



# **Guide du système de déclaration des opérations SEROM 2.0**

Version 1.0  
30 octobre 2014

## Historique du document

Version	Description de la modification	Date
1.0	<ul style="list-style-type: none"><li data-bbox="383 331 578 359">• Première version</li></ul>	30 octobre 2014

## Table des matières

<b>1. APERÇU .....</b>	<b>4</b>
1.1 CONTEXTE .....	4
1.2 DOCUMENTS DE RÉFÉRENCE .....	4
1.3 PUBLIC VISÉ.....	4
<b>2. SYSTÈME DE DÉCLARATION .....</b>	<b>5</b>
2.1 GÉNÉRALITÉS.....	5
2.2 OPTIONS DE TRANSMISSION .....	5
2.3 SÉCURITÉ.....	5
2.4 DISPONIBILITÉ DU SYSTÈME .....	5
2.5 BASCULEMENT.....	5
2.6 RÉOLUTION DES PROBLÈMES .....	6
<b>3. COMPTES ET AUTORISATIONS.....</b>	<b>7</b>
3.1 IDENTIFIANTS UTILISATEUR .....	7
3.2 AUTORISATIONS UTILISATEUR .....	7
3.3 RÉCUPÉRATION DES DONNÉES D'ACCÈS AU COMPTE .....	8
<b>4. GESTION DES FICHIERS .....</b>	<b>9</b>
4.1 STRUCTURE DES RÉPERTOIRES .....	9
4.2 PROTOCOLE SFTP .....	9
4.3 PORTAIL WEB.....	10
4.3.1 Connexion .....	10
4.3.2 Procédure de téléchargement manuel en amont.....	11
4.4 CONVENTION RÉGISSANT LES NOMS DE FICHIERS.....	15
4.5 TRAITEMENT DES FICHIERS .....	15
4.6 VALIDATION DES FICHIERS ET REÇUS DE FICHIERS.....	15
4.7 NON-TRANSMISSION DES FICHIERS.....	16
<b>5. ANNEXE - TABLEAUX ET FIGURES .....</b>	<b>17</b>

## 1. Aperçu

### 1.1 Contexte

La Règle 2800C instaure un cadre de travail selon lequel les courtiers membres sont tenus de déclarer les opérations sur titres de créance à l'OCRCVM au moyen du Système d'établissement de relevés des opérations sur le marché 2.0 (SEROM 2.0). Les opérations sur titres de créance exécutées par un courtier membre sur les marchés hors cote, y compris au moyen d'un système de négociation parallèle (SNP) ou par l'entremise d'un courtier intermédiaire en obligations (CIEO), doivent être déclarées à l'OCRCVM après l'opération. L'information sur les opérations déclarée conformément à la Règle 2800C permettra à l'OCRCVM de surveiller et d'encadrer la négociation sur les marchés hors cote des titres de créance.

Le présent guide décrit les spécifications du système de déclaration des opérations SEROM 2.0 (le **système de déclaration**) et comprend des renseignements sur la gestion des comptes, la connectivité et la procédure de transmission de fichiers.

### 1.2 Documents de référence

- Guide d'attestation et de gestion du changement pour le SEROM 2.0
- Déclaration d'opérations sur titres de créance – Guide de l'utilisateur de SEROM 2.0
- Avis de l'OCRCVM 14-0250 - Avis sur les règles – Déclaration d'opérations sur titres de créance

### 1.3 Public visé

Les renseignements fournis dans le présent guide intéresseront particulièrement les utilisateurs commerciaux, les analystes des systèmes de gestion, les analystes-programmeurs et les analystes de l'assurance de la qualité.

## 2. Système de déclaration

### 2.1 Généralités

Les courtiers membres ont accès à leur propre répertoire dans le système de déclaration. Ils disposent d'une fonctionnalité de téléchargement en amont et en aval pour transmettre leurs fichiers d'opérations quotidiens à l'OCRCVM, ainsi que pour récupérer les données de référence sur les identifiants pour entités et les relevés.

### 2.2 Options de transmission

Les courtiers membres disposent de deux options de transmission : par le protocole SFTP, méthode recommandée pour les courtiers membres qui recourent à un processus automatisé, ou par téléchargement manuel en amont sur le portail Web du système de déclaration.

### 2.3 Sécurité

La politique sur la sécurité de l'OCRCVM exige que la méthode de transmission des fichiers de données sur les opérations de tous les courtiers membres soit sécurisée et chiffrée. Le système de déclaration utilise le protocole SFTP pour le transfert de fichiers et le protocole HTTPS pour le portail Web. Les courriels envoyés à partir du système de déclaration passent par un canal sécurisé. Les autres facteurs de sécurité sont énumérés ci-dessous :

- La connexion SFTP utilise le port standard 22 et le tunnel SSH2. Le système de déclaration accepte l'authentification par nom d'utilisateur et mot de passe et l'authentification SSH2 par clé publique ou privée.
- Le portail Web du système de déclaration est accessible par HTTPS sur le port standard 443.
- Le système de déclaration tente toujours d'envoyer les courriels via une connexion TLS sécurisée. Si le serveur de courrier entrant n'utilise pas TLS, le courriel sera livré par le service de courriel sécurisé de l'OCRCVM<sup>1</sup> et pourra être récupéré de façon sécurisée.

### 2.4 Disponibilité du système

Le système de déclaration est accessible 24 heures sur 24, sept jours sur sept, afin de permettre la transmission des fichiers en dehors des heures normales de bureau et lorsqu'un jour férié tombe un jour différent en Ontario et dans la province du courtier membre déclarant.

Le système de déclaration principal de l'OCRCVM est situé à Brampton et un système de secours est situé à Toronto.

### 2.5 Basculement

En temps normal, seul le système principal est opérationnel. Si un basculement est nécessaire, le système de secours est activé et tous les fichiers sont acheminés automatiquement vers celui-ci. Les courtiers membres n'ont pas besoin de modifier les adresses IP de configuration pour accéder au système de secours.

---

<sup>1</sup> Echoworx « OneWorld » est un service de courriel sécurisé qui permet à l'OCRCVM d'échanger des renseignements confidentiels, personnels ou sensibles chiffrés avec les courtiers membres. Lorsque l'OCRCVM vous envoie un courriel sécurisé, vous recevez un courriel ordinaire non sécurisé vous en avisant. Ce courriel contient un lien qui donne accès à un site Web sécurisé où vous pouvez récupérer votre message. La première fois que vous recevrez un message de l'OCRCVM par OneWorld, vous devrez créer un compte. Ce compte servira pour tous les courriels que vous enverrez par la suite l'OCRCVM par OneWorld.

L'OCRCVM avise les courtiers membres et les mandataires autorisés par courriel lorsqu'un basculement a lieu.

## 2.6 Résolution des problèmes

Le courtier membre doit communiquer avec le Service des opérations de l'OCRCVM avant 14 h (HNE) pour signaler les problèmes techniques liés à la transmission d'un fichier d'opérations à l'OCRCVM par le courtier membre ou son mandataire autorisé.

Le Service des opérations de l'OCRCVM offre un soutien du lundi au vendredi de 9 h à 17 h (HNE), sauf les jours fériés. Tout problème signalé en dehors des heures normales de soutien est traité par ordre de priorité lorsque les heures normales de soutien reprennent.

Les coordonnées des groupes de soutien figurent ci-dessous :

Tableau 1 : Coordonnées

Groupe de soutien	Adresse de courriel	Numéro de téléphone
Service des opérations de l'OCRCVM	<a href="mailto:smonitoring@iiroc.ca">smonitoring@iiroc.ca</a>	416 362-4472
Surveillance des marchés des titres de créance de l'OCRCVM	<a href="mailto:Debtsurveillance@iiroc.ca">Debtsurveillance@iiroc.ca</a>	416 943-5861

### 3. Comptes et autorisations

#### 3.1 Identifiants utilisateur

Les identifiants utilisateur permettant l'accès au système de déclaration sont créés par l'OCRCVM à l'étape de l'approbation de la demande d'adhésion. Les identifiants sont envoyés par courriel sécurisé à la personne-ressource dont le nom est indiqué dans le formulaire d'adhésion au SEROM 2.0. Il appartient ensuite au courtier membre de transmettre ces identifiants à ses mandataires autorisés (le cas échéant).

Tous les identifiants sont envoyés avec des mots de passe temporaires. Les utilisateurs sont tenus de changer leur mot de passe la première fois qu'ils se connectent au portail Web pour pouvoir transmettre des fichiers à l'OCRCVM.

#### 3.2 Autorisations utilisateur

Le tableau ci-dessous précise les différents niveaux d'accès accordés aux utilisateurs.

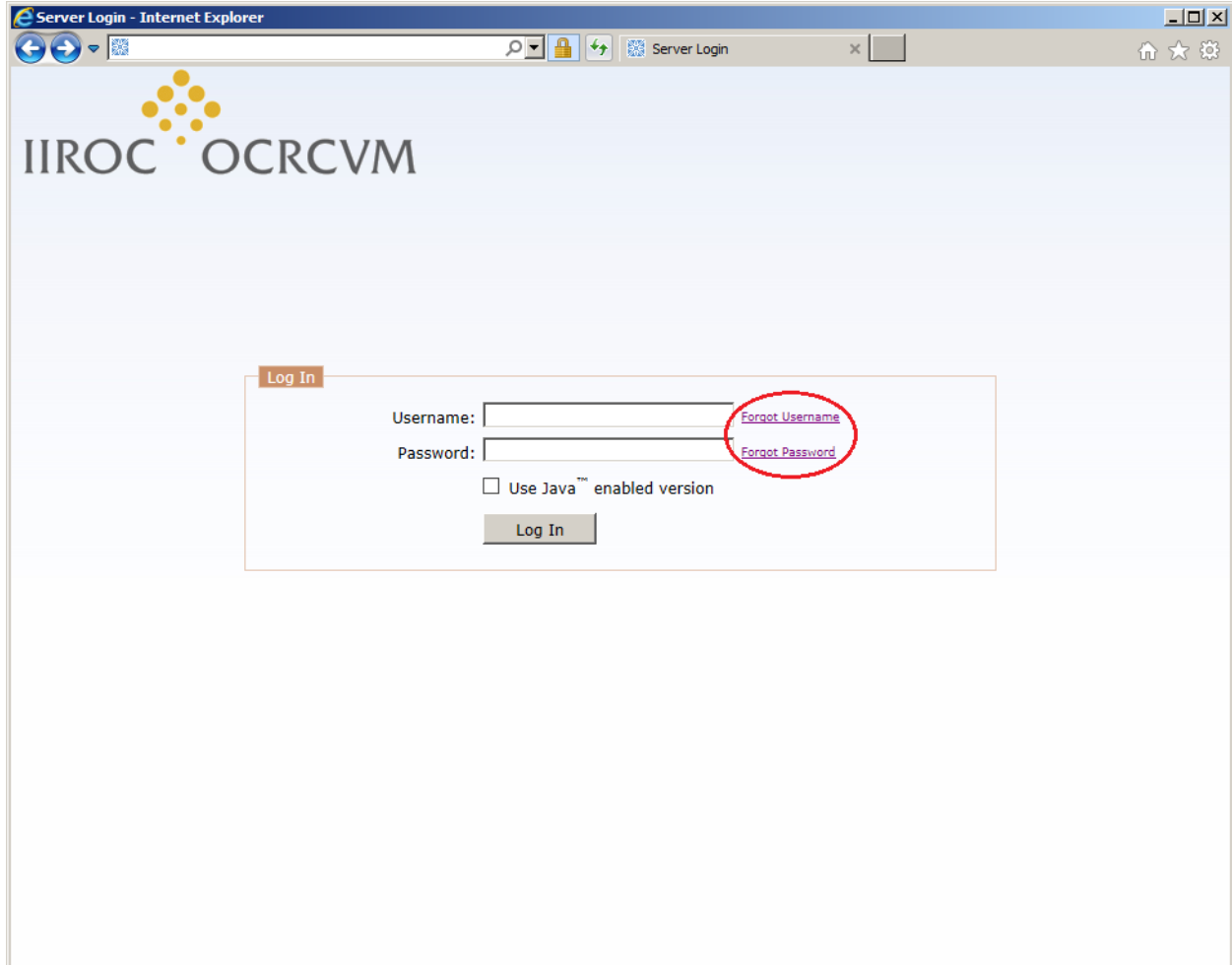
Tableau 2 : Autorisations utilisateur

Mesure	Accès au compte par le courtier	Accès par le mandataire autorisé
Téléchargement des fichiers en amont	Oui	Oui
Téléchargement des fichiers en aval	Oui Le courtier membre est responsable du téléchargement en aval des fichiers destinés à être archivés dans le système de stockage interne des données.	Non
Consultation et conservation des fichiers	Consultation des fichiers transmis sous tous les comptes d'utilisateur pour le courtier membre, y compris les fichiers transmis par les mandataires autorisés.  Le répertoire de chaque courtier membre comporte une limite de 100 Mo. Les fichiers déjà transmis (y compris ceux transmis par un mandataire autorisé) sont conservés dans le répertoire jusqu'à ce que cette limite soit atteinte; les fichiers les plus anciens sont alors supprimés pour faire de la place aux nouveaux fichiers.	Consultation des fichiers téléchargés en amont par un mandataire autorisé pour le compte du courtier membre
Données de référence sur les identifiants pour entités (LEI ou autres)	Accessibles dans le sous-répertoire « Données de référence », dans le répertoire principal du courtier membre	Accès au téléchargement en aval dans le sous-répertoire « Données de référence »
Gabarits de relevés (titres de créance et pensions sur titres) pour téléchargement manuel en amont	Accessibles dans le dossier	Non

### 3.3 Récupération des données d'accès au compte

Le courtier membre peut récupérer son nom d'utilisateur ou réinitialiser son mot de passe automatiquement sur le portail Web du système de déclaration.

Figure 1 : Récupération des données d'accès au compte





## 4. Gestion des fichiers

Le nom de domaine de l'OCRCVM dans le système de déclaration est **eft.iroc.ca**. Les sections ci-dessous expliquent la marche à suivre pour télécharger des fichiers en amont et des données de référence et des relevés en aval à l'aide des deux protocoles offerts.

Les fichiers d'opérations doivent être en format CSV et respecter des spécifications de fichiers fournies dans le document intitulé *Déclaration d'opérations sur titres de créance – Guide de l'utilisateur de SEROM 2.0*.

### 4.1 Structure des répertoires

Chaque répertoire de courtier membre créé dans le système de déclaration a la structure suivante :

Main (Répertoire principal)

    /Reference Data (Données de référence)

    /Reports (Relevés)

*Main* (Répertoire principal) – Il s'agit du répertoire de premier niveau dans lequel tous les fichiers d'opérations doivent être téléchargés en amont. Le gabarit à utiliser pour les téléchargements manuels en amont se trouve dans ce répertoire.

*Reference Data* (Données de référence) – Ce sous-répertoire contient la liste des identifiants pour entités.

*Reports* (Relevés) – Ce sous-répertoire contient les relevés propres au courtier membre.

L'accès aux répertoires est accordé en fonction des autorisations utilisateur décrites à la section 3.2.

### 4.2 Protocole SFTP

L'OCRCVM recommande aux courtiers membres d'utiliser le protocole SFTP pour lui transmettre automatiquement leurs fichiers d'opérations. Le courtier membre doit mettre en place une solution SFTP pour se connecter au système de déclaration. La solution client doit satisfaire aux critères suivants, comme indiqué à la section 2.3 :

- Connexion SFTP utilisant le tunnel SSH2
- Authentification par nom d'utilisateur et mot de passe ou par clé publique ou privée

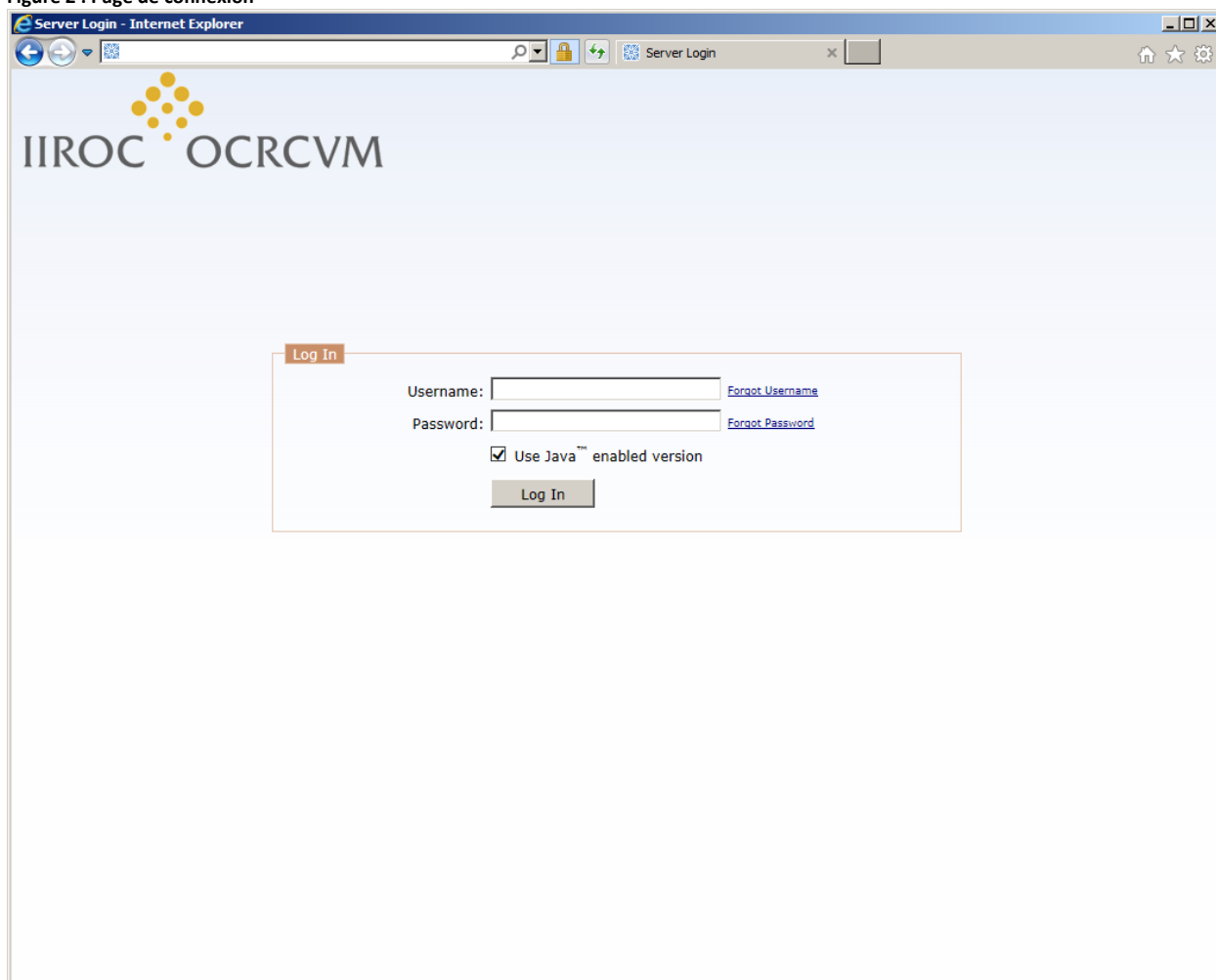
## 4.3 Portail Web

Le portail Web du système de déclaration est accessible à l'adresse <https://eft.iroc.ca>. Il offre au courtier membre une interface Web qui lui permet de gérer ses mots de passe, de télécharger ses fichiers d'opérations manuellement en amont et de télécharger les données de référence sur les identifiants pour entités et les relevés en aval.

### 4.3.1 Connexion

Assurez-vous que la case « Use Java™ enabled version » est cochée.

Figure 2 : Page de connexion



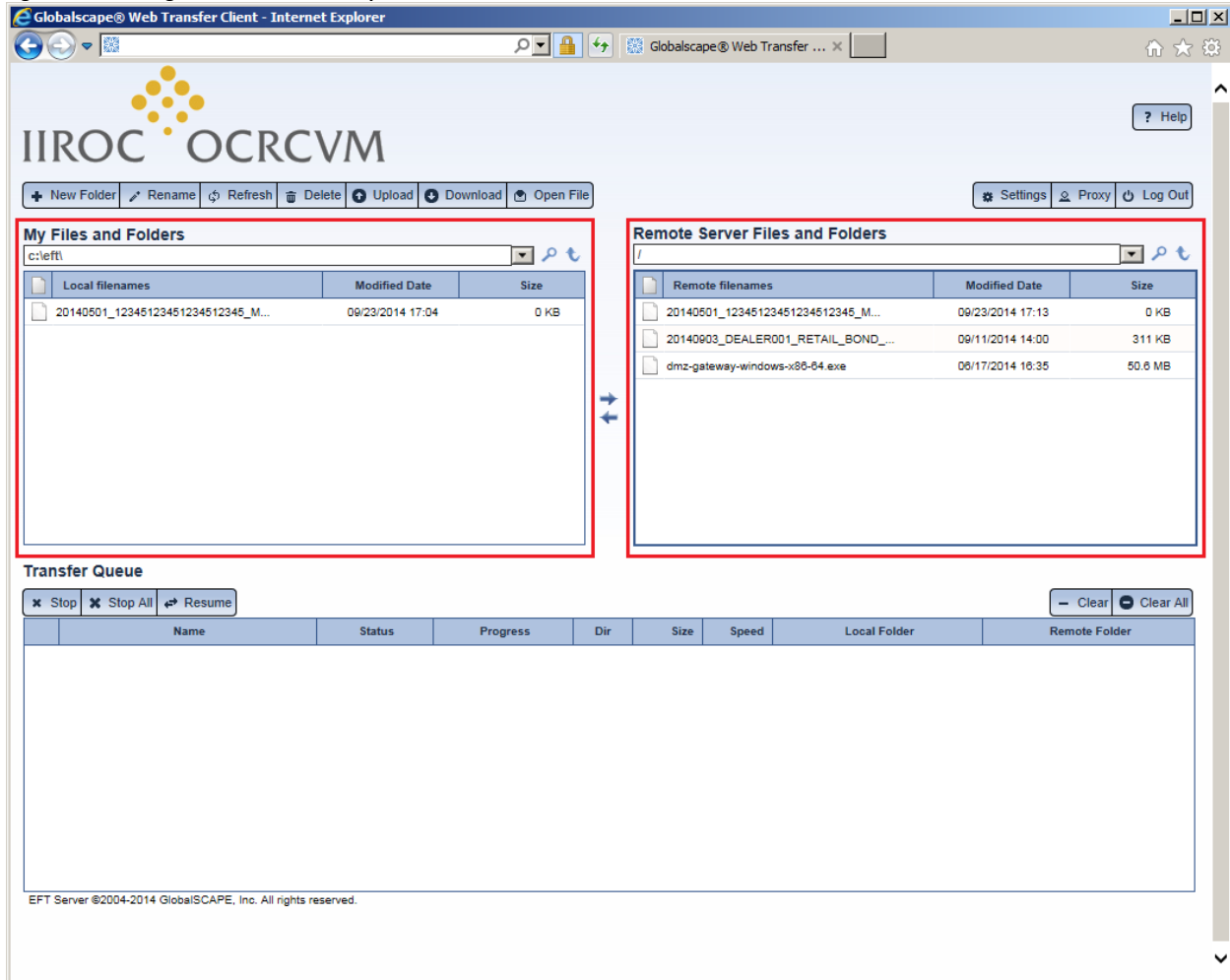
The screenshot shows a web browser window titled "Server Login - Internet Explorer". The address bar contains "Server Login". The page header displays the logo for "IIROC OCRCVM". The main content area is a login form with the following elements:

- A "Log In" label in a small box above the form.
- A "Username:" label followed by a text input field and a "Forgot Username" link.
- A "Password:" label followed by a text input field and a "Forgot Password" link.
- A checked checkbox labeled "Use Java™ enabled version".
- A "Log In" button below the checkbox.

### 4.3.2 Procédure de téléchargement manuel en amont

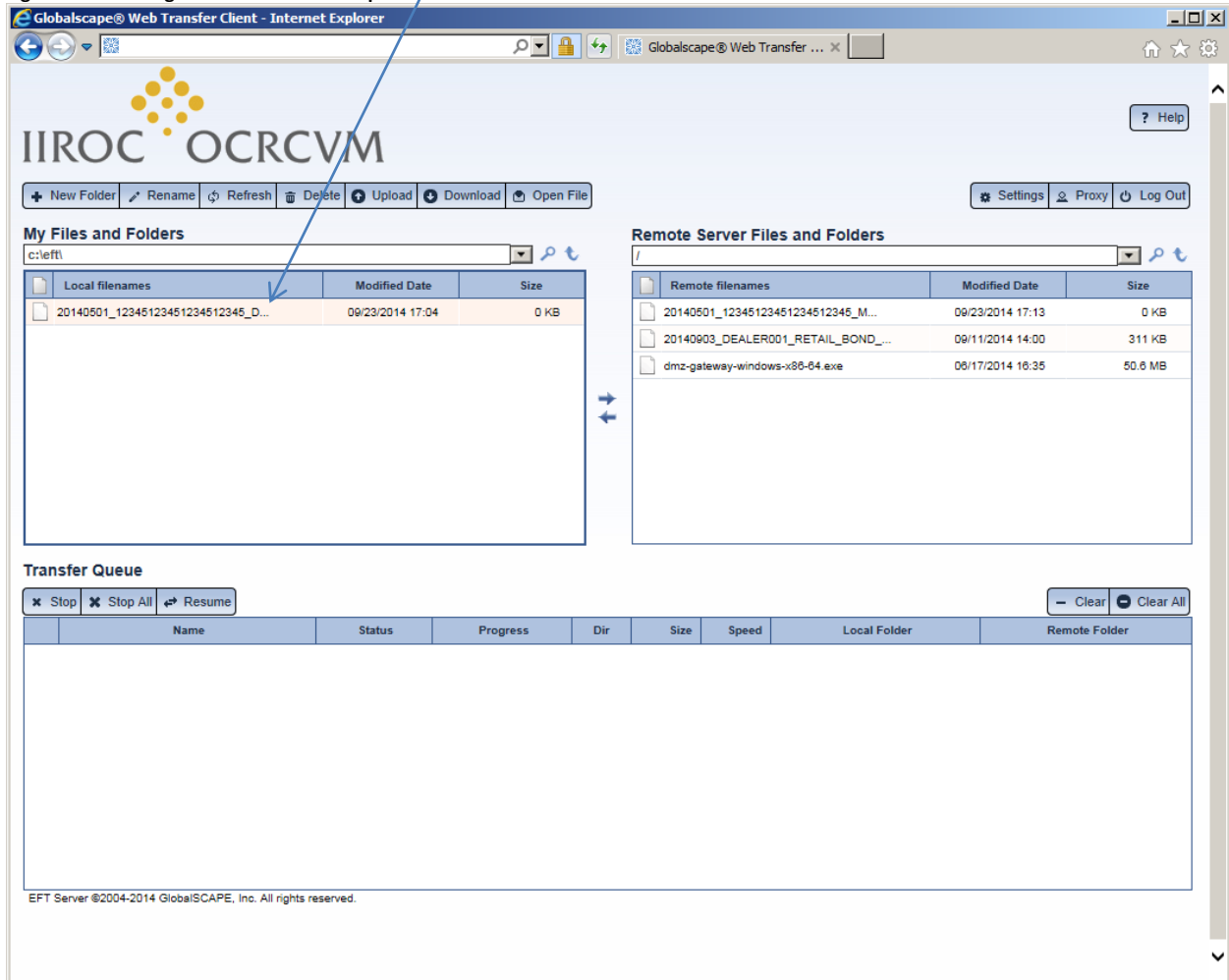
1. Allez au répertoire local dans lequel le fichier d'opérations est stocké. Assurez-vous que vous arrivez au répertoire de premier niveau dans le système de déclaration.

Figure 3 : Téléchargement en amont – Étape 1



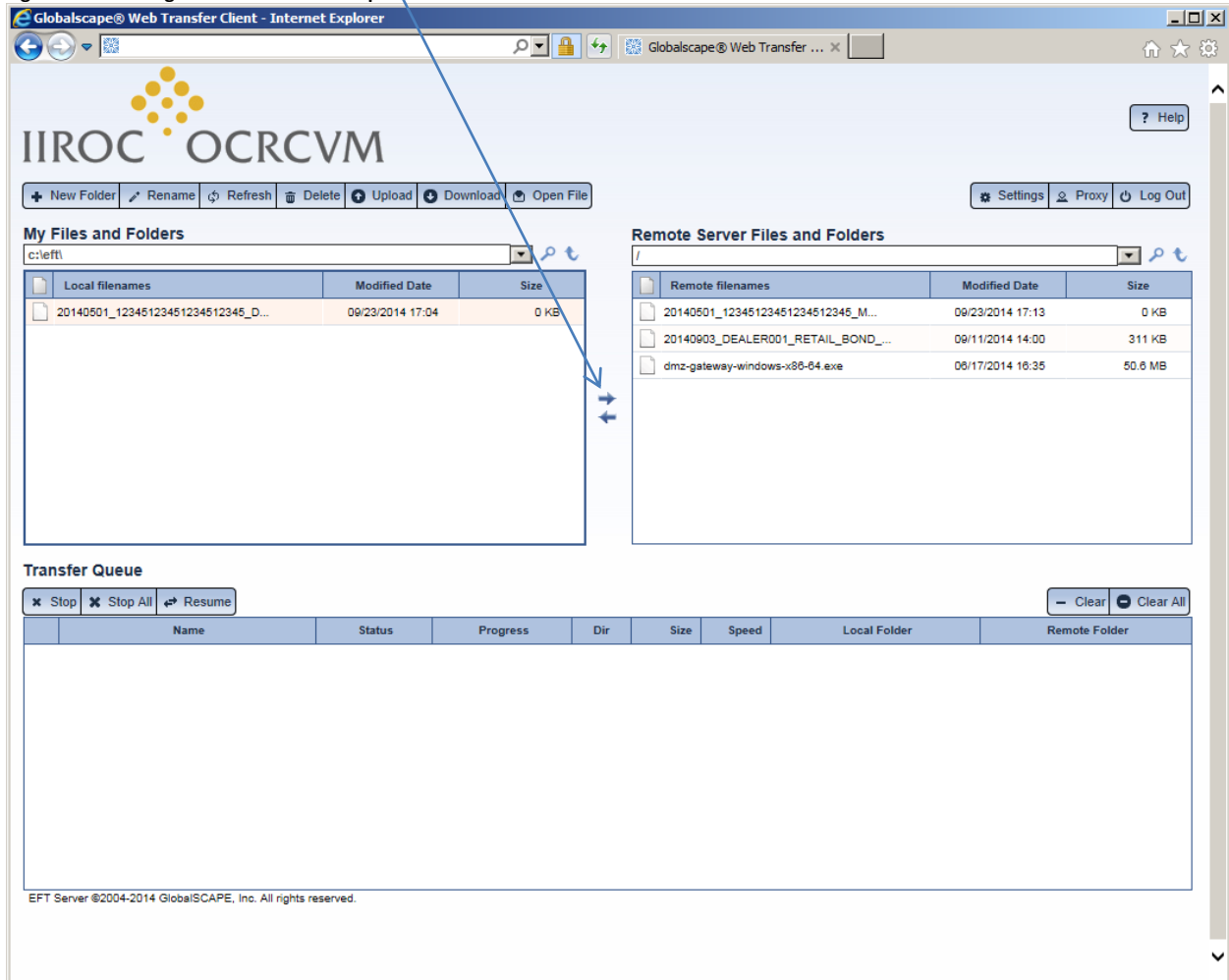
2. Choisissez le fichier à télécharger.

Figure 4 : Téléchargement en amont – Étape 2



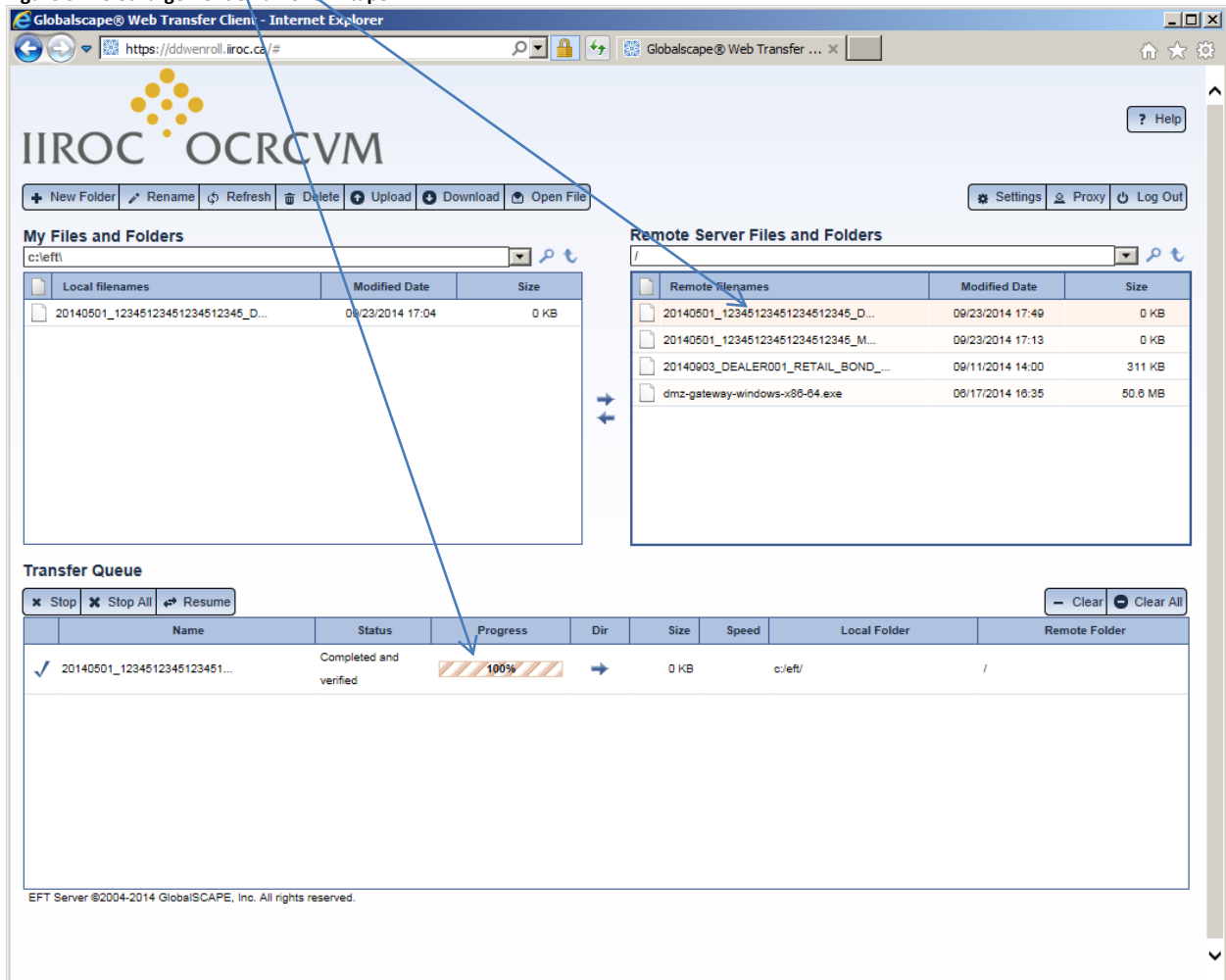
3. Cliquez sur la flèche de téléchargement en amont.

Figure 5 : Téléchargement en amont – Étape 3



- La progression du téléchargement du fichier s'affiche dans la file d'attente (Transfer Queue). Une fois le téléchargement terminé, le fichier apparaît sur le serveur.

Figure 6 : Téléchargement en amont – Étape 4



## 4.4 Convention régissant les noms de fichiers

Tous les fichiers transmis à l'OCRCVM doivent être conformes à la convention régissant les noms de fichiers ci-dessous :

Tableau 3 : Convention régissant les noms de fichiers

Jeton	Description
DATE	Format : AAAAMMJJ Date de la déclaration courante
DEALERID	Format : LEI LEI du courtier membre qui transmet le fichier
FILEID	Format : TEXTE Sert à identifier le compte d'utilisateur du courtier membre ou du mandataire autorisé (correspond aux renseignements sur le compte fournis dans le formulaire d'adhésion au SEROM 2.0)
FILE	Format : TEXTE Valeurs valides : DEBT ou REPO Sert à identifier un fichier d'opérations sur titres de créance ou d'opérations de pension sur titres. Les déclarations d'opérations sur titres de créance et d'opérations de pension sur titres doivent être envoyées dans des fichiers distincts.

Exemple : 20140501\_12345123451234512345\_DEALER1\_DEBT.csv

## 4.5 Traitement des fichiers

Les courtiers membres et leurs mandataires autorisés peuvent envoyer des versions corrigées de tout fichier jusqu'à l'expiration du délai de déclaration. Lorsqu'un courtier membre transmet plusieurs fichiers *portant le même nom*, l'OCRCVM traite uniquement le dernier fichier reçu en date de l'expiration du délai de déclaration à 14 h (HNE).

Exemples de fichiers d'opérations transmis par un courtier membre avant l'expiration du délai de déclaration :

Fichier 1 transmis à 10 h 45 : 20140501\_12345123451234512345\_MM\_DEBT.csv

Fichier 2 transmis à 13 h 20 : 20140501\_12345123451234512345\_DEALER1\_DEBT.csv

Fichier 3 transmis à 13 h 50 : 20140501\_12345123451234512345\_MM\_DEBT.csv (**écrase le fichier 1**)

Fichier 4 transmis à 13 h 55 : 20140501\_12345123451234512345\_AGENT1\_REPO.csv

Dans l'exemple ci-dessus, le fichier 1 n'est pas traité par le SEROM 2.0 car un autre fichier portant le même nom (le fichier 3) a été envoyé par la suite avant l'expiration du délai de déclaration.

## 4.6 Validation des fichiers et reçus de fichiers

Tous les fichiers d'opérations transmis par un courtier membre sont validés au moment de leur réception par l'OCRCVM. Un reçu de fichier est automatiquement envoyé aux utilisateurs à l'adresse de courriel indiquée sur le formulaire d'adhésion au SEROM 2.0. Ce reçu indique le nom du fichier, le nom de l'utilisateur, l'heure de transmission, le nombre d'opérations traitées et les résultats du processus de validation. Le courtier membre est tenu de conserver les reçus de fichiers à des fins d'audit.

Le processus de validation de fichiers consiste à vérifier les éléments suivants :

1. En-tête :

- La ligne d'en-tête contient tous les champs requis dans l'ordre prescrit.

Si cette étape échoue, le processus de validation est interrompu. Le reçu de fichier envoyé par courriel indique que l'en-tête comporte une erreur.

2. Opérations :

- Tous les champs requis sont remplis.
- Les champs requis à titre conditionnel sont correctement remplis.
- Tous les champs énumérés contiennent des valeurs valides.
- Tous les champs respectent les limites de longueur imposées.
- Les champs à longueur fixe (date/heure/CUSIP/ISIN) ont la bonne longueur.
- La date et l'heure respectent le format prescrit.
- Tous les champs contiennent les bons types de données.

Le traitement s'effectue pour chaque ligne d'opération si l'en-tête est correct. Le reçu de fichier envoyé par courriel indique les erreurs relevées dans les fichiers d'opérations.

Exemple de message de validation :

Le fichier suivant a été reçu et validé :

20140903\_DEALER001\_RETAIL\_BOND\_1.csv  
Nombre d'opérations traitées : 1 270  
Nombre d'erreurs : 4

Ligne 2 :  
Le champ [SECURITY\_ID] : 'SECURITY500' est trop court.  
Le champ [SECURITY\_ID\_TYPE] : 0 ne contient pas une des deux valeurs suivantes : [1, 2]

Ligne 3 :  
Le champ [SECURITY\_ID] : 'SECURITY37591' est trop long.

Ligne 1 271 :  
Le champ [CAPACITY] : 'B' ne contient pas une des deux valeurs suivantes : ['1', '2']

## 4.7 Non-transmission des fichiers

Si le courtier membre ne reçoit pas de reçu de fichier par courriel immédiatement après avoir téléchargé un fichier en amont, cela signifie que le téléchargement a échoué. Il pourra télécharger à nouveau le fichier en amont en tout temps avant l'heure limite, soit 14 h. En cas de problèmes liés au réseau, les courtiers membres sont invités à communiquer avec le Service des opérations de l'OCRCVM (se reporter aux coordonnées figurant à la section 2.6).



## 5. Annexe - Tableaux et figures

TABLEAU 1 : COORDONNÉES.....	6
TABLEAU 2 : AUTORISATIONS UTILISATEUR .....	7
TABLEAU 3 : CONVENTION RÉGISSANT LES NOMS DE FICHIERS .....	15
FIGURE 1 : RÉCUPÉRATION DES DONNÉES D'ACCÈS AU COMPTE .....	8
FIGURE 2 : PAGE DE CONNEXION .....	10
FIGURE 3 : TÉLÉCHARGEMENT EN AMONT – ÉTAPE 1.....	11
FIGURE 4 : TÉLÉCHARGEMENT EN AMONT – ÉTAPE 2.....	12
FIGURE 5 : TÉLÉCHARGEMENT EN AMONT – ÉTAPE 3.....	13
FIGURE 6 : TÉLÉCHARGEMENT EN AMONT – ÉTAPE 4.....	14