



Guide du système de déclaration des opérations SEROM 2.0

Version 3.0
18 juillet 2023

Historique du document

Version	Description de la modification	Date
1.0	<ul style="list-style-type: none"> Première version 	23 septembre 2014
1.1	<ul style="list-style-type: none"> Ajout du Guide d'adhésion et d'attestation à titre de référence Mise à jour des coordonnées des groupes de soutien Mise à jour de la section Sécurité grâce à l'ajout de renseignements sur l'authentification SSH2 par clé et les courriels sécurisés Mise à jour de l'adresse courriel des opérations de l'OCRCVM Mise à jour des renseignements sur les identifiants utilisateur Mise à jour du tableau Autorisations utilisateur Mise à jour de la procédure de téléchargement manuel en amont et des captures d'écran Mise à jour de la structure des répertoires 	20 août 2015
1.2	<ul style="list-style-type: none"> Modification de la durée de l'accessibilité du système dans la section Accessibilité du système 	19 octobre 2015
1.3	<ul style="list-style-type: none"> Modification de la durée de l'accessibilité du système dans la section Accessibilité du système Mise à jour des règles visant à nommer les fichiers dans la section Convention régissant les noms de fichiers Ajout de tableaux sur les règles de validation à la section Validation Ajout de la section Reçu de fichier 	12 avril 2016
1.4	<ul style="list-style-type: none"> Ajout de la section Formulaire de déclaration des opérations Mise à jour des règles dans la section Validation 	28 octobre 2016
1.5	<ul style="list-style-type: none"> Ajout de la figure sur la confirmation de la transmission 	31 octobre 2016
1.6	<ul style="list-style-type: none"> Ajout des erreurs ou des refus en raison de code en double (4.7 et 4.10) 	12 avril 2017
1.7	<ul style="list-style-type: none"> Ajout d'un nouveau champ pour les opérations de pension sur titres Ajout de nouvelles valeurs pour les opérations de pension sur titres Mise à jour des valeurs du champ REPO_MAT_DATE 	22 mai 2019
1.8	<ul style="list-style-type: none"> Mise à jour des valeurs des champs CUSTOMER_LEI et CUSTOMER_ACCOUNT_ID pour la validation des opérations sur titres de créance et des opérations de pension sur titres Modification des valeurs du champ REPO_MAT_DATE pour en faciliter la lecture 	18 juin 2019
1.9	<ul style="list-style-type: none"> Mise à jour des valeurs du champ CUSTOMER_LEI et CUSTOMER_ACCOUNT_ID pour la validation des opérations sur titres de créance et des opérations de pension sur titres 	21 juin 2019
2.0	<ul style="list-style-type: none"> Mise à jour des valeurs dans le champ REPO_MAT_DATE pour tenir compte d'un besoin professionnel 	24 juin 2019

Version	Description de la modification	Date
2.1	<ul style="list-style-type: none"> Mise à jour des exigences pour les champs REPO_CSI_TYPE et REPO_CSIP_ID 	27 août 2019
2.2	<ul style="list-style-type: none"> Mise à jour de la vérification du valideur pour les champs TRADE_ID, ORIGINAL_TRADE_ID, COUNTERPARTY_ID, PRICE (pour les opérations sur titres de créance et les opérations de pension sur titres), QUANTITY (pour les opérations sur titres de créance et les opérations de pension sur titres), YIELD, REPO_AGREEMENT_ID, ORIGINAL_REPO_ID, CLEARING HOUSE et REPO_HAIRCUT 	26 septembre 2019
2.3	<ul style="list-style-type: none"> Mise à jour des sections 4.6 et 4.9 concernant le délai de déclaration Mise à jour de la section 2.4 et correction des erreurs de frappe 	22 juin 2020
2.4	<ul style="list-style-type: none"> Remplacement des termes « courtier », « courtier membre » et « partie déclarante » par le terme « entité déclarante » dans tout le document pour tenir compte des participants qui ne sont pas des courtiers membres de l'OCRCVM 	8 mars 2021
2.5	<ul style="list-style-type: none"> Section 4.7 mise à jour avec les dernières règles de validation 	8 juin 2021
2.6	<ul style="list-style-type: none"> Changer la Règle 2800C en Règle 7200 compte tenu du nouveau livre de règles 	8 décembre 2021
2.7	<ul style="list-style-type: none"> Retrait du formulaire Web comme option de déclaration Mise à jour de l'information sur le système principal et le système de secours Mise à jour de la méthode d'authentification – clé seulement Mise à jour du délai de conservation des fichiers – 90 jours 	1 ^{er} mai 2023
3.0	<ul style="list-style-type: none"> Mise à jour du document pour tenir compte du changement de dénomination (OCRCVM remplacé par OCRI) en vigueur dès le 1^{er} juin 2023 Ajout de la section 3.4 sur la politique concernant les mots de passe Mise à jour de la section 4.5 concernant le traitement des fichiers Mise à jour de la vérification du valideur pour le champ PRICE Mise à jour de la vérification du valideur pour le champ CUSTOMER_LEI 	18 juillet 2023

Table des matières

Historique du document	2
1. APERÇU	5
1.1 DÉCLARATION D'OPÉRATIONS SUR TITRES DE CRÉANCE PAR LES COURTIER MEMBRES AUX TERMES DE LA RÈGLE 7200 DES RÈGLES CPPC	5
1.2 DÉCLARATION DES OPÉRATIONS SUR TITRES DE CRÉANCE PAR LES ENTITÉS ASSUJETTIES À LA PARTIE 8 DU RÈGLEMENT 21-101	5
1.3 UTILISATION DU TERME « ENTITÉ DÉCLARANTE »	5
1.4 DOCUMENTS CONNEXES	6
1.5 PUBLIC VISÉ	6
2. SYSTÈME DE DÉCLARATION	7
2.1 GÉNÉRALITÉS	7
2.2 OPTIONS DE TRANSMISSION	7
2.3 SÉCURITÉ	7
2.4 ACCESSIBILITÉ DU SYSTÈME	7
2.5 DÉPANNAGE INFORMATIQUE	8
3. COMPTES ET AUTORISATIONS	9
3.1 IDENTIFIANTS UTILISATEUR	9
3.2 AUTORISATIONS UTILISATEUR	9
3.3 RÉCUPÉRATION DES DONNÉES D'ACCÈS AU COMPTE	10
3.4 POLITIQUE CONCERNANT LES MOTS DE PASSE	10
4. GESTION DES FICHIERS	12
4.1 STRUCTURE DES RÉPERTOIRES	12
4.2 PROTOCOLE SFTP	12
4.3 PORTAIL WEB	13
4.3.1 CONNEXION	13
4.3.2 PROCÉDURE DE TÉLÉCHARGEMENT MANUEL EN AMONT	14
4.4 CONVENTION RÉGISSANT LES NOMS DE FICHIERS	17
4.5 TRAITEMENT DES FICHIERS	18
4.6 VALIDATION	19
4.7 REÇU DE FICHIER	25
4.8 NON-TRANSMISSION DES FICHIERS	25
4.9 COURRIEL D'ERREUR DE CHARGEMENT DES DONNÉES	26
5. ANNEXE - TABLEAUX ET FIGURES	28

1. Aperçu

1.1 Déclaration d'opérations sur titres de créance par les courtiers membres aux termes de la Règle 7200 des Règles CPPC¹

La Règle 7200 des Règles CPPC établit un cadre de travail selon lequel les courtiers membres sont tenus de déclarer les opérations sur titres de créance à l'OCRI 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'OCRI après l'opération. L'information sur les opérations déclarée conformément à la Règle 7200 permettra à l'OCRI de surveiller et d'encadrer la négociation sur les marchés hors cote des titres de créance.

1.2 Déclaration des opérations sur titres de créance par les entités assujetties à la partie 8 du Règlement 21-101²

Le 4 juin 2020, les Autorités canadiennes en valeurs mobilières (ACVM) ont annoncé des règles de transparence de l'information après les opérations sur les titres de créance publics et l'extension de la transparence des opérations sur les titres de créance privés. Elles ont aussi confirmé leur décision d'étendre le mandat de l'OCRCVM en lui permettant d'agir en tant qu'agence chargée du traitement de l'information sur les titres de créance publics, en plus d'agir comme agence de traitement de l'information pour les titres de créance privés.

La première phase a débuté le 31 août 2020 par la publication sur le site Web de l'information après les opérations sur les titres de créance publics exécutées par les courtiers, les intermédiaires en obligations entre courtiers et les marchés assujettis à la Règle 7200 des courtiers membres de l'OCRCVM (maintenant la Règle 7200 des Règles CPPC) et les banques qui déclarent déjà leurs opérations sur les titres de créance privés et publics, et de l'information après les opérations sur les titres de créance privés. La deuxième phase a débuté le 31 mai 2021, exigeant la publication de l'information sur les opérations sur titres de créance privés et publics exécutées par les banques de l'annexe I, II ou III de la *Loi sur les banques* (Canada) qui ne déclaraient pas leurs opérations à l'OCRCVM (entités déclarantes des agences de traitement de l'information).

Les opérations de pension sur titres n'ont pas à être déclarées aux termes du Règlement 21-101. Bien que leur déclaration soit nécessaire en vertu de la Règle 7200 des Règles CPPC, seuls les distributeurs de titres d'État et les entités spécifiquement désignées par la Banque du Canada sont tenus de le faire.

1.3 Utilisation du terme « entité déclarante »

¹ Règles visant les courtiers en placement et règles partiellement consolidées (ocri.ca)

² Avis de publication des ACVM : Règles de transparence de l'information après les opérations sur les titres de créance publics, et extension de la transparence des opérations sur les titres de créance privés – *Règlement modifiant le Règlement 21-101 sur le fonctionnement du marché* et modification de l'instruction générale connexe, 4 juin 2020

Le terme « entité déclarante » ou « entités déclarantes » dans le présent document se rapporte aux courtiers membres, aux courtiers non membres et aux entités déclarantes des agences de traitement de l'information qui doivent déclarer des opérations sur titres de créance à l'OCRI et qui sont définis ci-dessus. Tous les cas qui ne s'appliquent pas aux courtiers non membres seront indiqués comme tels.

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

1.4 Documents connexes

- [Déclaration d'opérations sur titres de créance – Guide de l'utilisateur du SEROM 2.0](#)
- [Adhésion des courtiers membres au SEROM 2.0](#)
- [Adhésion des entités déclarantes au SEROM 2.0](#)

1.5 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 entités déclarantes ont accès à leur propre répertoire dans le système de déclaration des opérations SEROM 2.0. Elles disposent d'une fonctionnalité de téléchargement en amont et en aval pour transmettre leurs fichiers d'opérations quotidiens, ainsi que pour récupérer les données de référence sur les identifiants pour entités et les relevés.

2.2 Options de transmission

Les entités déclarantes disposent de deux options de transmission : par le protocole SFTP, méthode recommandée pour les entités déclarantes qui recourent à un processus automatisé, ou par téléchargement manuel en amont sur le portail Web du système de déclaration des opérations SEROM 2.0.

2.3 Sécurité

Toutes les données relatives aux opérations des entités déclarantes sont classées « secrètes » en vertu de la Politique de classification des renseignements de l'OCRI. Cette politique exige que la méthode de transmission des fichiers soit sécurisée et chiffrée. Le système de déclaration des opérations SEROM 2.0 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.

- La connexion SFTP utilise le port standard 22 et le tunnel SSH2. Le système de déclaration accepte l'authentification SSH2 par clé publique ou privée. L'entité déclarante devra envoyer sa clé publique à l'OCRI.
- Le portail Web du système de déclaration est accessible par HTTPS sur le port standard 443.
- Les courriels envoyés à partir du système de déclaration seront livrés au moyen de la plateforme EchoWorx et pourront être récupérés de façon sécurisée.

2.4 Accessibilité du système

Le système de déclaration des opérations SEROM 2.0 est accessible 24 heures sur 24, sept jours sur sept, sauf lors des périodes de maintenance prévues qui seront communiquées aux entités déclarantes en temps opportun. Veuillez prendre note que les règles de validation continuent de s'appliquer à la transmission des fichiers, plus particulièrement les règles visant à nommer les fichiers décrites dans la section 4.4.

Le système de déclaration principal de l'OCRI se trouve dans la plateforme Azure du Centre, et le système de reprise après sinistre se trouve dans la plateforme Azure de l'Est. 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 entités déclarantes n'ont pas besoin de modifier les adresses IP de configuration pour accéder au système de secours. L'OCRI avise les entités déclarantes et les mandataires autorisés lorsqu'un basculement a lieu.

2.5 Dépannage informatique

L'entité déclarante doit communiquer avec la Surveillance des marchés des titres de créance de l'OCRI pour signaler les problèmes techniques liés à la transmission de fichiers d'opérations à l'OCRI par elle-même ou son mandataire autorisé. L'entité déclarante doit aussi doit communiquer avec la Surveillance des marchés des titres de créance de l'OCRI pour signaler des changements dans les renseignements concernant l'adhésion ou la transmission tardive d'un fichier d'opérations pour quelque raison que ce soit.

Du soutien est offert du lundi au vendredi de 8 h à 17 h (HE), 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
Surveillance des marchés des titres de créance de l'OCRI	Debtsurveillance@ciro.ca	416 943-5861
Marc Poles, chef de la surveillance des opérations sur titres de créance	mpoles@ciro.ca	416 943-6984
Rick Brown, directeur de la surveillance des marchés des titres de créance	rbrown@ciro.ca	416 646-7251

3. Comptes et autorisations

3.1 Identifiants utilisateur

Il sera question des exigences relatives au compte de l'entité déclarante et des mandataires autorisés lors de l'appel entre l'assurance de la qualité de l'OCRI et l'entité déclarante à la suite de la réception de sa demande d'adhésion. Les identifiants du compte de production seront envoyés une fois l'attestation de l'OCRI effectuée.

3.2 Autorisations utilisateur

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

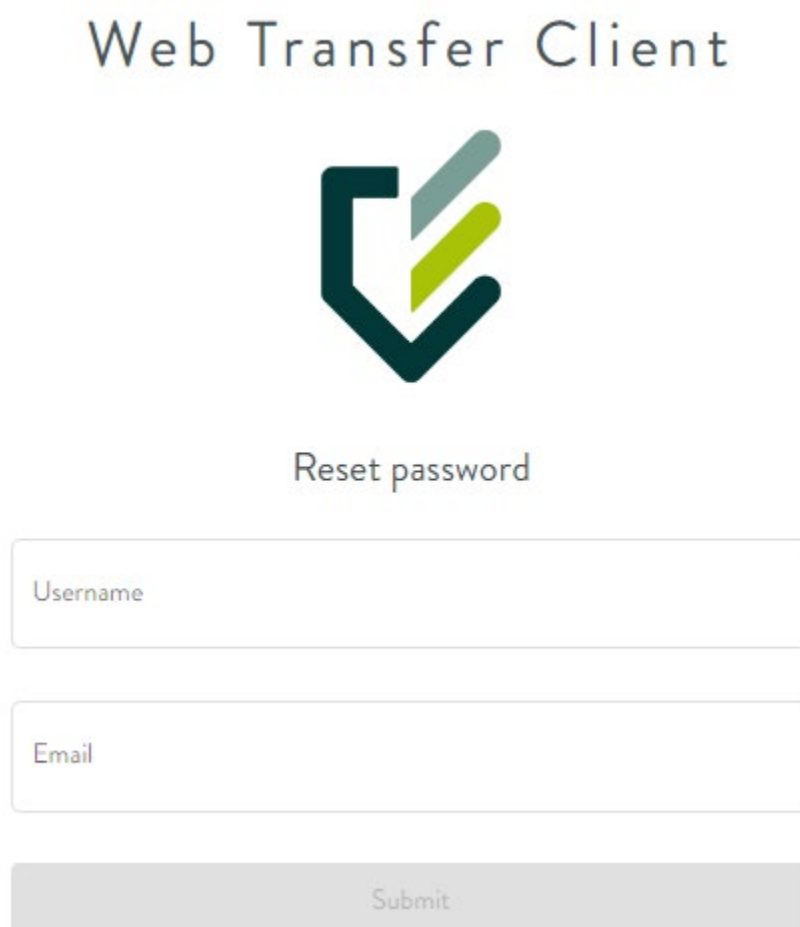
Tableau 2 : Autorisations utilisateur

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 L'entité déclarante 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 l'entité déclarante, y compris les fichiers transmis par les mandataires autorisés. Les fichiers (y compris ceux transmis par un mandataire autorisé) sont conservés dans le répertoire pendant 90 jours. Chaque semaine, l'OCRI supprime les fichiers de plus de 90 jours.	Consultation des fichiers téléchargés en amont par un mandataire autorisé pour le compte de l'entité déclarante
Données de référence sur les identifiants pour entités (LEI ou autres)	Accessibles dans le sous-répertoire « Données de référence », dans le répertoire principal de l'entité déclarante	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 sous-répertoire « Données de référence », dans le répertoire principal de l'entité déclarante	Accessibles dans le sous-répertoire « Données de référence », dans le répertoire principal de l'entité déclarante

3.3 Récupération des données d'accès au compte

L'entité déclarante peut récupérer son nom d'utilisateur ou réinitialiser son mot de passe automatiquement sur le portail Web du système de déclaration des opérations SEROM 2.0. Il n'est pas nécessaire de communiquer avec l'OCRI pour effectuer ces tâches.

Figure 1 : Récupération des données d'accès au compte



The image shows a web interface for the 'Web Transfer Client'. At the top, the title 'Web Transfer Client' is displayed in a large, light blue font. Below the title is a logo consisting of a dark teal shield-like shape with a stylized 'W' inside, and two diagonal bars (one light blue, one yellow) crossing over it. Underneath the logo, the text 'Reset password' is centered in a medium-sized, light blue font. Below this text are two input fields: the first is labeled 'Username' and the second is labeled 'Email', both in a light blue font. At the bottom of the form is a wide, light gray button labeled 'Submit' in a light blue font.

3.4 Politique concernant les mots de passe

Complexité du mot de passe

- Longueur maximale du mot de passe : 8 caractères
- Il doit comprendre au moins une lettre majuscule, une lettre minuscule, un caractère numérique (0 à 9) et un caractère non alphanumérique (p. ex., !, #, \$, %).
- Il ne doit pas contenir 3 caractères (ou plus) correspondant à l'identifiant utilisateur.
- Il ne doit pas contenir 3 caractères identiques (ou plus).

Sécurité – Ouverture de session

- Le compte sera désactivé après dix tentatives infructueuses d'ouverture de session (mot de passe erroné) au cours d'une période de 60 minutes.
- Si son compte est désactivé, l'utilisateur doit envoyer un courriel à l'adresse debtsurveillance@IIROC.CA pour demander la réinitialisation de son mot de passe.

Expiration du mot de passe

- Tout mot de passe expire après 90 jours (la même politique s'applique au mot de passe initial).
- Un courriel automatisé est envoyé à l'utilisateur cinq jours avant l'expiration du mot de passe.
- Un courriel automatisé est envoyé à l'utilisateur à l'expiration du mot de passe.

4. Gestion des fichiers

Le nom de domaine de l'OCRI dans le système de déclaration des opérations SEROM 2.0 est **eft.iiroc.ca**. Les sections ci-dessous expliquent la marche à suivre pour télécharger des fichiers d'opérations en amont ainsi que 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 fournies dans le document intitulé *Déclaration d'opérations sur titres de créance – Guide de l'utilisateur du SEROM 2.0*.

4.1 Structure des répertoires

Chaque répertoire de l'entité déclarante créé dans le système de déclaration des opérations SEROM 2.0 a la structure suivante :

Main (Répertoire principal)

/Reference Data (Données de référence)

/Reports (Relevés)

/Agents (Mandataires)

/AgentX (Mandataire X)

Main (Répertoire principal)	Il s'agit du répertoire de premier niveau dans lequel tous les fichiers d'opérations doivent être téléchargés en amont.
Reference Data (Données de référence)	Ce sous-répertoire contient la liste des identifiants pour entités. Le gabarit à utiliser pour les téléchargements manuels en amont se trouve dans ce répertoire.
Reports (Relevés)	Ce sous-répertoire contient les relevés des 90 derniers jours propres à l'entité déclarante.
Agents (Mandataires)	Ce sous-répertoire contient les dossiers de tous les mandataires autorisés. Chacun d'eux aura son propre dossier, et les fichiers transmis par les mandataires s'y trouveront.

L'accès aux répertoires variera en fonction des autorisations utilisateur mentionnées à la section 3.2.

4.2 Protocole SFTP

Il est recommandé aux entités déclarantes d'utiliser le protocole SFTP pour transmettre automatiquement leurs fichiers d'opérations. L'entité déclarante doit mettre en place une solution SFTP pour se connecter au système de déclaration des opérations SEROM 2.0. La solution client doit satisfaire aux critères suivants, comme il est indiqué à la section 2.3 :

- Connexion SFTP utilisant le tunnel SSH2;
- Authentification par clé publique ou privée. L'entité déclarante doit envoyer sa clé publique à l'OCRI.

4.3 Portail Web

Le portail Web du système de déclaration des opérations SEROM 2.0 est accessible à l'adresse <https://eft.iiroc.ca>. Il offre à l'entité déclarante une interface Web qui lui permet de gérer ses mots de passe, de télécharger ses fichiers manuellement en amont et de télécharger les données de référence sur les identifiants pour entités et les relevés en aval.

4.3.1 Connexion

Figure 2 : Page de connexion



Log in

 **CIRO · OCRI**
Canadian Investment
Regulatory
Organization Organisme canadien
de réglementation
des investissements

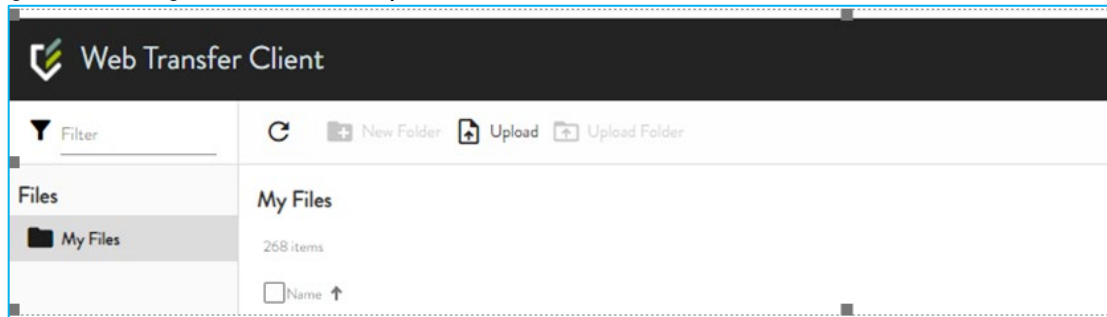
Username: [Forgot Username](#)

Password: [Forgot Password](#)

4.3.2 Procédure de téléchargement manuel en amont

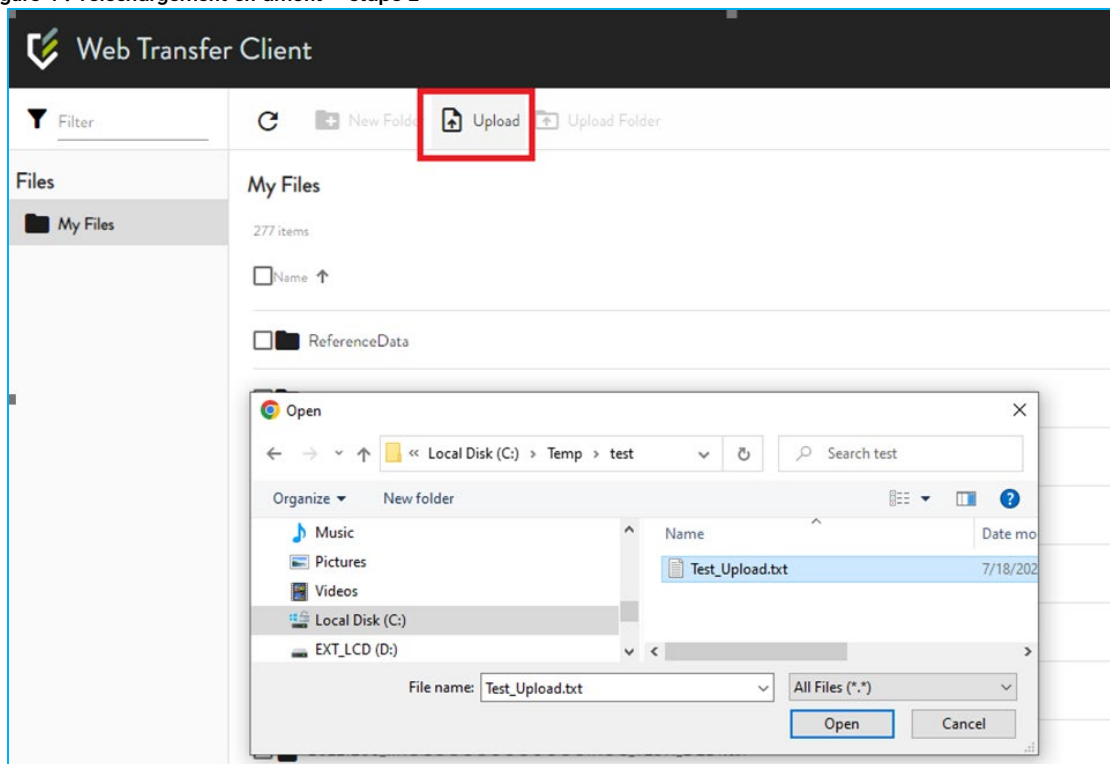
1. Écran principal du portail. Assurez-vous d'accéder au répertoire de premier niveau.

Figure 3 : Téléchargement en amont – étape 1



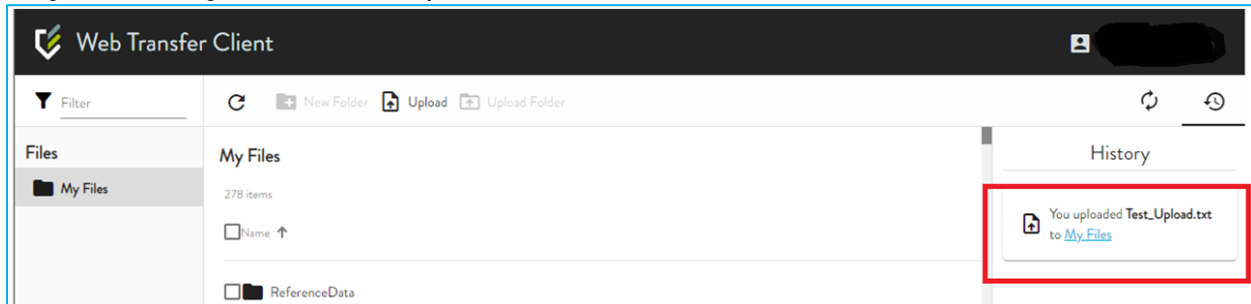
2. Cliquez sur l'icône de téléchargement en amont (*File Upload*) pour accéder à l'explorateur de fichiers. Sélectionnez votre fichier et cliquez sur « Open ».

Figure 4 : Téléchargement en amont – étape 2



3. Vous devriez voir le fichier s'afficher dans le dossier une fois le téléchargement en amont terminé. Vous devriez aussi le voir sous « Upload Manager » à droite.

Figure 5 : Téléchargement en amont – étape 3



4.4 Convention régissant les noms de fichiers

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

Tableau 3 : Convention régissant les noms de fichiers

Jeton	Description
DATE	<p>Format : AAAAMMJJ</p> <p>Date de la déclaration</p> <p>La date doit tomber un jour de semaine (les journées fériées durant la semaine sont autorisées).</p> <p>Si un fichier est transmis après 22 h (HE), la date entrée doit être celle du jour de semaine suivant.</p> <p>Si un fichier est transmis durant la fin de semaine, la date entrée doit être celle du jour de semaine suivant.</p>
DEALERID	<p>Format : LEI</p> <p>LEI de l'entité déclarante qui transmet le fichier</p>
FILEID	<p>Format : TEXTE</p> <p>Sert à désigner le compte d'utilisateur de l'entité déclarante ou du mandataire autorisé (c.-à-d. le nom du bureau, le nom du mandataire, le nom d'identifiant dans SEROM)</p>
FILE	<p>Format : TEXTE</p> <p>Valeurs valides : DEBT ou REPO</p> <p>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.</p>

Exemple : 20140501_12345123451234512345_DEALER1_DEBT.csv

4.5 Traitement des fichiers

Les entités déclarantes et leurs mandataires autorisés peuvent envoyer des versions corrigées de fichiers d'opérations **portant le même nom** – le nouveau fichier remplacera le fichier précédent du jour en question. Lorsqu'une entité déclarante transmet plusieurs fichiers portant le même nom, l'OCRI traite uniquement le dernier fichier reçu en date de l'expiration du délai de déclaration à 22 h (HE).

Exemples de fichiers d'opérations transmis par une entité déclarante avant l'expiration du délai de déclaration :

Fichier 1 transmis à 10 h 45 : 20140501_12345123451234512345_TOR1_DEBT.csv

Fichier 2 transmis à 13 h 20 : 20140501_12345123451234512345_TOR2_DEBT.csv

Fichier 3 transmis à 15 h 50 : 20140501_12345123451234512345_TOR1_DEBT.csv (**remplace le fichier 1**)

Fichier 4 transmis à 20 h 10 : 20140501_12345123451234512345_TOR1_DEBT.csv (**remplace le fichier 3**)

Dans l'exemple ci-dessus, les fichiers 2 et 4 seraient traités par le SEROM 2.0.

Remarque : Si une entité déclarante supprime un fichier, celui-ci sera uniquement retiré du portail Web et du dossier du courtier, mais demeurera dans le dossier de traitement de l'opération du valideur. Les fichiers enregistrés dans le dossier de traitement de l'opération seront utilisés pour vérifier toute soumission de fichier subséquente (ayant un code différent) et repérer les codes en double. Si une entité déclarante doit supprimer un fichier, elle peut soumettre une version révisée (portant le même nom) ne comportant aucune opération – seulement un en-tête. Ensuite, elle peut soumettre un nouveau fichier d'opérations (portant le même nom) sans générer de message d'erreur lié aux codes en double.

4.6 Validation

Tous les fichiers d'opérations transmis par une entité déclarante sont validés au moment de leur réception par l'OCRI.

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 doivent être 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 qui l'exigent (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. Les reçus de fichier indiquent les erreurs relevées dans les fichiers d'opérations.

Tableau 4 : Vérification des champs des opérations sur titres de créance

Domaine	Requis	Vérification du valideur
SECURITY_ID	R	<p>Si la valeur dans le champ SECURITY_ID_TYPE = 1 (numéro CUSIP) :</p> <ul style="list-style-type: none"> - Le champ doit contenir 9 caractères. - Il doit s'agir de caractères ASCII imprimables (0x20 - 0x7E), moins la virgule. - Le chiffre de contrôle doit être valide. - Le premier et le deuxième caractère ne doivent pas être une lettre. <p>Si la valeur dans le champ SECURITY_ID_TYPE = 2 (code ISIN) :</p> <ul style="list-style-type: none"> - Le champ doit contenir 12 caractères. - Les caractères doivent être alphanumériques. - Le chiffre de contrôle doit être valide.
SECURITY_ID_TYPE	R	La valeur doit être 1 ou 2.

Domaine	Requis	Vérification du valideur
TRADE_ID	R	<p>Les 8 premiers caractères doivent représenter la date (AAAAMMJJ).</p> <ul style="list-style-type: none"> - La date doit être antérieure ou égale à la date de la déclaration. <p>Si la valeur dans le champ TRANS_TYPE = 0 (nouveau)</p> <ul style="list-style-type: none"> - La date doit être égale à celle dans le champ EXECUTION_DATE. <p>Les 22 caractères suivants (maximum) doivent être des caractères ASCII imprimables (0x20 - 0x7E), moins la virgule.</p>
ORIG_TRADE_ID	RC	<p>Les 8 premiers caractères doivent représenter la date (AAAAMMJJ).</p> <p>Les 22 caractères suivants (maximum) doivent être des caractères ASCII imprimables (0x20 - 0x7E), moins la virgule.</p> <p>Le champ doit être vide si la valeur dans le champ TRANS_TYPE = 0 (nouveau).</p> <p>Le champ doit être rempli si la valeur dans le champ TRANS_TYPE = 1 (annulation), 2 (correction).</p> <p>La valeur dans ce champ ne peut être la même que celle dans le champ TRADE_ID.</p>
TRANS_TYPE	R	La valeur doit être 0 (nouveau), 1 (annulation) ou 2 (correction).
EXECUTION_DATE	R	<p>Les caractères doivent représenter la date (AAAAMMJJ).</p> <p>La date doit être antérieure ou égale à la date de la déclaration.</p>
EXECUTION_TIME	R	Les caractères doivent représenter l'heure (HH:MM:SS).
SETTLEMENT_DATE	R	<p>Les caractères doivent représenter la date (AAAAMMJJ).</p> <p>Si la valeur dans le champ TRANS_TYPE= 0 (nouveau)</p> <ul style="list-style-type: none"> - La date doit être égale ou postérieure à celle dans le champ EXECUTION_DATE.
TRADER_ID	R	Le champ doit contenir un maximum de 30 caractères ASCII imprimables, sans virgule.
REPORTING DEALER_ID	R	<p>Les caractères doivent être alphanumériques.</p> <p>Le champ doit contenir 20 caractères.</p> <p>La valeur doit figurer sur la liste des entités.</p>
COUNTERPARTY_TYPE	R	La valeur doit être 1, 2, 3, 4, 5, 6 ou 7.

Domaine	Requis	Vérification du valideur
COUNTERPARTY_ID	RC	<p>Le champ doit contenir un maximum de 20 caractères alphanumériques.</p> <p>La valeur dans le champ doit être différente de celle dans le champ REPORTING_DEALER_ID.</p> <p>Si la valeur dans le champ COUNTERPARTY_TYPE = 1 (client), 2 (non-client)</p> <ul style="list-style-type: none"> - Le champ doit être vide. <p>Si la valeur dans le champ COUNTERPARTY_TYPE = 3 (courtier), 4 (CIEO), 5 (SNP), 6 (banque)</p> <ul style="list-style-type: none"> - La valeur doit figurer sur la liste des entités. - La valeur doit correspondre au type d'entité dans la liste des entités. <p>Si la valeur dans le champ COUNTERPARTY_TYPE = 7 (émetteur)</p> <ul style="list-style-type: none"> - Les caractères (entre 1 et 20) doivent être des caractères ASCII imprimables, sans virgule.
CUSTOMER_ACC_TYPE	RC	La valeur doit être 1 (client de détail) ou 2 (client institutionnel) si la valeur dans le champ COUNTERPARTY_TYPE = 1 (client) ou 2 (non-client).
CUSTOMER_LEI	RC	<p>Si la valeur dans le champ COUNTERPARTY_TYPE = 1 (client) ou 2 (non-client)</p> <ul style="list-style-type: none"> - Ce champ et/ou le champ CUSTOMER_ACCOUNT_ID doivent être remplis. - Il doit contenir 20 caractères alphanumériques. - Le statut ne doit pas être actif sur la liste des entités. <p>Si la valeur dans le champ COUNTERPARTY_TYPE = 3 (courtier), 4 (CIEO), 5 (SNP), 6 (banque), 7 (émetteur)</p> <ul style="list-style-type: none"> - Le champ est facultatif. <p>S'il n'est pas vide, il doit contenir 20 caractères alphanumériques.</p>
CUSTOMER_ACCOUNT_ID	RC	<p>Si la valeur dans le champ COUNTERPARTY_TYPE = 1 (client), 2 (non-client)</p> <ul style="list-style-type: none"> - Ce champ et/ou le champ CUSTOMER_LEI doivent être remplis. - Ces champs doivent contenir un maximum de 30 caractères ASCII imprimables, sans virgule. <p>Si la valeur dans le champ COUNTERPARTY_TYPE = 3 (courtier), 4 (CIEO), 5 (SNP), 6 (banque), 7 (émetteur)</p> <ul style="list-style-type: none"> - Le champ est facultatif. - S'il n'est pas vide, il doit contenir un maximum de 30 caractères ASCII imprimables, sans virgule.
INTROD_CARRY	R	La valeur doit être 1 (remisier), 2 (chargé de comptes) ou 3 (S. O.).
ELECTRONIC_EXECUTION	R	La valeur doit être Y, y, N ou n.
TRADING_VENUE_ID	RC	<p>Si la valeur dans le champ ELECTRONIC_EXECUTION = Y ou y</p> <ul style="list-style-type: none"> - Il doit contenir 20 caractères alphanumériques. - La valeur doit figurer sur la liste des entités. - Le type dans la liste des entités doit être « courtier membre ou SNP » ou « CIEO ».
SIDE	R	La valeur doit être 1 (achat) ou 2 (vente).
QUANTITY	R	>=0.01
PRICE	R	<p>La valeur doit être égale ou supérieure à 0.001 et égale ou inférieure à 1999.9999999999</p> <p>[4 chiffres].[10 chiffres]</p>

Domaine	Requis	Vérification du valideur
BENCHMARK_SEC_ID	RC	<p>Le champ doit contenir des caractères ASCII imprimables, sans virgule.</p> <p>Si le champ BENCHMARK_SEC_ID_TYPE est vide</p> <ul style="list-style-type: none"> - Ce champ doit être vide. <p>Si la valeur dans le champ BENCHMARK_SEC_ID_TYPE = 1 (numéro CUSIP) :</p> <ul style="list-style-type: none"> - Le champ doit contenir 9 caractères. - Les caractères doivent être des caractères ASCII imprimables (0x20 - 0x7E), moins la virgule. - Le chiffre de contrôle doit être valide. <p>Si la valeur dans le champ BENCHMARK_SEC_ID_TYPE = 2 (code ISIN) :</p> <ul style="list-style-type: none"> - Le champ doit contenir 12 caractères. - Les caractères doivent être alphanumériques. - Le chiffre de contrôle doit être valide.
BENCHMARK_SEC_ID_TYPE	RC	La valeur doit être 1 (numéro CUSIP), 2 (code ISIN), ou le champ doit être vide.
YIELD	R	La valeur doit être inférieure à 10 000. [4 chiffres].[10 chiffres]
COMMISSION	RC	La valeur doit être supérieure à 0.
CAPACITY	R	La valeur doit être 1 (mandataire) ou 2 (contrepartiste).
PRIMARY_MARKET	R	La valeur doit être Y, y, N ou n.
RELATED_PTY	R	La valeur doit être Y, y, N ou n.
NON_RESIDENT	R	La valeur doit être Y, y, N ou n.
FEE_BASED_ACCOUNT	R	La valeur doit être Y, y, N ou n.

Tableau 5 : Vérification des champs des opérations de pension sur titres

Colonne 1	Requis	Vérification du valideur
REPO_AGREEMENT_ID	R	<p>Les 8 premiers caractères doivent représenter la date (AAAAMMJJ).</p> <ul style="list-style-type: none"> - La date doit être antérieure ou égale à la date de la déclaration. <p>Si la valeur dans le champ TRANS_TYPE = 0 (nouveau)</p> <ul style="list-style-type: none"> - La date doit être égale à celle dans le champ AGREEMENT_DATE. <p>Les 22 caractères suivants (maximum) doivent être des caractères ASCII imprimables (0x20 - 0x7E), moins la virgule.</p>

Colonne 1	Requis	Vérification du valideur
ORIG_REPO_ID	RC	<p>Les 8 premiers caractères doivent représenter la date (AAAAMMJJ).</p> <p>Les 22 caractères suivants (maximum) doivent être des caractères ASCII imprimables (0x20 - 0x7E), moins la virgule.</p> <p>La valeur ne peut pas être égale à la valeur dans le champ REPO_AGREEMENT_ID.</p> <p>Si la valeur dans le champ TRANS_TYPE = 0 (nouveau)</p> <ul style="list-style-type: none"> - Le champ doit être vide. <p>Si la valeur dans le champ TRANS_TYPE = 1, 2, 3, 4 (annulation, correction, modification, échec)</p> <ul style="list-style-type: none"> - Le champ doit être rempli.
TRANS_TYPE	R	La valeur doit être 0, 1, 2, 3 ou 4.
AGREEMENT_DATE	R	<p>Les caractères doivent représenter la date (AAAAMMJJ).</p> <p>La date doit être antérieure ou égale à la date de la déclaration.</p>
AGREEMENT_TIME	R	Les caractères doivent représenter l'heure (HH:MM:SS).
CLEARING_HOUSE	RC	Le champ peut contenir une suite de 20 caractères alphanumériques ou peut être vide.
TRADER_ID	R	Le champ doit contenir un maximum de 30 caractères ASCII imprimables, sans virgule.
REPO_TYPE	R	La valeur doit être 1, 2, 3 ou 4.
REPO_TERM	R	La valeur doit être 1, 2, 3 ou 4.
REPO_MAT_DATE	RC	<p>Si la valeur dans le champ REPO_TERM = 1 (durée fixe) ou REPO_TERM = 4 (prorogeable)</p> <ul style="list-style-type: none"> - Les caractères doivent représenter la date (AAAAMMJJ). <p>Si la valeur dans le champ TRANS_TYPE = 0 (nouveau)</p> <ul style="list-style-type: none"> - La date doit être postérieure à la date dans le champ SETTLEMENT_DATE. <p>Si la valeur dans le champ REPO_TERM = 2 (durée ouverte) ou REPO_TERM = 3 (ouverte) et que la valeur dans le champ TRANS_TYPE = 0</p> <ul style="list-style-type: none"> - Le champ doit être vide. <p>Si la valeur dans le champ REPO_TERM = 2 (durée ouverte) ou REPO_TERM = 3 (ouverte) et que la valeur dans le champ TRANS_TYPE = 1, 2, 3 ou 4</p> <ul style="list-style-type: none"> - Le champ peut être vide.
SETTLEMENT_DATE	R	<p>Les caractères doivent représenter la date (AAAAMMJJ).</p> <p>Si la valeur dans le champ TRANS_TYPE = 0 (nouveau)</p> <ul style="list-style-type: none"> - La date doit être égale ou postérieure à la date dans le champ AGREEMENT_DATE.
REPORTING DEALER_ID	R	<p>Le champ doit contenir 20 caractères alphanumériques.</p> <p>La valeur doit figurer sur la liste des entités.</p>
COUNTERPARTY_TYPE	R	La valeur doit être 1, 2, 3, 4, 5 ou 6.

Colonne 1	Requis	Vérification du valideur
COUNTERPARTY_ID	RC	<p>Le champ doit contenir un maximum de 20 caractères alphanumériques.</p> <p>La valeur doit être différente de celle figurant dans le champ REPORTING_DEALER_ID.</p> <p>Si la valeur dans le champ COUNTERPARTY_TYPE = 1 (client) ou 2 (non-client)</p> <ul style="list-style-type: none"> - Le champ doit être vide. <p>Si la valeur dans le champ COUNTERPARTY_TYPE = 3 (courtier)</p> <ul style="list-style-type: none"> - La valeur doit figurer sur la liste des entités. - Le type sur la liste des entités doit être « courtier membre ». <p>Si la valeur dans le champ COUNTERPARTY_TYPE = 4 (CIEO)</p> <ul style="list-style-type: none"> - La valeur doit figurer sur la liste des entités. - Le type sur la liste des entités doit être « CIEO ». <p>Si la valeur dans le champ COUNTERPARTY_TYPE = 5 (SNP)</p> <ul style="list-style-type: none"> - La valeur doit figurer sur la liste des entités. - Le type sur la liste des entités doit être « courtier membre ou SNP ». <p>Si la valeur dans le champ COUNTERPARTY_TYPE = 6 (banque)</p> <ul style="list-style-type: none"> - La valeur doit figurer sur la liste des entités. - Le type sur la liste des entités doit être « banque de l'annexe I » ou « banque de l'annexe II ».
CUSTOMER_ACC_TYPE	RC	La valeur doit être 1 (client de détail) ou 2 (client institutionnel) si la valeur dans le champ COUNTERPARTY_TYPE = 1 (client) ou 2 (non-client).
CUSTOMER_LEI	RC	<p>Si la valeur dans le champ COUNTERPARTY_TYPE = 1 (client) ou 2 (non-client)</p> <ul style="list-style-type: none"> - Ce champ et/ou le champ CUSTOMER_ACCOUNT_ID doivent être remplis. - Ils doivent contenir 20 caractères alphanumériques. - Le statut ne doit pas être actif sur la liste des entités du courtier. <p>Si la valeur dans le champ COUNTERPARTY_TYPE = 3 (courtier), 4 (CIEO), 5 (SNP), 6 (banque), 7 (émetteur)</p> <ul style="list-style-type: none"> - Le champ est facultatif. - S'il n'est pas vide, il doit contenir 20 caractères alphanumériques.
CUSTOMER_ACCOUNT_ID	RC	<p>Si la valeur dans le champ COUNTERPARTY_TYPE = 1 (client) ou 2 (non-client)</p> <ul style="list-style-type: none"> - Ce champ et/ou le champ CUSTOMER_LEI doivent être remplis. - Ils doivent contenir un maximum de 30 caractères ASCII imprimables, sans virgule. <p>Si la valeur dans le champ COUNTERPARTY_TYPE = 3 (courtier), 4 (CIEO), 5 (SNP), 6 (banque), 7 (émetteur)</p> <ul style="list-style-type: none"> - Le champ est facultatif. - S'il n'est pas vide, il doit contenir un maximum de 30 caractères ASCII imprimables, sans virgule.
ELECTRONIC_EXECUTION	R	La valeur doit être Y, y, N ou n.
TRADING_VENUE_ID	RC	<p>Si la valeur dans le champ ELECTRONIC_EXECUTION = Y ou y</p> <ul style="list-style-type: none"> - Le champ doit contenir 20 caractères alphanumériques. - La valeur doit figurer sur la liste des entités. - Le type sur la liste des entités doit être « courtier membre ou SNP » ou « CIEO ».
QUANTITY	R	>=0.01
PRICE	RC	<p>La valeur doit être égale ou supérieure à 0.001 et égale ou inférieure à 1999.9999999999.</p> <p>[4 chiffres].[10 chiffres]</p>
REPO_CURRENCY	R	Le champ doit contenir une suite de 3 caractères.

Colonne 1	Requis	Vérification du valideur
REPO_RATE	R	Si la valeur commence par un chiffre (positif ou négatif), elle doit se terminer par un signe de pourcentage (%). Si la valeur ne commence pas par un chiffre, il peut s'agir d'une suite d'un maximum de 30 caractères ASCII imprimables, sans virgule.
REPO_HAIRCUT	R	Le champ doit contenir un nombre à virgule flottante facultative. [4 chiffres].[10 chiffres]
REPO_CSI_TYPE	R	La valeur doit être 1, 2, 3 ou 4.
REPO_CSI_ID	RC	Si la valeur dans le champ REPO_CSI_TYPE = 1 (numéro CUSIP) : - Le champ doit contenir 9 caractères. - Il doit s'agir de caractères ASCII imprimables (0x20 - 0x7E), moins la virgule. - Le chiffre de contrôle doit être valide. - Le premier et le deuxième caractère ne doivent pas être une lettre. Si la valeur dans le champ REPO_CSI_TYPE = 2 (code ISIN) : - Le champ doit contenir 12 caractères. - Les caractères doivent être alphanumériques. - Le chiffre de contrôle doit être valide. Si la valeur dans le champ REPO_CSI_TYPE = 3 ou 4 - Le champ peut contenir 12 ou 9 caractères ou être vide.
RELATED_PTY	R	La valeur doit être Y, y, N ou n.
NON_RESIDENT	R	La valeur doit être Y, y, N ou n.
TRI-PARTY_REPO	R	La valeur doit être Y, y, N ou n.

4.7 Reçu de fichier

L'entité déclarante aura accès à deux reçus de fichier au moment de transmettre son fichier. Le premier consistera en un courriel automatisé qui sera envoyé à l'adresse courriel de l'utilisateur du système de transmission. Le courriel contiendra le nom du fichier, le nom de l'utilisateur, l'heure à laquelle le fichier a été transmis, le nombre d'opérations et les résultats du processus de validation.

Le deuxième reçu sera un fichier texte du journal qui contiendra les mêmes renseignements que le corps du courriel, mais qui pourra être téléchargé en amont dans le répertoire de transmission de l'utilisateur dans le système de déclaration des opérations SEROM 2.0. Ces fichiers du journal seront conformes à la convention suivante régissant les noms de fichiers :

- HHMMSSsss_SubmittedFilename.log
- Exemple :
 - L'entité déclarante a transmis son fichier à 10 h 20 min 5 s.123 -
20140501_12345123451234512345_MM_DEBT.csv
 - Validation du fichier du journal –
102005123_20140501_12345123451234512345_MM_DEBT.csv.log

L'entité déclarante devra conserver ses reçus de fichier aux fins d'audit.

4.8 Non-transmission des fichiers

Si l'entité déclarante ne reçoit pas de reçu de fichier par courriel immédiatement après avoir

téléchargé un fichier en amont, cela signifie que le téléchargement a échoué. Elle pourra à nouveau télécharger en amont le fichier à la date du jour en tout temps avant l'expiration du délai de traitement, soit 22 h (HE).

Pour obtenir du soutien, se reporter aux coordonnées figurant à la section 2.5.

4.9 Courriel d'erreur de chargement des données

Une fois que tous les fichiers transmis ont été traités par l'OCRI conformément au processus ETL durant la nuit, toutes les opérations dont les données n'ont pas pu être chargées seront compilées et envoyées par courriel le jour ouvrable suivant, avant 7 h, aux entités déclarantes respectives. Les entités déclarantes devront apporter des corrections et transmettre la version corrigée de leur fichier.

Le tableau ci-dessous dresse la liste des exceptions possibles pour le chargement des données sur les opérations.

Tableau 6 : Exceptions pour le chargement des données sur les opérations

N° de l'erreur	Type de fichier	Type d'erreur
1	Opération sur titres de créance	Exception : La valeur dans le champ ORIG_TRADE_ID correspond à celle dans le champ TRADE_ID dans le tableau des erreurs ETL.
2	Opération sur titres de créance	Exception : La valeur dans le champ ORIG_TRADE_ID doit correspondre à la valeur dans le champ TRADE_ID qui figurait déjà dans la base de données.
3	Opération sur titres de créance	Exception : La valeur dans le champ TRADE_ID est en double dans les nombreux fichiers sources.
4	Opération sur titres de créance	Exception : La valeur dans le champ ORIG_TRADE_ID est en double dans le même fichier source.
5	Opération sur titres de créance	Exception : La valeur dans le champ TRADE_ID est en double dans le même fichier source.
6	Opération sur titres de créance	Exception : Les valeurs dans les champs ORIG_TRADE_ID et REPORTING_DEALER_ID doivent créer une combinaison unique pour l'enregistrement.
7	Opération sur titres de créance	Exception : Les valeurs dans les champs TRADE_ID et REPORTING_DEALER_ID doivent créer une combinaison unique pour l'enregistrement.
8	Opération de pension sur titres	Exception : La valeur dans le champ ORIG_REPO_ID est en double dans le même fichier source.
9	Opération de pension sur titres	Exception : Les valeurs dans les champs ORIG_REPO_ID et REPORTING_DEALER_ID doivent créer une combinaison unique pour l'enregistrement.

N° de l'erreur	Type de fichier	Type d'erreur
10	Opération de pension sur titres	Exception : La valeur dans le champ ORIG_REPO_ID doit correspondre à la valeur dans le champ REPO_AGREEMENT_ID qui figurait déjà dans la base de données.
11	Opération de pension sur titres	Exception : La valeur dans le champ REPO_ID est en double dans les multiples fichiers sources.
12	Opération de pension sur titres	Exception : La valeur dans le champ REPO_ID est en double dans le même fichier source.
13	Opération de pension sur titres	Exception : La valeur dans le champ ORIG_REPO_ID correspond à celle dans le champ REPO_AGREEMENT_ID dans le tableau des erreurs ETL.
14	Opération de pension sur titres	Exception : Les valeurs dans les champs REPO_AGREEMENT_ID et REPORTING_DEALER_ID doivent créer une combinaison unique pour l'enregistrement.

5. Annexe - Tableaux et figures

Tableau 1 : Coordonnées	8
Tableau 2 : Autorisations utilisateur	9
Tableau 3 : Convention régissant les noms de fichiers	17
Tableau 4 : Vérification des champs des opérations sur titres de créance	19
Tableau 5 : Vérification des champs des opérations de pension sur titres.....	22
Tableau 6 : Exceptions pour le chargement des données sur les opérations	26
Figure 1 : Récupération des données d'accès au compte	10
Figure 2 : Page de connexion	13
Figure 3 : Téléchargement en amont – étape 1.....	14
Figure 4 : Téléchargement en amont – étape 2.....	15
Figure 5 : Téléchargement en amont – étape 3.....	16