 7  |
| Étape 2.b.....  | 8  |
| Étape 2.b.1 .....   | 8  |
| Étape 2.b.2 .....   | 8  |
| Étape 2.b.3 .....   | 8  |
| Étape 2.b.4 .....   | 9  |
| Étape 2.c .....   | 9  |
| Étape 2.c.1 .....   | 9  |
| Étape 2.c.2 .....   | 10 |
| Étape 2.c.3 .....   | 10 |
| Étape 2.c.4 .....   | 10 |
| Étape 2.c.5 .....   | 10 |
| Étape 3.....  | 11 |
| 4.5.1 Approbation requise de la contrepartie (lorsque l'opération n'est pas une application).....                                   | 11 |
| 4.5.2 Sommaire des soumissions .....  | 11 |
| ANNEXE A.....   | 14 |

## **1. Objet du Formulaire de rapport d'opérations avec termes spéciaux**

Le portail Formulaire de rapport d'opérations avec termes spéciaux, qui inclut le Formulaire de rapport d'opérations en bloc, doit être utilisé par les participants agréés de la Bourse pour déclarer les échanges physiques pour contrats (« EFP »), les échanges d'instruments dérivés hors bourse (« EFR »), les opérations de base sans risque (« RBC »), les opérations en bloc (« BT ») et les opérations en bloc sur la base de la valeur de clôture de l'indice (« BIC ») au Service des opérations de marché (« SOM ») de la Bourse. Les formulaires, qui se trouvent à l'adresse <https://sttrf-frots.m-x.ca/> requièrent l'utilisation d'identifiants de connexion et comprennent des menus déroulants, des numéros de référence et des champs obligatoires ou facultatifs. Ces « formulaires intelligents » interactifs et conviviaux permettent de réduire au minimum le potentiel d'erreurs et de refus. Le présent document se veut un guide destiné aux utilisateurs des formulaires intelligents.

## **2. Processus de soumission des opérations avec termes spéciaux, des opérations en bloc et des opérations BIC**

Le processus de soumission comprend la saisie sur le portail des données de l'opération par son initiateur. Le formulaire identifie automatiquement l'opération comme une « application » si la « firme initiatrice » et la « firme contrepartie » sont identiques ou comme un « échange avec une autre société » si la « firme initiatrice » et la « firme contrepartie » sont différentes. Dans le cas d'une application, les renseignements sont transmis au SOM de la Bourse aux fins d'approbation. En revanche, s'il s'agit d'un « échange avec une autre société », les renseignements sur l'opération sont transmis à la société contrepartie désignée et à la personne approuvée aux fins d'examen et d'approbation. Si la contrepartie accepte l'opération, les renseignements sont alors transmis au SOM aux fins d'approbation finale. Par contre, si la contrepartie refuse l'opération, le formulaire est renvoyé à l'initiateur avec ses commentaires. L'initiateur de l'opération doit alors apporter les modifications nécessaires ou annuler l'opération. Veuillez-vous reporter à l'annexe A pour voir l'organigramme détaillé du processus de soumission.

## **3. Pour commencer**

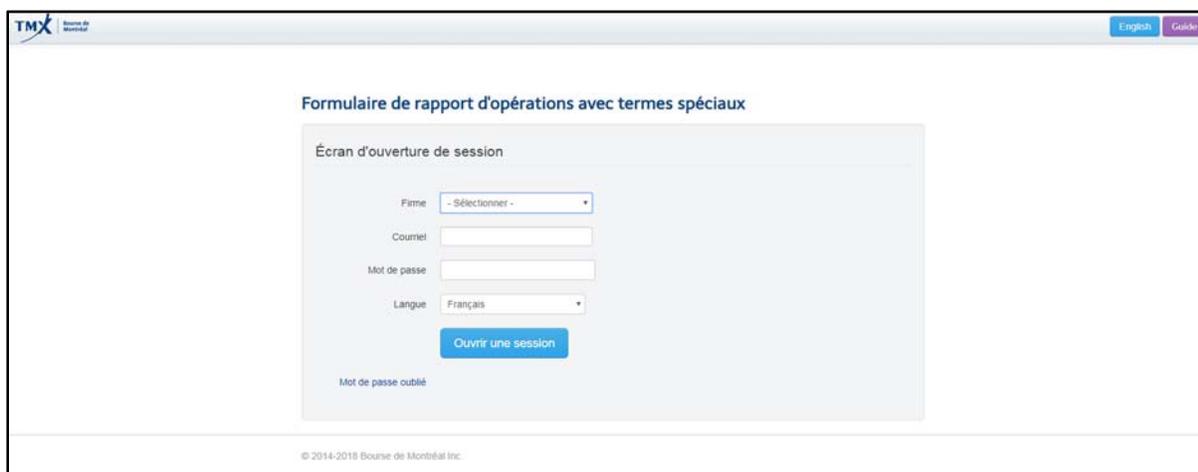
Pour accéder au portail STTRF, il faut obtenir un identifiant de connexion « administrateur » en s'adressant à la Division de la réglementation de la Bourse. Cette dernière transmet l'identifiant de connexion au chef de la conformité des participants agréés. Le chef de la conformité peut déléguer ses droits d'administrateur à la personne qu'il juge compétente. Les utilisateurs qui possèdent des droits d'administrateur peuvent créer des identifiants de connexion pour les membres de leur société. Un délégué d'une personne autorisée peut remplir et soumettre le Formulaire de rapport d'opérations avec termes spéciaux, mais toutes les opérations déclarées dans celui-ci doivent être liées à une personne autorisée du participant agréé canadien ou étranger de la Bourse. Toute personne autorisée est responsable de l'information contenue dans le formulaire soumis par l'un de ses délégués. Les questions sur les procédures relatives aux formulaires de rapport d'opérations avec termes spéciaux et de rapport d'opérations en

bloc et à la soumission de ces opérations doivent être communiquées au Service des opérations de marché de la Bourse (1 888 693-6366 ou 514 871-7871).

#### 4. Procédures relatives aux formulaires de rapport d'opérations avec termes spéciaux, d'opérations en bloc et d'opérations BIC

##### 4.1. Écran d'ouverture de session

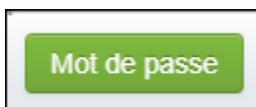
Les utilisateurs désignés peuvent avoir accès au portail STTRF et, par le biais de celui-ci, au Formulaire de rapport d'opérations en bloc, à l'aide de leur identifiant de connexion unique à l'adresse suivante : <https://sttrf-frots.m-x.ca/>



##### 4.2. Création d'un nouveau profil d'utilisateur

Seul l'administrateur du participant agréé peut créer de nouveaux profils d'utilisateur. L'identifiant de connexion de l'utilisateur doit être son adresse courriel et son mot de passe est choisi par l'administrateur à la création du profil.

Par la suite, le nouvel utilisateur peut, s'il le souhaite, réinitialiser son mot de passe lorsqu'il accède au portail à l'aide de la fonction **Mot de passe** à droite de l'écran.



##### 4.3. Modification ou désactivation des profils d'utilisateur

Au besoin, l'administrateur peut modifier les données d'inscription d'un utilisateur. Veuillez noter que l'administrateur peut aussi désactiver un identifiant de connexion (l'administrateur doit désactiver l'identifiant de tout utilisateur qui ne travaille plus pour le participant).

Les utilisateurs ont droit à trois tentatives d'ouverture de session. Après trois échecs, l'identifiant de connexion est verrouillé et ne peut être déverrouillé que par l'administrateur.

#### 4.4. Nouvelle soumission

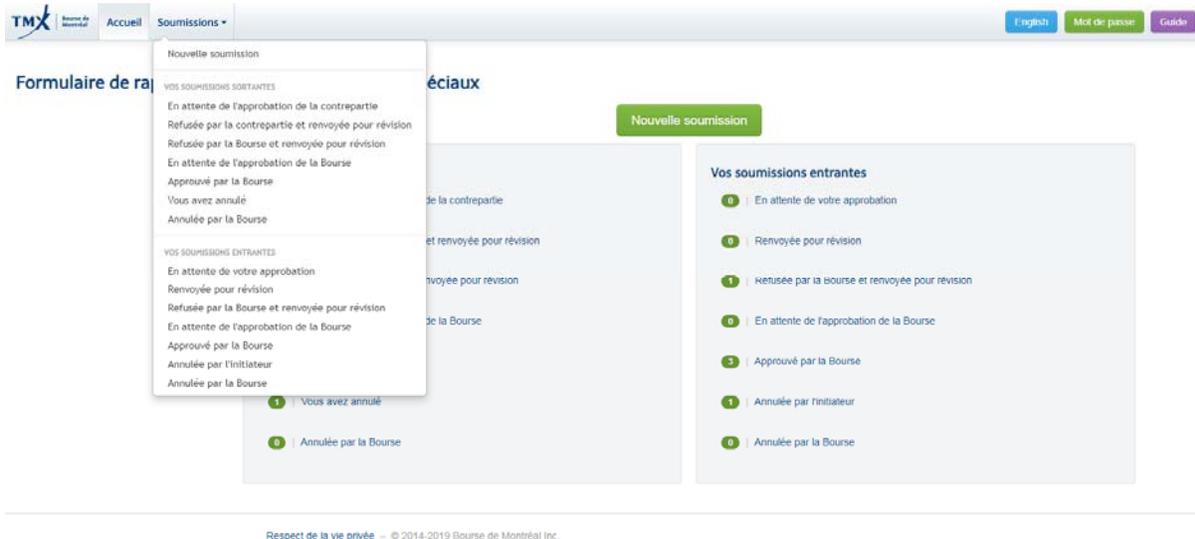
Une fois la session ouverte dans le portail STTRF, les utilisateurs peuvent déclarer de nouvelles opérations avec termes spéciaux ou accéder au Formulaire de rapport d'opérations en bloc. Pour ce faire :

- Cliquez sur Nouvelle soumission.



Ou

- Cliquez sur l'onglet **Soumissions** en haut à gauche de l'écran pour afficher le menu, puis sur **Nouvelle soumission**.



#### 4.5. Processus à suivre pour les nouvelles soumissions

La nouvelle soumission doit être remplie par une seule partie. Si l'opération n'est pas une application, les parties doivent décider de l'initiateur (la partie qui soumet les données de l'opération). L'initiateur de l'opération doit remplir le formulaire. Une fois que ce dernier est soumis, le système demande automatiquement à la contrepartie de valider les renseignements transmis par l'initiateur.

L'initiateur doit suivre les étapes suivantes :

## Étape 1

Sélectionnez le Formulaire de rapport d'opérations en bloc ou le type d'opération avec termes spéciaux dans le menu déroulant ainsi que la date et l'heure de l'opération (heure de l'Est). Le menu déroulant propose les choix suivants :

- Échange physique pour contrats (EFP)
- Échange d'instruments dérivés hors bourse pour contrats (EFR)
- Opérations de base sans risque (RBC)
- Formulaire de rapport d'opérations en bloc (BT)
- Opérations en bloc sur la base de la valeur de clôture de l'indice (BIC)

TMX Monnaie de Montréal Accueil Soumissions ▾ English Mot de passe Guide Déconnexion

Ajouter une nouvelle soumission

Pour assistance, communiquer avec le Service des opérations de marché au 514 871-7871 or 1 888 693-6366.

Type d'opération avec termes spéciaux

Sélectionner

Échange physique pour contrats (EFP)

Échange d'instruments dérivés hors bourse pour contrats (EFR)

Opérations de base sans risque (RBC)

Formulaire de rapport d'opérations en bloc (BT)

Opérations en bloc sur la base de la valeur de clôture d'un indice (BIC)

Date de la transaction et « heure de l'Est »

2019-09-18 00

J'ai lu, compris et accepté les modalités de la Politique concernant la collecte de renseignements personnels de Bourse de Montréal Inc. et je consens à la collecte, à l'utilisation et à la communication de mes renseignements personnels conformément à cette politique.

Pour les soumissions d'échange physique pour contrats (EFP), d'échange d'instruments dérivés hors bourse pour contrats (EFR) ou d'opérations de base sans risque (RBC), veuillez suivre les directives de l'étape 2.a. Pour le Formulaire de rapport d'opérations en bloc, veuillez suivre les directives de l'étape 2.b. Pour les opérations en bloc sur la base de la valeur de clôture de l'indice (BIC\*), veuillez suivre les directives de l'étape 2.c.

\* Dans ce document et sur le portail STTRF, « BIC » désigne une opération en bloc sur la base de la valeur de clôture de l'indice.

## Étape 2

### Étape 2.a

Si vous avez sélectionné EFP, EFR, ou RBC, utilisez les choix proposés dans les menus déroulants pour remplir les sections *Information de l'initiateur* et *Information de la contrepartie* avec les renseignements relatifs à l'opération avec termes spéciaux. Veuillez noter que le champ **Type d'opération** se remplit automatiquement lorsque le champ **Société contrepartie** est rempli.

Information de l'initiateur

Firme initiatrice

Type de compte

Sélectionner

Soumis au nom de

Information de la contrepartie

Firme contrepartie

Sélectionner

### Étape 2.a.1

Remplissez la section *Composante du contrat à terme* en faisant un choix dans chacun des menus déroulants et en entrant les renseignements demandés. Veuillez noter que des renseignements additionnels sont demandés lorsque le champ **Symbole** est rempli.

Composante du contrat à terme

Acheteur / Vendeur  
Sélectionner

Symbole  
Sélectionner

Quantité

Mois et année d'échéance  
Sélectionner Sélectionner

Cours du contrat à terme (sans séparateur de milliers)

### Étape 2.a.2

Remplissez la section *Composante au comptant ou instrument dérivé de gré à gré* en faisant un choix dans chacun des menus déroulants et en entrant les renseignements demandés. Veuillez noter que les renseignements demandés varient selon la composante au comptant ou l'instrument dérivé de gré à gré choisi. Les utilisateurs doivent donner le plus de renseignements possible sur la composante au comptant ou l'instrument dérivé de gré à gré (p. ex., dans le cas d'un EFP dont la composante au comptant est une obligation, l'utilisateur doit préciser l'émetteur, le coupon et la date d'échéance de l'obligation ou, dans le cas d'un EFR dont l'instrument dérivé de gré à gré est un swap de taux d'intérêt, l'utilisateur doit préciser l'échéance, la quantité et le taux).

Composante au comptant ou instrument dérivé de gré à gré

Acheteur / Vendeur  
Sélectionner

La composante au comptant ou l'instrument dérivé de gré à gré a été exécuté par  
Sélectionner

Description de la composante au comptant ou de l'instrument dérivé de gré à gré

Si l'utilisateur souhaite donner des renseignements supplémentaires sur l'opération avec termes spéciaux, il peut les inscrire dans le champ **Renseignements supplémentaires**, situé au bas de la section *Composante au comptant ou instrument dérivé de gré à gré*. Veuillez noter que les utilisateurs sont invités à donner le plus de précisions possible, puisque les soumissions pour lesquelles il manque de l'information peuvent faire l'objet d'une vérification.

Renseignements supplémentaires

## Étape 2.b

Si vous avez sélectionné le Formulaire de rapport d'opérations en bloc, remplissez le champ **Date de la transaction et « heure de l'Est »**.

TMX Bourse de Montréal Accueil Soumissions

English Mot de passe Guide

### Ajouter une nouvelle soumission

Pour assistance, communiquer avec le Service des opérations de marché au 514 871-7871 or 1 888 693-6366.

Type d'opération avec termes spéciaux  
Formulaire de rapport d'opérations en bloc (BT)

Date de la transaction et « heure de l'Est »  
2019-09-12 à :00

Type d'opération

### Étape 2.b.1

Indiquez les renseignements pertinents pour les sections *Information de l'initiateur* et *Information de la contrepartie*.

Information de l'initiateur

Firme initiatrice

Type de compte  
Sélectionner

Soumis au nom de

Information de la contrepartie

Firme contrepartie  
Sélectionner

Remarque : Pour les applications, sélectionnez votre firme en tant que contrepartie.

### Étape 2.b.2

Déterminez si l'opération en bloc sera soumise pour une option ou un contrat à terme.

Détails de l'opération en bloc

Ce formulaire doit être transmis à la Bourse avant de communiquer avec le Service des opérations de marché au 514 871-7871 or 1 888 693-6366.

| Symbole | Séries | Type | Date d'expiration | Quantité | Prix | Stratégie |
|---------|--------|------|-------------------|----------|------|-----------|
|---------|--------|------|-------------------|----------|------|-----------|

Ajouter Options + Ajouter Contrats à terme +

Renseignements supplémentaires

### Étape 2.b.3

Saisissez des renseignements précis relatifs à l'opération en bloc pour une option ou un contrat à terme

Détails de l'opération en bloc

Ce formulaire doit être transmis à la Bourse avant de communiquer avec le Service des opérations de marché au 514 871-7871 or 1 888 693-6366.

Symbole    Séries    Type    Date d'expiration    Quantité    Prix    Stratégie    Acheteur

Renseignements supplémentaires

### Étape 2.b.4

Si une deuxième patte doit être ajoutée, cliquez sur **Ajouter Options** ou **Ajouter Contrats à terme** et saisissez les renseignements pertinents.

Détails de l'opération en bloc

Ce formulaire doit être transmis à la Bourse avant de communiquer avec le Service des opérations de marché au 514 871-7871 or 1 888 693-6366.

Symbole    Séries    Type    Date d'expiration    Quantité    Prix    Stratégie    Acheteur

Renseignements supplémentaires

### Étape 2.c

Si vous avez sélectionné le Formulaire d'opérations en bloc sur la base de la valeur de clôture d'un indice (BIC), remplissez le champ **Date de la transaction et « heure de l'Est »**. Veuillez noter que pour l'exécution d'une opération BIC, vous devez soumettre deux formulaires. Le premier contient les renseignements primaires de l'opération et le second sert à terminer la demande d'opération et à confirmer le niveau de clôture, lequel est généralement diffusé à la clôture de la séance de bourse.

Ajouter une nouvelle soumission

Pour assistance, communiquer avec le Service des opérations de marché au 514 871-7871 or 1 888 693-6366.

Type d'opération avec termes spéciaux

Opérations en bloc sur la base de la valeur de clôture d'un indic

Type d'opération

Date de la transaction et « heure de l'Est »

2019-05-28 à 00

### Étape 2.c.1

Indiquez les renseignements pertinents pour les sections *Information de l'initiateur* (l'initiateur correspond à la firme qui remplit le formulaire) et *Information de la contrepartie*.

Information de l'initiateur

Firme initiatrice

Type de compte

Sélectionner

Soumis au nom de

Information de la contrepartie

Firme contrepartie

Sélectionner

Remarque : Pour les applications, sélectionnez votre firme en tant que contrepartie.

## Étape 2.c.2

Indiquez les renseignements détaillés sur l'opération BIC et vos commentaires, s'il y a lieu. Assurez-vous d'avoir lu et accepté les modalités.

La soumission initiale est maintenant réalisée.

## Étape 2.c.3

Pour soumettre le second formulaire, il est recommandé de récupérer le premier formulaire soumis pour l'opération BIC dans le portail sous « Vos soumissions sortantes ».

## Étape 2.c.4

Sélectionnez le formulaire approuvé de l'opération BIC correspondante, puis cliquez sur **Copier**.

| Numéro de référence | Destinataire     | Type d'opération   | Symbole              | Acheteur / Vendeur  | Actions   |
|---------------------|------------------|--|----------------------|---------------------|---|
| 20190828-BIC-1      | xxx.xxx@test.com | Opérations en bloc sur la base de la valeur de clôture d'un indice (BIC) | SXF (Septembre 2019) | Acheteur et Vendeur | <a href="#">Afficher</a> <a href="#">Copier</a> |
| 20190822-BIC-3      | xxx.xxx@test.com | Opérations en bloc sur la base de la valeur de clôture d'un indice (BIC) | SXF (Septembre 2019) | Acheteur et Vendeur | <a href="#">Afficher</a> <a href="#">Copier</a> |

## Étape 2.c.5

Le deuxième formulaire à soumettre doit inclure les renseignements sur la valeur de clôture de l'indice ainsi que le prix du contrat à terme correspondant à 0,01 point d'indice près. L'opération doit être déclarée au plus tôt à 16 h.

Opérations en bloc sur la base de la valeur de clôture d'un indice

Ce formulaire doit être transmis à la Bourse avant de communiquer avec le Service des opérations de marché au 514 871-7871 or 1 888 693-6366.

| Transaction             | Symbole | Contrat à terme         | Quantité | Base   | Valeur de l'indice | Prix   | Acheteur   |
|-------------------------|---------|-------------------------|----------|--------|--------------------|--------|------------|
| SXF (Sept 2019) @ -1.21 | SXF     | Septembre 2019 (SXFU19) | 120      | -1.210 | 974.34             | 970.19 | Initiateur |

Renseignements supplémentaires

J'ai lu, compris et accepté les modalités de la Politique concernant la collecte de renseignements personnels de Bourse de Montréal inc. et je consens à la collecte, à l'utilisation et à la communication de mes renseignements personnels conformément à cette politique.

### Étape 3

Confirmez ou annulez l'opération en cliquant sur l'un des deux boutons suivants :

- Enregistrer et envoyer

Ou

- Annuler

Enregistrer et envoyer    Annuler

#### 4.5.1 Approbation requise de la contrepartie (lorsque l'opération n'est pas une application)

Si le type d'opération choisi est un « Échange avec une autre société », la société contrepartie est automatiquement informée de l'opération par courriel et invitée à accéder au portail STTRF pour examiner les données de l'opération et donner son approbation. Si la contrepartie accepte l'opération avec termes spéciaux, l'opération en bloc ou l'opération BIC, la soumission est automatiquement transmise au SOM aux fins d'approbation (ou de refus). Si la contrepartie refuse l'opération avec termes spéciaux, l'opération en bloc ou l'opération BIC, elle doit préciser les raisons motivant le refus. La soumission refusée est retournée à l'initiateur pour qu'il puisse régler les problèmes soulevés par la contrepartie. À cette étape, l'initiateur peut soit annuler la soumission soit la modifier. S'il choisit de modifier la soumission, le processus d'approbation reprend, jusqu'à ce que les deux parties soient d'accord et que la demande puisse être transmise au SOM aux fins d'approbation. Si le SOM refuse la soumission, l'initiateur doit à nouveau soumettre une demande d'opération pour apporter les modifications requises, après quoi le processus d'approbation reprend du début. Veuillez noter que le « formulaire intelligent » a pour but d'accroître l'efficacité du processus d'approbation en réduisant au minimum le potentiel d'erreur de saisie.

#### 4.5.2 Sommaire des soumissions

Le sommaire des soumissions, que l'on peut voir dès que l'on accède au Formulaire de rapport d'opérations avec termes spéciaux, présente brièvement l'état des soumissions. Les champs qui se trouvent sous la section *Vos soumissions sortantes* portent sur les soumissions saisies par l'utilisateur et les champs qui se trouvent sous la section *Soumissions entrantes* portent sur les soumissions dont l'utilisateur est le destinataire (ou la contrepartie) de l'opération avec termes spéciaux.



Champs de la section Vos soumissions sortantes :

- **En attente de l'approbation de la contrepartie** : soumissions dont le type d'opération est un « Échange avec une autre société » qui ont été saisies par l'utilisateur et envoyées à la contrepartie aux fins d'approbation.
- **Refusée par la contrepartie et renvoyée pour révision** : soumissions dont le type d'opération est un « Échange avec une autre société » qui ont été saisies par l'utilisateur et envoyées à la contrepartie aux fins d'approbation, mais que la contrepartie a refusées
- **Refusée par la Bourse et renvoyée pour révision** : soumissions qui ont été refusées par la Bourse et retournées aux fins de révision.
- **En attente de l'approbation de la Bourse** : soumissions qui n'ont pas encore été approuvées par la Bourse.
- **Approuvé par la Bourse** : soumissions approuvées par la Bourse.
- **Vous avez annulé** : soumissions qui ont été annulées par l'utilisateur.
- **Annulée par la Bourse** : soumissions annulées par la Bourse



Champs de la section *Soumissions entrantes* :

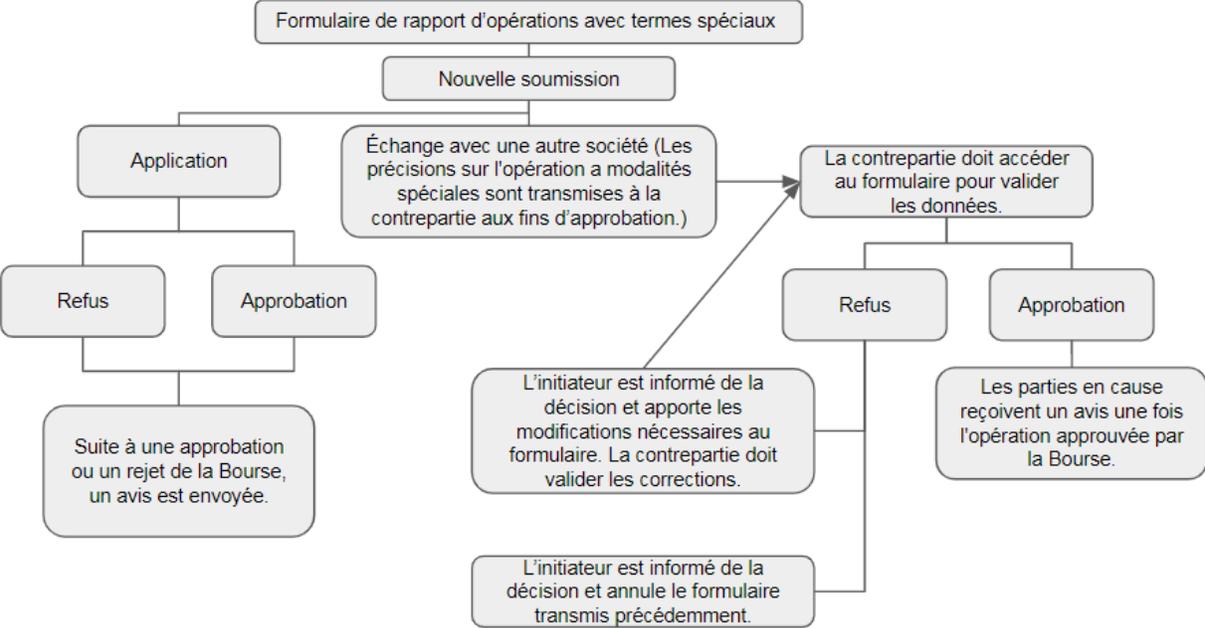
- **En attente de votre approbation** : soumissions dont le type d'opération est un « Échange avec une autre société » qui ont été envoyées par l'utilisateur aux fins d'approbation. Veuillez noter que le destinataire ne pourra modifier les renseignements de la soumission, mais qu'il pourra choisir le type de compte.
- **Renvoyée pour révision** : soumissions dont le type d'opération est un « Échange avec une autre société » qui ont été refusées par l'utilisateur et retournées à l'initiateur pour qu'il puisse apporter les corrections nécessaires.
- **Refusée par la Bourse et renvoyée pour révision** : soumissions qui ont été refusées par la Bourse et retournées aux fins de révision.
- **En attente de l'approbation de la Bourse** : soumissions qui n'ont pas encore été approuvées par la Bourse.
- **Approuvé par la Bourse** : soumissions approuvées par la Bourse.
- **Annulée par l'initiateur** : soumissions dont le type d'opération est un « Échange avec une autre société » qui ont été annulées par l'initiateur.
- **Annulé par la Bourse** : soumissions annulées par la Bourse.

Une fois que l'utilisateur a choisi l'un des éléments de la section *Vos soumissions sortantes* ou *Soumissions entrantes*, il peut voir tous les renseignements sur la soumission en cliquant sur **Afficher le détail**. S'il est l'initiateur de l'opération avec termes spéciaux et que celle-ci a été refusée par la contrepartie ou le SOM, il pourra soit modifier la soumission, soit l'annuler. Veuillez noter que les utilisateurs peuvent voir les commentaires du SOM ou de la contrepartie en cliquant sur **Afficher le détail** ou sur **Modifier**. Les utilisateurs peuvent aussi consulter le suivi chronologique de la soumission à l'écran des commentaires.

| Sortante – Renvoyée par la Bourse pour révision |                  |                                      |                     |                     |   |
|---|------------------|--------------------------------------|---------------------|---------------------|---|
| Numéro de référence                             | Destinataire     | Type d'opération                     | Symbole             | Acheteur / Vendeur  | Actions   |
| 20190912-EFP-1                                  | xxx.xxx@test.com | Échange physique pour contrats (EFP) | CGB (Décembre 2019) | Acheteur et Vendeur | <a href="#">Afficher</a> <a href="#">Modifier</a> <a href="#">Annuler</a> |

Les questions sur les procédures relatives au Formulaire de rapport d'opérations avec termes spéciaux et à la soumission des opérations avec termes spéciaux doivent être communiquées au Service des opérations de marché de la Bourse (1 888 693-6366 ou 514 871-7871).

ANNEXE A



---

## BOURSE DE MONTRÉAL

Siège social

Bourse de Montréal Inc.

1800 – 1190, avenue des Canadiens-de-Montréal

C. P. 37

Montréal (Québec) H3B 0G7

Canada

Téléphone (Montréal) : 514 871-2424

Sans frais au Canada et aux États-Unis : 1 800 361-5353

Sans frais de la Grande-Bretagne ou de la France : 00 800 36 15 35 35

Division de la réglementation

Division de la réglementation

Bourse de Montréal Inc.

1800 – 1190, avenue des Canadiens-de-Montréal

C. P. 37

Montréal (Québec) H3B 0G7

Canada

Téléphone (Montréal) : 514 787-6530

Sans frais au Canada et aux États-Unis : 1 800 361-5353, poste 46530

Sans frais de la Grande-Bretagne ou de la France : 00 800 36 15 35 35, poste 46530

Renseignements supplémentaires : [info.mxr@tmx.com](mailto:info.mxr@tmx.com)