

Annexe 21-101A3
Rapport d'activité trimestriel du marché

A. Renseignements Généraux Sur Le Marché

1. Dénomination du marché :
2. Période couverte par le présent rapport :
3. Coordonnées :
 - A. Dénomination complète du marché (s'il s'agit d'une entreprise à propriétaire unique, nom et prénom du propriétaire) :
 - B. Dénomination sous laquelle l'activité est exercée, si elle est différente de celle indiquée à la rubrique A :
 - C. Adresse principale du marché :
4. Joindre, à titre d'**Annexe A**, la liste à jour de tous les participants au marché à la fin de la période couverte par le présent rapport, en indiquant ceux qui utilisent les services de colocalisation offerts par le marché, s'il y a lieu. Pour chaque participant au marché, indiquer le nombre de numéros d'identification de négociateurs qui peuvent accéder au marché.
5. Joindre, à titre d'**Annexe B**, la liste de tous les participants au marché dont l'accès au marché a été accordé, refusé ou limité au cours de la période couverte par le présent rapport en indiquant pour chacun : a) si l'accès a été accordé, refusé ou limité; b) la date à laquelle le marché a pris cette mesure; c) la date de prise d'effet de cette mesure; d) la nature et le motif du refus ou de la limitation.
6. Fournir la liste de toutes les modifications apportées aux renseignements prévus aux Annexes 21-101A1 et 21-101A2 qui ont été déposées auprès des autorités en valeurs mobilières du Canada et mises en œuvre au cours de la période couverte par le rapport. La liste doit contenir une brève description de chaque modification et indiquer la date de dépôt et la date de mise en œuvre.
7. Fournir la liste de toutes les modifications apportées aux renseignements prévus aux Annexes 21-101A1 et 21-101A2 qui ont été déposées auprès des autorités en valeurs mobilières du Canada mais qui n'ont pas été mises en œuvre à la fin la période couverte par le rapport. La liste doit contenir une brève description de chaque modification et indiquer la date de dépôt ainsi que le motif pour lequel elles n'ont pas été mises en œuvre.
8. Systèmes – Indiquer la date, la durée et le motif de toute interruption, survenue au cours de la période, d'un système relatif aux activités de négociation, notamment la négociation, l'acheminement ou les données.

B. Renseignements Sur L'activité Du Marché

Partie 1 *Marchés Sur Lesquels Se Négocient Des Titres Cotés*

1. Activité de négociation générale

Pour chaque type de titre négocié sur le marché, donner les renseignements (s'il y a lieu) demandés dans le **Tableau 1**. Les renseignements devraient être fournis pour les opérations réalisées à l'ouverture du marché, durant les heures normales de négociation et hors séance au cours du trimestre. Inscrire « aucun », « s. o. » ou « 0 », s'il y a lieu.

Tableau 1 – Activité de négociation générale des marchés sur lesquels se négocient des titres cotés

Catégorie de titres	Volume		Valeur		Nombre d'opérations	
	Trans-parent	Non trans-parent	Trans-parente	Non trans-parente	Trans-parent	Non trans-parent
Titres cotés						
1. Titres de capitaux propres (y compris les actions privilégiées)						
2. Fonds négociés en bourse						
3. Titres de créance						
4. Options						
Titres cotés à l'étranger						
1. Titres de capitaux propres (y compris les actions privilégiées)						
2. Fonds négociés en bourse						
3. Titres de créance						
4. Options						

2. Applications

Donner les renseignements (s'il y a lieu) demandés dans le **Tableau 2** ci-après pour chaque type d'application exécutée sur le marché pour des opérations réalisées à l'ouverture, durant les heures normales et hors séance au cours du trimestre. Inscrire « aucun », « s. o. » ou « 0 », s'il y a lieu.

Tableau 2 – Applications

Types d'applications	% du volume	% de la valeur	% du nombre d'opérations
% des titres cotés qui correspondent à l'un des éléments suivants :			
1. Applications intentionnelles ¹			
2. Applications internes			
3. Autres applications			

3. Renseignements sur les ordres

Donner les renseignements (s'il y a lieu) demandés dans le **Tableau 3** ci-après pour chaque type d'ordre visant des titres cotés exécuté sur le marché et saisi à l'ouverture, durant les heures normales de négociation et hors séance au cours du trimestre. Inscrire « aucun », « s. o. » ou « 0 », s'il y a lieu.

Tableau 3 – Renseignements sur les ordres

Types d'ordres	Nombre d'ordres	% des ordres exécutés	% des ordres annulés²
1. Anonymes ³			
2. Pleinement transparents			
3. Liés au marché			
4. Pleinement cachés			

¹ Se reporter aux définitions d'« application interne » et d'« application intentionnelle » à l'article 1.1 des Règles universelles d'intégrité du marché.

² Par « ordres annulés », on désigne les ordres qui ont été annulés, sans donner lieu à un nouvel ordre ni à une modification.

³ Ordres exécutés avec le numéro d'identification 001.

5. Mécanisme distinct pour les ordres invisibles d'un marché transparent

6. Partiellement cachés (en réserve)

7. Nombre total d'ordres saisis au cours du trimestre

4. Opérations par titre

Donner les renseignements demandés dans le **Tableau 4** ci-après sur les 10 titres les plus négociés sur le marché (en fonction du volume) pour les opérations réalisées à l'ouverture, durant les heures normales de négociation et hors séance au cours du trimestre. Inscrire « aucun », « s. o. » ou « 0 », s'il y a lieu.

Tableau 4 – Titres les plus négociés

Catégorie de titres	Volume	Valeur	Nombre d'opérations
Titres cotés			
1. Titres de capitaux propres (dont les actions privilégiées) [Nom des titres]			
1.			
2.			
3.			
4.			
5.			
6.			
7.			
8.			
9.			
10.			

2. Fonds négociés en bourse

[Nom des titres]

1.

2.

3.

4.

5.

6.

7.

8.

9.

10.

3. Titres de créance

[Inscrire l'émetteur, l'échéance
et le coupon]

1.

2.

3.

4.

5.

6.

7.

8.

9.

10.

Titres cotés à l'étranger

1. Titres de capitaux propres (y
compris les actions privilégiées)

[Nom des titres]

1.

2.

3.

4.

5.

6.

7.

8.

9.

10.

2. Fonds négociés en bourse

[Nom des titres]

1.

2.

3.

4.

5.

6.

7.

8.

9.

10.

3. Titres de créance

[Nom des titres]

1.

2.

- 3.
- 4.
- 5.
- 6.
- 7.
- 8.
- 9.
- 10.

5. Opérations par participant au marché

Donner les renseignements demandés dans le **Tableau 5** ci-après sur les 10 principaux participants au marché (en fonction du volume de titres négociés). Les renseignements devraient être fournis pour le volume total des opérations, notamment les opérations réalisées à l'ouverture du marché, durant les heures normales de négociation et hors séance au cours du trimestre. Inscrire « aucun », « s. o. » ou « 0 », s'il y a lieu. Le marché devrait remplir un tableau distinct pour les participants qui sont courtiers et pour ceux qui ne le sont pas.

Tableau 5 – Concentration des opérations par participant au marché

Nom du participant au marché	Volume actif total	Volume passif total
1.		
2.		
3.		
4.		
5.		
6.		
7.		
8.		
9.		
10.		

6. Activités d'acheminement

Indiquer le pourcentage de participants au marché ayant utilisé les services d'acheminement du marché, d'un tiers ou d'un membre du même groupe au cours de la période couverte par le rapport. Fournir également l'information demandée dans le **Tableau 6** ci-après.

Tableau 6 – Acheminement des ordres du marché

Nombre d'ordres exécutés sur le marché visé par le rapport

Nombre d'ordres acheminés vers d'autres marchés (énumérer tous les marchés)

Nombre d'ordres qui sont désignés et traités comme des ordres à traitement imposé (OTI)

7. Colocalisation

Indiquer le pourcentage de participants au marché qui utilisent les services de colocalisation du marché, s'il y a lieu.

Partie 2 – Marchés De Titres À Revenu Fixe

1. Activité de négociation générale

Donner les renseignements (s'il y a lieu) demandés dans le **Tableau 7** ci-après pour chaque type de titre à revenu fixe négocié sur le marché durant les heures normales de négociation. Inscrire « aucun », « s. o. » ou « 0 », s'il y a lieu.

Tableau 7 – Activité sur les titres à revenu fixe

Catégorie de titres	Valeurs des opérations	Nombre d'opérations
Titres de créance non cotés canadiens – Publics		
1. Fédéral		
2. Organisme fédéral		
3. Provinces et municipalités		
Titres de créance non cotés canadiens – Privés		

Titres de créance non cotés
canadiens - Autres

Titres de créance non cotés
étrangers – Publics

Titres de créance non cotés
étrangers – Privés

Titres de créance non cotés
étrangers - Autres

2. Opérations par titre

Donner les renseignements demandés dans le **Tableau 8** ci-après sur les 10 titres à revenu fixe les plus négociés sur le marché (en fonction de la valeur du volume négocié) durant les heures normales de négociation au cours du trimestre. Inscrire « aucun », « s. o. » ou « 0 », s'il y a lieu.

Tableau 8 – Titres à revenu fixe les plus négociés

Catégorie de titres	Valeur des opérations	Nombre d'opérations
Titres de créance non cotés canadiens – Publics		
1. Fédéral [Inscrire l'émetteur, l'échéance et le coupon]		
1.		
2.		
3.		
4.		
5.		
6.		
7.		
8.		
9.		
10.		

2. Organisme fédéral
[Inscrire l'émetteur,
l'échéance et le coupon]

- 1.
- 2.
- 3.
- 4.
- 5.
- 6.
- 7.
- 8.
- 9.
- 10.

3. Provinces et municipalités
[Inscrire l'émetteur,
l'échéance et le coupon]

- 1.
- 2.
- 3.
- 4.
- 5.
- 6.
- 7.
- 8.
- 9.
- 10.

Titres de créance non cotés
canadiens – **Privés**
[Inscrire l'émetteur,

l'échéance et le coupon]

1.

2.

3.

4.

5.

6.

7.

8.

9.

10.

Titres de créance non cotés
canadiens – **Autres**

[Inscrire l'émetteur,
l'échéance et le coupon]

1.

2.

3.

4.

5.

6.

7.

8.

9.

10.

Titres de créance non cotés
étrangers – **Publics**

[Inscrire l'émetteur,
l'échéance et le coupon]

- 1.
- 2.
- 3.
- 4.
- 5.
- 6.
- 7.
- 8.
- 9.
- 10.

Titres de créance non cotés
étrangers – **Privés**
[Inscrire l'émetteur,
l'échéance et le coupon]

- 1.
- 2.
- 3.
- 4.
- 5.
- 6.
- 7.
- 8.
- 9.
- 10.

Titres de créance non cotés
étrangers – **Autres**
[Inscrire l'émetteur,
l'échéance et le coupon]

- 1.
- 2.
- 3.
- 4.
- 5.
- 6.
- 7.
- 8.
- 9.
- 10.

3. Opérations par participant au marché

Donner les renseignements demandés dans le **Tableau 9** ci-après sur les 10 principaux participants au marché pour les opérations réalisées durant les heures normales de négociation au cours du trimestre. Inscrire « aucun », « s. o. » ou « 0 », s'il y a lieu. Le marché devrait remplir un graphique distinct pour les participants qui sont courtiers et pour ceux qui ne le sont pas.

Tableau 9 – Concentration des opérations par participant au marché

Nom du participant au marché	Valeur négociée
1.	
2.	
3.	
4.	
5.	
6.	
7.	
8.	
9.	

10.

Partie 3 – Marchés De Prêt De Titres

1. Activité de prêt générale

Donner les renseignements (s'il y a lieu) demandés dans le **Tableau 10** ci-après sur chaque type de titres prêtés sur le marché. Inscrire « aucun », « s. o. » ou « 0 », s'il y a lieu.

Tableau 10 – Activité de prêt

Catégorie de titres	Quantité de titres prêtés au cours du trimestre	Valeur globale des titres prêtés au cours du trimestre
Canadiens		
1. Titres de capitaux propres – sociétés		
1.1. Actions ordinaires		
1.2. Actions privilégiées		
2. Titres de capitaux propres – entités non constituées en personnes morales (p. ex. parts de fiducies ou de sociétés de personnes –préciser)		
3. Titres de créance publics		
4. Titres de créance privés		
5. Autres titres à revenu fixe (préciser)		
Étrangers		
1. Titres de capitaux propres – sociétés		
1.1. Actions ordinaires		
1.2. Actions privilégiées		
2. Titres de capitaux propres – entités non constituées en personnes morales (p. ex. parts de fiducies ou de sociétés de personnes –préciser)		
3. Titres de créance publics		
4. Titres de créance privés		
5. Autres titres à revenu fixe (préciser)		

2. Opérations par participant au marché

Donner les renseignements demandés dans les **Tableaux 11** et **12** ci-après sur les 10 principaux emprunteurs et prêteurs en fonction de la valeur globale des titres empruntés ou prêtés, respectivement, au cours du trimestre.

Tableau 11 – Concentration de l’activité par emprunteur

Nom de l’emprunteur	Valeur globale des titres empruntés au cours du trimestre
1.	
2.	
3.	
4.	
5.	
6.	
7.	
8.	
9.	
10.	

Tableau 12 - Concentration de l’activité par prêteur

Nom du prêteur	Valeur globale des titres prêtés au cours du trimestre
1.	
2.	
3.	
4.	
5.	
6.	
7.	
8.	

- 9.
- 10.

3. **Activité de prêt par titre**

Donner les renseignements demandés dans le **Tableau 13** ci-après sur les 10 titres les plus prêtés sur le marché (en fonction de la quantité de titres prêtés au cours du trimestre). Inscrire « aucun », « s. o. » ou « 0 », s'il y a lieu.

Tableau 13 – Titres les plus prêtés

Catégorie de titres	Quantité de titres prêtés au cours du trimestre	Valeur globale des titres prêtés au cours du trimestre
Canadiens		
1. Actions ordinaires		
[Nom du titre]		
1.		
2.		
3.		
4.		
5.		
6.		
7.		
8.		
9.		
10.		
2. Actions privilégiées		
[Nom du titre]		
1.		
2.		
3.		
4.		

5.

6.

7.

8.

9.

10.

3. Titres de capitaux
propres – entités non
constituées en personnes
morales

[Nom du titre]

1.

2.

3.

4.

5.

6.

7.

8.

9.

10.

4. Titres de créance publics
[Nom du titre]

1.

2.

3.

4.

5.

- 6.
- 7.
- 8.
- 9.
- 10.

5. Titres de créance privés
[Nom du titre]

- 1.
- 2.
- 3.
- 4.
- 5.
- 6.
- 7.
- 8.
- 9.
- 10.

6. Autres titres à revenu
fixe [Nom du titre]

- 1.
- 2.
- 3.
- 4.
- 5.
- 6.
- 7.

8.

9.

10.

Étrangers

1. Actions ordinaires
[Nom du titre]

1.

2.

3.

4.

5.

6.

7.

8.

9.

10.

2. Actions privilégiées
[Nom du titre]

1.

2.

3.

4.

5.

6.

7.

8.

9.

10.

3. Titres de capitaux
propres – entités non
constituées en personnes
morales
[Nom du titre]

1.

2.

3.

4.

5.

6.

7.

8.

9.

10.

4. Titres de créance publics
[Nom du titre]

1.

2.

3.

4.

5.

6.

7.

8.

9.

10.

5. Titres de créance privés
[Nom du titre]

- 1.
- 2.
- 3.
- 4.
- 5.
- 6.
- 7.
- 8.
- 9.
- 10.

6. Autres titres à revenu fixe [Nom du titre]

- 1.
- 2.
- 3.
- 4.
- 5.
- 6.
- 7.
- 8.
- 9.
- 10.

Partie 4 *Marchés De Dérivés Au Québec*

1. *Activité de négociation générale*

Pour chaque catégorie de produits négociés sur le marché, donner les renseignements (s'il y a lieu) demandés dans le **Tableau 14** ci-après. Dans le cas des produits autres que les options sur fonds négociés en bourse et sur actions, donner les renseignements par produit dans la catégorie appropriée. Donner les renseignements sur les options sur fonds négociés en bourse et sur actions de façon cumulative (le total des options sur fonds négociés en bourse et celui des options sur actions). Les renseignements devraient être fournis pour les opérations réalisées pendant la séance initiale, la séance régulière et la séance prolongée au cours du trimestre. Inscrire « aucun », « s. o. » ou « 0 », s'il y a lieu.

Tableau 14 – Activité de négociation générale

Catégorie de produit	Volume	Nombre d'opérations	Position ouverte (Nombre/Fin du trimestre)
Contrats à terme			
1(a) Taux d'intérêt – court terme			
1(b) Taux d'intérêt – long terme			
2. Indices			
3. Fonds négociés en bourse			
4. Actions			
5. Devises			
6. Énergie			
7. Autres, veuillez préciser			
Options			
1(a) Taux d'intérêt – court terme			
1(b) Taux d'intérêt – long terme			
2. Indices			
3. Fonds négociés en bourse			
4. Actions			
5. Devises			
6. Énergie			
7. Autres, veuillez préciser			

2. Opérations résultant de discussions de prénégociation

Donner les renseignements (s'il y a lieu) demandés dans le **Tableau 15** ci-après par produit et pour chaque type d'opération résultant de discussions de prénégociation. Dans le cas des produits autres que les options sur fonds négociés en bourse et sur actions, donner les renseignements par produit dans la catégorie appropriée. Donner les renseignements sur les

options sur fonds négociés en bourse et sur actions de façon cumulative (le total des options sur fonds négociés en bourse et celui des options sur actions). Les renseignements devraient être fournis pour les opérations réalisées pendant la séance initiale, la séance régulière et la séance prolongée au cours du trimestre. Inscrire « aucun », « s. o. » ou « 0 », s'il y a lieu.

Tableau 15 – Opérations résultant de discussions de prénégociation

Type d'opération	% du volume	% du nombre d'opérations
Contrats à terme		
A. Application		
B. Opération préarrangée		
C. Opération en bloc		
D. Échange contre physique		
E. Échange de dérivés hors bourse pour contrats		
F. Opération de base		
G. Autres, veuillez préciser		
Options		
A. Application		
B. Opération préarrangée		
C. Opération en bloc		
D. Autres, veuillez préciser		

3. Renseignements sur les ordres

Donner les renseignements (s'il y a lieu) demandés dans le **Tableau 16** ci-après par produit et pour chaque type d'ordre visant des contrats négociables exécuté sur le marché. Dans le cas des produits autres que les options sur fonds négociés en bourse et sur actions, donner les renseignements par produit dans la catégorie appropriée. Donner les renseignements sur les options sur fonds négociés en bourse et sur actions de façon cumulative (le total des options sur fonds négociés en bourse et celui des options sur actions). Les renseignements devraient être fournis pour les ordres saisis pendant la séance initiale, la séance régulière et la séance prolongée au cours du trimestre. Inscrire « aucun », « s. o. » ou « 0 », s'il y a lieu.

Tableau 16 - Renseignements sur les ordres

Type d'ordres	% du volume	% du nombre d'opérations
1. Anonymes		
2. Pleinement transparents		
3. Liés au marché		
4. Pleinement cachés		

5. Mécanisme distinct pour les ordres invisibles d'un marché transparent		
6. Partiellement cachés (en réserve, par exemple, pour les ordres iceberg)		

4. Opérations par produit

Donner les renseignements demandés dans le **Tableau 17** ci-après. Pour chaque produit autre que les options sur fonds négociés en bourse et sur actions, indiquer les contrats les plus négociés sur le marché (en volume) qui, pris ensemble, représentent au moins 75 % du volume total de chaque produit au cours du trimestre. La liste doit contenir au moins 3 contrats. Pour les options sur fonds négociés en bourse et sur actions, indiquer les 10 catégories les plus négociées en volume. Donner les renseignements sur les options sur fonds négociés en bourse et sur actions de façon cumulative (le total des options sur fonds négociés en bourse et celui des options sur actions). Les renseignements devraient être fournis pour les opérations réalisées pendant la séance initiale, la séance régulière et la séance prolongée au cours du trimestre. Inscrire « aucun », « s. o. » ou « 0 », s'il y a lieu.

Tableau 17 – Contrats les plus négociés

Catégorie de produit	Volume	Nombre d'opérations	Position ouverte (Nombre/Fin du trimestre)
Contrats à terme			
1. Nom des produits – Les 3 contrats les plus négociés (ou autre nombre approprié) 1. 2. 3.			
Options			
2. Fonds négociés en bourse [Catégories] 1. 2. 3. 4. 5. 6. 7.			

8.			
9.			
10.			
3. Actions [Catégories]			
1.			
2.			
3.			
4.			
5.			
6.			
7.			
8.			
9.			
10.			
4. Autres options inscrites (veuillez préciser) – Les 3 contrats les plus négociés (ou autre nombre approprié)			
1.			
2.			
3.			

5. Concentration des opérations par participant au marché

Donner les renseignements demandés dans le **Tableau 18** ci-après. Pour chaque produit autre que les options sur fonds négociés en bourse et sur actions, indiquer les principaux participants au marché dont le volume global des opérations représentait au moins 75 % du volume total des opérations. La liste doit contenir au moins 3 participants au marché. Pour les options sur fonds négociés en bourse et sur actions, indiquer les 10 participants au marché les plus actifs (en volume). Donner les renseignements de façon cumulative (le total des options sur fonds négociés en bourse et celui des options sur actions). Les renseignements devraient être fournis pour les opérations réalisées pendant la séance initiale, la séance régulière et la séance prolongée au cours du trimestre. Inscrire « aucun », « s. o. » ou « 0 », s'il y a lieu.

Tableau 18 – Concentration des opérations par participant au marché

Nom du produit	Nom des participants au marché	Volume
Contrats à terme		
Nom du produit (veuillez préciser)	1. 2. 3. (plus si nécessaire)	
Options		
Fonds négociés en bourse	1.	

	2. 3. 4. 5. 6. 7. 8. 9. 10.	
Actions	1. 2. 3. 4. 5. 6. 7. 8. 9. 10.	
Autres options (veuillez préciser)	1. 2. 3. (plus si nécessaire)	

6. Colocalisation

Indiquer le pourcentage de participants au marché qui utilisent les services de colocalisation du marché, s'il y a lieu.

C. Attestation du marché

Le soussigné atteste que les renseignements fournis dans le présent formulaire au sujet du marché sont exacts.

FAIT à _____ le _____ 20____.

(Dénomination du marché)

(Nom de l'administrateur, du dirigeant ou de l'associé – en caractères d'imprimerie)

(Signature de l'administrateur, du dirigeant ou de l'associé)

(Titre officiel – en caractères d'imprimerie)