



NASDAQ CXC Limited

Notes de l'application FIX 4.2

NASDAQ CXC Limited

Notes de l'application FIX 4.2

18 octobre 2022

Version : 1,60

©2022, Nasdaq CXC Limited. Tous droits réservés. Nasdaq® est une marque de commerce enregistrée. Les droits d'auteur en totalité et pour chaque partie ne pourront être copiés ni reproduits en totalité ou en partie de quelque façon ou sous quelque forme que ce soit sans le consentement écrit préalable de Nasdaq CXC Limited..

Ces renseignements sont fournis à titre informatif seulement. Ils ne prennent pas en considération les objectifs d'investissement, la situation financière ou les besoins particuliers d'une personne ou entité. Ils ne doivent en aucun cas être utilisés ou considérés comme une offre d'achat ou de vente de titres ni comme une sollicitation ou une recommandation d'achat, de vente ou d'offre d'achat ou de vente de titres. Bien que les renseignements proviennent de sources réputées fiables, ni Nasdaq CXC Limited, ni ses concédants de licence, ni aucune autre partie par l'intermédiaire de laquelle l'utilisateur obtient de tels renseignements : (i) ne garantit qu'ils sont exacts, complets, opportuns ou qu'ils contiennent les bonnes données de séquençage de l'information; (ii) ne donne de garantie quant aux résultats obtenus par leur utilisation; ou (iii) n'est responsable de réclamation, perte ou dommage résultant de ou causé par une inexactitude, une erreur, un retard ou une omission, ou par l'utilisation des renseignements ou par un acte effectué sur la foi des renseignements. La reproduction ou la diffusion de ces renseignements est interdite sans la permission écrite de Nasdaq Canada.

Le temps de réponse du système peut varier pour un certain nombre de raisons, notamment les conditions du marché, les volumes négociés et les performances du système.

Historique de révisions

Version	Description	Date
Version 1.11	Rendu la balise 6774 – BrokerNumber obligatoire pour nouvel ordre	2008-03-07
Version 1.12	Ajout de la balise 198 – SecondaryOrderID dans les rapports d'exécution Retrait du commentaire : « la quantité de l'ordre peut être ajustée à la baisse seulement ». La quantité peut être ajustée à la hausse ou à la baisse.	2008-03-24
Version 1.13	Ajout des destinations Smart Routing, de CSO, Peg Offset et Cross	2008-04-04
Version 1.14	Ajout des balises 6776 et 6777 dans le Rapport de transaction et identification de la valeur de l'ordre masqué	2008-05-16
Version 1.15	Retrait de la valeur « PT » de la balise 6750 UMIRAccountType Ajout de 59=N pour ordre de « Contournement »	2008-07-16

Version	Description	Date
Version 1.16	Ajout de valeurs à la balise 76 dans les messages Rapport de transaction Ajout de la balise 110 dans Nouvel ordre	2008-07-18 2008-10-08
Version 1.17	Ajout de 59=P pour ordre « Inscription seulement » Ajout de la balise 8020 dans Nouvel ordre	2008-07-18 2008-10-08
Version 1.18	Modification de la mise en œuvre de l'ordre « Contournement » de 59=N à 6791=O	2009-05-05
Version 1.19	Ajout de possibilités additionnelles de valeurs pour la balise 76 (ALPH, MATCH)	2009-06-17
Version 1.20	Retrait des marqueurs de transaction Principal et Wash du nouvel ordre	2009-07-29
Version 1.21	Ajout de la balise 21 dans Ordre croisé	2010-09-14
Version 1.22	Changement de la balise 21 à Modifié si la valeur est autre que 1	2010-09-27
Version 1.23	Ajout de la balise 6761, Anonymous	2010-11-18
Version 1.24	Nettoyage Retrait des références à la symbologie de rechange	2011-02-18
Version 1.25	Retrait de 6761 de l'exécution	2011-05-09
Version 1.26	Ajout de TMXS comme courtier d'exécution valable pour les transactions TMX Select	2011-07-07
Version 1.27	Ajout de la balise 7729 SME pour utilisation future, balise 20050 Facilitation Qty, types d'opérations croisées supplémentaires (C,V,B), et ordre croisé de contournement. Ajout de NoTradeFeat (7713) et NoTradeKey (7714)	2012-06-28
Version 1.28	Ajout de CSO aux types d'opérations croisées	2012-08-09
Version 1.29	Ajout de la balise 6763 à Demande d'annulation/remplacement d'ordre et Rapport de transaction. Ajout de la balise 8114 (RepriceReason) aux messages de confirmation.	2012-09-14
Version 1.30	Incorporation des changements de CX2. Ajout des balises 8115 (BrokerPrefEligible) et 8116 (BrokerPref). Modification de la balise 6761 (Anonymous) et ajout de la valeur CX2 pour les balises 57, 100, 128 et 129. Ajout de CX2 comme courtier d'exécution valable pour les transactions CX2.	2012-10-22
Version 1.31	Ajout de la balise 198 à Rapport de transaction, ajout de la balise 9882 à Confirmation d'annulation d'ordre, retrait de la balise 8115. Ajout de ContraBroker (375) and NoContraBrokers (382) à Rapport de transaction.	2013-01-14
Version 1.32	Ajout de UMIRAccountType (6750) and Jitney (6757) aux messages Réponse à Nouvel ordre unique et Rapport de transaction.	2013-02-15
Version 1.33	Retrait des références aux ordres de vente à découvert avec exemption. Mise à jour de la description de ShortMarkingExempt (7729). Mise à jour de la description de CIOrdID (11) et OrigCIOrdID (41) dans Confirmation d'annulation d'ordre et Rejet d'annulation et Rejet d'annulation/remplacement d'ordre. Mise à jour de PegDifference (211).	2013-06-18

Version	Description	Date
Version 1.34	Ajout de FacilitationSide (20051) à Ordre croisé. Retrait de DeliverToCompID (128), et DeliverToSubID (129), BrokerNumber (6774). Ajout d'une validation supplémentaire à Account (1), ClOrdID (11), OrdType (40), OrigClOrdID (41), Side (54) et TimeInForce (59). Ajout d'ExecBroker (76) à Réponse à Nouvel ordre unique.	2013-11-06
Version 1.35	Ajout d'une valeur possible de LYNX à ExecBroker (76).	2014-01-27
Version 1.36	Ajout de l'option de prévention d'autonégociation à Execute. Changement à NoTradeFeat (7713) dans Nouvel ordre unique et ajout de ExecuteMatch (7733) dans le Rapport de transaction.	2014-08-13
Version 1.37	Retrait de l'option ensemble du marché pour NoTradeFeat (7713). Ajout d'AEQN pour Aequitas Neo et AEQL pour Aequitas Lit comme valeurs possibles pour ExecBroker (76).	2015-01-23
Version 1.38	Ajout des valeurs Marché à la clôture, Ajout masqué et Retrait masqué à TradeLiquidityIndicator (9882). Ajout de Marché à la clôture et de Limite à la clôture à OrdType (40) et TimeInForce (59). Ajout de TimeInForce (59) au message Rapport de transaction.	2015-06-01
Version 1.39	Retrait de PT = Négociateur professionnel (Professional Trader) de CHIXBuyAccountType (6767) et CHIXSellAccountType (6768) d'Ordre croisé. Ajout de la clarification de la valeur par défaut pour les ordres Marché à la clôture à Anonymous (6761). Ajout d'Anonymous (6761) au message Demande d'annulation/remplacement d'ordre.	2015-08-12
Version 1.40	Ajout de SettlType (63) et SettlDate (64) aux Ordres croisés pour prendre en charge des conditions spéciales de règlement. Retrait de TMXS comme valeur valable d'ExecBroker (76).	2016-04-11
Version 1.41	Ajout de SecurityIDSource (22), SecurityID (48), BrokerNumber (6774) et OrigSendercompID (9688) pour identifier les balises supplémentaires de la copie de sécurité. Ajout de la valeur d'ordre Amélioration du prix minimum (MPI) à ExecInst (18). Ajout de CXD comme valeur possible pour ExecBroker (76). Ajout de diverses références à CXD à des champs préexistants. Ajout d'une valeur possible de 4 à RepriceReason (8114) et reformulation du type de message (150=D) pour les Planchers de marché.	2016-06-21
Version 1.42	Retrait de la reformulation du type de message (150=D)	2016-08-03
Version 1.43	Retrait de l'option par défaut de TargetSubid (57) et ExDestination (100)	2016-12-20
Version 1.44	Ajout de l'option Quantité minimale (MQ) à ExecInst (18) pour CXD. Ajout de Quantité minimale acceptable (MAQ) à MinQty (110) pour CXD. Ajout de valeurs possibles de TradeLiquidityIndicator (9882) pour indiquer la liquidité des ordres appariés au seuil. Ajout de Compte (1) au message Rapport de transaction.	2017-04-17
Version 1.45	Retrait de l'option Quantité minimale (MQ) à ExecInst (18) pour CXD.	2017-05-04

Version	Description	Date
Version 1.46	Remplacement de CSO par DAO. Ajout de valeurs possibles à ExecBroker (76) pour Réponse à nouvel ordre unique. Ajout de MaxFloor (111) à Réponse à nouvel ordre unique. Ajout d'une valeur possible d'UA à AccountType (6750), CHIXBuyAccountType (6767) et CHIXSellAccountType (6768). Ajout d'une valeur possible de D à CrossType (6773).	2017-06-15
Version 1.47	Ajout de l'option Quantité minimale (MQ) à ExecInst (18) pour CXD.	2017-07-12
Version 1.48	Ajout de prise en charge pour POComment (7737).	2017-10-25
Version 1.49	Ajout d'Annulation d'OPR et Modification du prix d'OPR à HandleInst (21). Rejet de la combinaison de MinQty (110) et Bypass (6791). Mise à jour de HandleInst (21) pour le message Ordre croisé. Ajout du type d'ordre MAQ à CXC et CX2 dans MinQty (110).	2017-12-14
Version 1.50	Mise à jour de nettoyage	2018-02-08
Version 1.51	Changement de la valeur « Anonymous » (6761) pour CXC.	2018-04-27
Version 1.52	Ajout de NBBOSetter (8115) à Réponse à nouvel ordre unique. Ajout de la valeur de fixation du MCAVN au TradeLiquidityIndicator (9882). Retrait de « (CXD Only) » des directives d'amélioration minimale du cours dans ExecInst (18).	2018-05-28
Version 1.53	Ajout de nouvelles valeurs ExecInst (18) à Quantité minimale acceptable pour un ordre apparié au seuil (MAQ ATT), et à Quantité minimale pour un ordre apparié au seuil (MQ ATT), et de la nouvelle balise 7731 (SeekPriceImprovement) à Nouvel ordre unique, à Réponse à Nouvel ordre unique, à Confirmation d'annulation d'ordre et à Message de rapport de négociation. Ajout de HandleInst (21) aux messages Réponse à Nouvel ordre unique et Confirmation d'annulation d'ordre.	2018-06-22
Version 1.54	Ajout de la balise SecurityExchange (207) au message Rapport de transaction pour identifier le marché d'inscription.	2018-11-28
Version 1.55	Ajout de GEFEligible (6759) aux messages Nouvel ordre unique et Réponse à Nouvel ordre unique. Ajout de nouvelles valeurs possibles de g et G pour les exécutions de la FEG à TradeLiquidityIndicator (9882). Ajout des messages Commande d'un participant au marché et Réponse à la commande d'un participant au marché pour les membres de la FEG.	2018-12-21

Version	Description	Date
Version 1.56	Ajout de la valeur potentielle de L à ExecInst (18) pour les ordres à durée de vie prolongée au cours médian (« <i>Midpoint Extended Life Order</i> » ou « <i>M-ELO</i> ») aux messages Nouvel ordre unique, Réponse à Nouvel ordre unique, Confirmation d'annulation d'ordre et Rapport de transaction. Ajout des valeurs potentielles de E, O et L à TradeLiquidityIndicator (9882) aux messages Confirmation d'annulation d'ordre et Rapport de transaction. Ajout de MsgType (35) (type de message) et d'ExDestination (100) à la Market Participant Command (commande de participant au marché) et de MsgType (35) à la Market Participant Command Response (réponse à la commande de participant au marché).	2019-06-06
Version 1.57	Changements au soutien des identifiants de client de l'OCRCVM. Ajout d'une nouvelle valeur possible de MC à UMIRAccountType (6750), BuyAccountType (6767) et SellAccountType (6768). Ajout des nouveaux champs CustomerAccount (8025), OrderOrigination (1724), CustomerLEI (8027), BrokerLEI (8028), RoutingArrangementIndicator (2883) et AlgorithmID (8026) aux messages d'ordres non croisés. Ajout des nouveaux champs BuyCustomerAccount (20201), SellCustomerAccount (20202), BuyOrderOrigination (20209), SellOrderOrigination (20210), BuyCustomerLEI (20205), SellCustomerLEI (20206), BuyBrokerLEI (20207), SellBrokerLEI (20208), BuyRoutingArrangementIndicator (20211), SellRoutingArrangementIndicator (20212), BuyAlgorithmID (20203) et SellAlgorithmID (20204) aux messages d'ordres non croisés.	2020-09-30
Version 1.58	Ajout de la valeur potentielle de o à ExecInst (18)	2021-11-04
Version 1.59	Ajout d'une nouvelle valeur possible de 8 à TimeInForce (59). Ajout des nouveaux champs TargetStrategy (847), ConditionalOrder (23012), AllowConditional (23013), FirmUpID (23014), MinRate (27005) et MaxRate (27006) aux messages Nouvel ordre unique et Réponse à Nouvel ordre unique. Ajout d'une nouvelle valeur possible de D aux ExecType (150). Ajout des nouveaux champs ConditionalOrder (23012) and FirmUpID (23014) aux message Confirmation d'annulation d'ordre. Ajout reformulation du type de message. Ajout d'une nouvelle valeur possible de P, m et M à TradeLiquidityIndicator (9882).	2022-06-02
Version 1.60	Ajout d'une nouvelle valeur possible de CSE2 à ExecBroker (76). ConditionalOrder (23012) et FirmUpID (23014) pour la demande de confirmation d'ordre conditionnel déplacés de Confirmation d'annulation d'ordre (5.2.2.2) à 5.2.2.5 Retraitement (5.2.2.5). Ajout de champs PureStream à Confirmation d'annulation d'ordre.	2022-10-18

Table des matières

1	INTRODUCTION.....	9
1.1	MÉTHODOLOGIE DE DOCUMENTATION	9
2	INTERFACE FIX DE NASDAQ CANADA.....	10
3	DONNÉES DE CONFIGURATION	11
3.1	CLIENT	11
3.1.1	<i>SenderCompID</i>	11
3.1.2	<i>TargetCompID</i>	11
3.1.3	<i>Cryptage</i>	11
3.2	CONFIGURATION NASDAQ.....	11
3.2.1	<i>SenderCompID</i>	11
3.2.2	<i>TargetCompID</i>	11
3.2.3	<i>Adresses IP</i>	11
4	GESTION DE SESSION	12
4.1	FORMAT D’EN-TÊTE DE MESSAGE À NASDAQ CANADA	12
4.2	FORMAT D’EN-TÊTE DE MESSAGE AU CLIENT	12
4.3	FORMAT DE FIN DE MESSAGE.....	13
4.4	CONNEXION (LOGON).....	13
4.4.1	<i>Connexion du client</i>	13
4.4.2	<i>Connexion de Nasdaq Canada</i>	13
4.5	MESSAGES ADMINISTRATIFS	13
4.6	DÉCONNEXION	14
4.6.1	<i>Client</i>	14
4.6.2	<i>Entretien de nuit de Nasdaq Canada</i>	14
4.7	MESSAGES DE REJET.....	14
4.8	RÉCUPÉRATION	14
5	MESSAGES D’APPLICATION.....	15
5.1	SYMBOLOGIE.....	15
5.2	INSCRIPTION D’UN ORDRE	16
5.2.1	<i>Client</i>	16
5.2.1.1	Nouvel ordre unique.....	16
5.2.1.2	Demande d’annulation d’ordre	23
5.2.1.3	Demande d’annulation/remplacement d’ordre.....	24
5.2.2	<i>Messages d’inscription d’ordre de Nasdaq Canada</i>	26
5.2.2.1	Réponse à Nouvel ordre unique	26
5.2.2.2	Confirmation d’annulation d’ordre.....	31
5.2.2.3	Rejet d’Annulation d’ordre et d’Annulation/remplacement d’ordre.....	36
5.2.2.4	Réponse au Remplacement	36
5.2.2.5	Rapport de transaction	41
5.2.2.6	Messages FIX non pris en charge.....	47
5.3	OPÉRATIONS CROISÉES.....	48
5.4	PARTICIPANT AU MARCHÉ	53
5.4.1	<i>Commande d’un participant au marché</i>	53
5.4.2	<i>Réponse à la commande d’un participant au marché</i>	53

6	ANNEXE A – EXEMPLE DE MATRICES DE FLUX D’ORDRES.....	55
7	ANNEXE B – DÉFINITION DES ORDRES INDEXÉS DE NASDAQ CANADA TYPE D’INDEXATION PRIMAIRE (PRIM).....	78
7.1	INDEXATION PRIMAIRE DE BASE	78
	<i>Indexation primaire de base.....</i>	<i>78</i>
7.2	TYPE D’INDEXATION MÉDIANE (MID).....	78
	<i>Indexation médiane de base</i>	<i>78</i>
7.3	TYPE D’INDEXATION AU MARCHÉ (MKT)	79
	<i>Indexation au marché de base.....</i>	<i>79</i>

1 INTRODUCTION

Ce document décrit spécifiquement les fonctionnalités disponibles via l'interface basée sur la version FIX 4.2 de Nasdaq Canada. Il décrit également comment Nasdaq Canada utilise le protocole FIX pour atteindre cette fonctionnalité.

Le présent document vise à compléter la spécification du protocole FIX (www.fixprotocol.org), en décrivant :

- Lorsqu'il existe plusieurs façons d'atteindre un résultat souhaité avec le protocole, ce document décrit laquelle ou lesquelles Nasdaq Canada prend en charge.
- Lorsque le protocole ne définit pas la signification ou le contenu exact des différents champs, ce document fournit autant de détails que possible pour décrire la mise en œuvre choisie par Nasdaq Canada.
- Lorsqu'il existe d'autres interprétations possibles, le présent document décrit l'interprétation que Nasdaq Canada a choisie.

Qu'est-ce que FIX?

FIX Connectivity permet l'intégration facile du système de négociation de Nasdaq Canada dans votre flux de travail et vous facilite les transactions en réduisant vos frappes au clavier. FIX signifie Financial Information eXchange Protocol. Le protocole FIX est un « langage » créé par un groupe de clients institutionnels et de courtiers en vue de standardiser la fourniture de renseignements de prénégociation et de négociation pertinents. Il s'agit d'une spécification du domaine public détenue et entretenue par l'Organisme du protocole FIX. Nasdaq Canada vous offre plusieurs options pour intégrer facilement Nasdaq Canada à votre flux de travail à l'aide d'une connexion FIX.

Envoyez des ordres ou listes à Nasdaq Canada directement de votre brouillard de négociation

Grâce à une connexion FIX entre votre système et Nasdaq Canada, vous pouvez facilement envoyer des ordres à Nasdaq Canada automatiquement à partir de votre brouillard, ce qui vous donne un accès instantané aux occasions de négociation et à la liquidité canadiennes.

1.1 Méthodologie de documentation

Les messages et les champs FIX ne sont reproduits dans ce document que si leur contenu ou leur utilisation diffère de la spécification FIX originale (www.fixprotocol.org). Les **messages FIX** sont en **caractères gras** (p. ex. **demande de réexpédition, connexion**); les *champs FIX* sont en italique (p. ex. *PossResend, SenderSubID*).

2 INTERFACE FIX DE NASDAQ CANADA

Comme Nasdaq Canada n'est pas un système de négociation multijours, il ne prend pas en charge les ordres multijours. Lorsque le système est mis hors service pour l'entretien de nuit, tous les ordres résidant sur le système sont annulés et les numéros de séquence FIX sont réinitialisés. Lorsque le système est réactivé, cela est considéré comme le jour de négociation suivant.

Voici l'horaire d'entretien de nuit (veuillez noter que les heures sont approximatives) :

- Du lundi au vendredi de 18 h à 6 h, heure normale de l'Est

Veuillez également noter que l'entretien de nuit a lieu les jours fériés.

Sur demande, notre personnel du soutien technique de Nasdaq Canada vous donnera accès au serveur d'essai de FIX. Un rendez-vous est requis aux fins de certification.

Lors de l'utilisation de la connexion d'essai, le client recevra approximativement le même trafic que celui de la connexion de production. Veuillez noter que les transactions et ordres ne seront pas tous les mêmes sur le serveur d'essai que sur le serveur de production.

3 DONNÉES DE CONFIGURATION

3.1 Client

3.1.1 SenderCompID

Les clients doivent identifier la session dans le champ *SenderCompID* (49). Le NASDAQ doit approuver cette valeur. Le logiciel de Nasdaq Canada est sensible à la casse et la taille maximale du champ *SenderCompID* (49) est de **32** caractères.

3.1.2 TargetCompID

TargetCompID doit identifier NASDAQ comme la firme qui reçoit.

3.1.3 Cryptage

Nasdaq Canada ne prend pas en charge le cryptage des messages FIX.

3.2 Configuration NASDAQ

3.2.1 SenderCompID

La valeur que le client recevra dans le champ *SenderCompID* de Nasdaq Canada sera la valeur initialement fournie à Nasdaq Canada dans le champ *TargetCompID* du message d'ouverture de session.

3.2.2 TargetCompID

La valeur que le client recevra dans le champ *TargetCompID* de Nasdaq Canada sera la valeur fournie à l'origine à Nasdaq Canada dans le champ *SenderCompID* du message d'ouverture de session.

3.2.3 Adresses IP

Nasdaq Canada fournit à ses clients les adresses IP appropriées pour les environnements de production et d'essai.

4 GESTION DE SESSION

Cette section décrit les messages FIX de session envoyés entre Nasdaq Canada et le client.

Les serveurs de production se composent d'un serveur primaire et d'un serveur de secours. Si la session au serveur primaire échoue, réessayez cette connexion au bout de 30 secondes. Si la reconnexion échoue, établissez une session avec le serveur de secours. La session secondaire se poursuivra là où la session primaire s'est arrêtée. Une fois qu'une session est rétablie, Nasdaq Canada commencera immédiatement à envoyer les rapports d'exécution qui n'ont pas été livrés avec succès lors de la session FIX précédente pour la même date de transaction.

4.1 Format d'en-tête de message à Nasdaq Canada

Nasdaq Canada traite seulement les champs suivants dans l'en-tête du message et ignore tous les autres champs :

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
8	BeginString	Y	FIX.4.2
9	BodyLength	Y	Doit être le deuxième champ du message.
34	MsgSeqNum	Y	Voir l'explication standard de FIX.
35	MsgType	Y	Doit être le troisième champ du message.
43	PossDupFlag	N	Toujours nécessaire pour les retransmissions, qu'elles soient déclenchées par le système émetteur ou à la suite d'une demande de réexpédition.
49	SenderCompID	Y	La valeur utilisée doit être reconnue et acceptée par Nasdaq Canada.
50	SenderSubID	N	Ceci peut être utilisé pour indiquer un compte ou un client spécifique de Nasdaq Canada. Nasdaq Canada ignore cette balise.
52	SendingTime	Y	Indique l'heure à laquelle le message a été envoyé par le client.
56	TargetCompID	Y	Identifie Nasdaq Canada comme firme de réception.
97	PossResend	N	Requis lorsque le message peut être le duplicata d'un autre message envoyé sous un numéro de séquence différent.

4.2 Format d'en-tête de message au client

Nasdaq Canada traite seulement les champs suivants dans l'en-tête du message et ignore tous les autres champs :

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
8	BeginString	Y	FIX.4.2
9	BodyLength	Y	Sera le deuxième champ du message.
34	MsgSeqNum	Y	Voir l'explication standard de FIX.
35	MsgType	Y	Sera le troisième champ du message.
43	PossDupFlag	N	Toujours nécessaire pour les retransmissions, qu'elles soient déclenchées par le système émetteur ou à la suite d'une demande de réexpédition.
49	SenderCompID	Y	La valeur fournie à l'origine à Nasdaq Canada dans le champ <i>TargetCompID</i> du message d'ouverture de session du Client.
52	SendingTime	Y	Indique l'heure à laquelle le message a été envoyé par Nasdaq Canada.

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
56	TargetCompID	Y	La valeur fournie à l'origine à Nasdaq Canada dans le champ <i>SenderCompID</i> du message de connexion du Client.
57	TargetSubID	N	La valeur fournie à l'origine à Nasdaq Canada dans le champ <i>SenderSubID</i> dans les messages d'application du Client, si spécifiée.
97	PossResend	N	Requis lorsque le message peut être le duplicata d'un autre message envoyé sous un numéro de séquence différent.

4.3 Format de fin de message

Nasdaq Canada traite seulement les champs suivants dans l'en-tête du message et ignore tous les autres champs :

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
10	Checksum	Y	(Jamais crypté, toujours le dernier champ du message)

4.4 Connexion (logon)

4.4.1 Connexion du client

Le premier message attendu que Nasdaq Canada recevra d'un client est un message de connexion. Les paramètres de connexion sont les suivants :

- Le numéro de séquence, lors de la connexion initiale pour chaque jour de négociation, doit être réglé à « 1 ».
- L'intervalle des pulsations doit être supérieur à zéro.
- Le *SenderCompID* (49) doit être reconnu par Nasdaq Canada (voir la section intitulée [Données de configuration](#)).
- Le client doit établir le *TargetCompID* (56).
- **Si un client reçoit un numéro de séquence inférieur à ce qui est prévu, le client doit mettre fin immédiatement à sa session et doit communiquer avec Nasdaq Canada pour corriger le problème, conformément au protocole FIX.**

4.4.2 Connexion de Nasdaq Canada

Une fois que Nasdaq Canada reçoit une demande de **Connexion**, elle valide le *SenderCompID* et effectue un processus de récupération (voir la section *Récupération*). **Aucun** message ne doit être envoyé à Nasdaq Canada tant qu'un message de **Connexion** n'a pas été reçu en réponse de Nasdaq Canada.

Dans certains cas, un certain temps s'écoulera avant qu'une réponse ne soit envoyée par Nasdaq Canada. Une fois que la réponse positive est retournée, la minuterie de pulsations du client doit commencer. La session est ouverte et les deux parties peuvent commencer à échanger des messages. La réponse négative à une demande de **Connexion** est une **Déconnexion**.

4.5 Messages administratifs

Cette section décrit les conditions minimales requises pour garder la session active et synchronisée.

Nasdaq Canada doit recevoir un message du client au moins **une fois** par intervalle de pulsations défini lors de la connexion. Nasdaq Canada supposera que la session n'est pas active si elle ne reçoit pas de message durant **deux** intervalles de pulsations, envoie un message de **Déconnexion** au client et déconnecte la session selon le protocole FIX.

Nasdaq Canada envoie un message au moins une fois par intervalle de pulsations. De plus, Nasdaq Canada gère les messages de session suivants : **Renvoi d'une demande**, **Réinitialisation de séquence** et **Demande de test** et ignore *OrigSendingTime* (122) dans tous les messages.

4.6 Déconnexion

Cette section concerne la clôture normale et anormale d'une session par l'une ou l'autre des parties.

4.6.1 Client

La session FIX d'un client doit rester établie tout au long de la journée de négociation. Nasdaq Canada se déconnectera des sessions client avant le début de la période d'entretien. Une interruption anormale de la session est traitée comme si le client s'était déconnecté de Nasdaq Canada. Les situations suivantes sont considérées comme des interruptions de session anormales :

- Déconnexion au niveau du réseau
- Défaut d'envoyer un message durant deux intervalles de pulsations (voir la section intitulée « [Messages administratifs](#) »)

4.6.2 Entretien de nuit de Nasdaq Canada

Lorsque Nasdaq Canada éteint pour l'entretien de nuit, toutes les sessions en cours sont interrompues. Tous les ordres ouverts restants sont annulés et une nouvelle date de négociation commence. Aucun **Rapport d'exécution** ne sera envoyé pour les ordres envoyés les jours de bourse précédents.

4.7 Messages de rejet

Les messages de **Rejet** envoyés par Nasdaq Canada incluent le numéro de séquence du message rejeté et une explication de la nature de l'erreur, dans le champ texte, chaque fois que c'est possible.

Si le NASDAQ reçoit un message dont le numéro de séquence est *inférieur* à celui attendu lors du traitement normal de la session et qu'il ne contient pas le champ *PossDupFlag*, le message est rejeté et un message de **Rejet** est envoyé au client.

4.8 Récupération

Lorsqu'un client se reconnecte après une interruption de session au cours du même jour de bourse, Nasdaq Canada commence la séquence de récupération suivante :

- Si Nasdaq Canada reçoit un numéro de séquence inférieur à celui prévu, la session sera immédiatement interrompue sans qu'il soit nécessaire d'envoyer une déconnexion. Le client doit communiquer avec Nasdaq Canada pour corriger le problème.
- Nasdaq Canada transmettra tous les rapports d'exécution non envoyés à la réception d'une **Demande de réexpédition** du client pour les numéros de séquence manquants. Si les transactions ont lieu pendant que la session FIX est en panne, le numéro de séquence de sortie de Nasdaq Canada sera plus élevé que prévu par le client.

Le client est responsable de la détection des lacunes dans les messages transmis par Nasdaq Canada qui ont pu être perdus lors de la session précédente, selon le protocole FIX. Nasdaq Canada retransmettra ces messages à la demande du client.

5 MESSAGES D'APPLICATION

Cette section traite des messages FIX envoyés et acceptés par Nasdaq Canada au niveau de l'application.

5.1 Symbologie

Nasdaq Canada ne prend en charge que l'identificateur de nom d'action local/boursier dans les messages FIX.

5.2 Inscription d'un ordre

5.2.1 Client

Nasdaq Canada prend actuellement en charge les messages **Nouvel ordre unique, Demande d'annulation d'ordre, Demande d'annulation et de remplacement d'ordre** de FIX.

5.2.1.1 Nouvel ordre unique

En plus des champs d'en-tête standard, de fin et de définition de symbole acceptés par Nasdaq Canada, Nasdaq Canada traite uniquement les champs suivants dans un message **Nouvel ordre unique** et ignore tous les autres champs :

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
1	Account	N	Identifie le compte de négociation. Maximum of 32 caractères.
11	ClOrdID	Y	Doit être unique pour chaque ordre tout au long de la journée de négociation, pour tous les titres et côtés d'un même ID de session FIX. Remarque : Un serveur FIX ne vérifie pas nécessairement l'unicité de ClOrdID. Maximum of 32 caractères.
18	ExecInst	N	Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada (certaines valeurs peuvent être combinées et doivent être séparées par un espace) : G = Tout ou Rien (AON) P = Indexation au marché M = Indexation au prix médian L = M-ELO (CXC seulement) R = Indexation primaire f = DAO (Non prise en charge dans CXD) m= Quantité minimale acceptable – pour un ordre apparié au seuil (CXD seulement) (nécessite la balise 110 et TimeInForce(59) = 3) t= Quantité minimale – pour un ordre apparié au seuil (CXD seulement) (nécessite la balise 110 et TimeInForce(59) = 3) x = Amélioration de prix minimale z = Quantité minimale (MQ) (balise 110 requise) o = ordre de lots irréguliers pour l'ajout de liquidités (OLP) (CXD seulement) Remarque : Toute autre valeur sera ignorée. Les ordres de DAO à CXD seront acceptés, mais les DAO seront ignorés.
21	HandlInst	Y	Instructions pour le traitement de l'ordre dans le système de négociation de Nasdaq Canada. Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada : 1 = Modification du prix OPR 5 = Annulation OPR 6 = Modification du prix OPR Toutes les autres valeurs seront modifiées à 1. La balise 18=f aura préséance sur toute valeur dans la balise 21 et l'ordre sera traité comme DAO.
38	OrderQty	Y	Quantité de l'ordre.

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
40	OrdType	Y	Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada : 1 = Marché 2 = Limite 5 = Marché à la clôture (exige TimeInForce(59) = 0) B = Limite à la clôture (SOR seulement) P = Indexé (exige ExecInst de M, R, P ou x) Remarque : Toute autre valeur entraînera le rejet de l'ordre.
44	Prix	N	Obligatoire pour les ordres limite. S'il est inclus dans un ordre au marché, l'ordre sera rejeté.
54	Côté	Y	Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada : 1 = Acheter 2 = Vendre 5 = Vendre à découvert Remarque : Toute autre valeur entraînera le rejet de l'ordre.
55	Symbole	Y	Symbole local/boursier seulement
57	TargetSubid	N	Indique comment l'ordre doit être acheminé : CHIX CX2 CXD Stratégies Smart Order Router (SOR) : Les valeurs seront fournies par Nasdaq Canada Operations après la certification. Une valeur valide est requise dans TargetSubid (57) ou ExDestination (100).

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
59	TimeInForce	N	L'absence de ce champ indique un ordre journalier. Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada : 0 = Jour (Défaut) 1 = Bon jusqu'à annulation (GTC) – Traité comme un ordre de jour et expire à la fin de la journée. 2 = À l'ouverture (OPG) – Traité comme un ordre de jour et expire à la fin de la journée. 3 = Immédiat ou annuler – La plus grande partie possible de l'ordre doit être exécutée immédiatement. Toute partie de l'ordre qui n'est pas exécutée immédiatement est annulée. 4 = Exécuter ou annuler (FOK) – L'ordre doit être exécuté dans son intégralité immédiatement ou annulé. 6 = Bon jusqu'à date (GTD) – La date doit être la date de négociation d'aujourd'hui. Cette zone doit être utilisée conjointement avec la zone ExpireTime (identification de zone 126). 7 = À la clôture – Exige OrdType(40)=1 pour MOC ou OrdType(40)=2 pour LOC. Ne peut être utilisé en combinaison avec OrdType(40)=5 ou OrdType(40)=B. Les ordres LOC seront acheminés au TSX lorsqu'on utilise le SOR de Nasdaq Canada. 8 = Stream Or Kill (SOK) – L'ordre est immédiatement jumelé dans un flux ou est annulé. (CXD PureStream uniquement) P = Ordre pour inscription uniquement Les ordres d'une journée sont en vigueur jusqu'à ce que le client annule l'ordre ou jusqu'à ce que le système de négociation de Nasdaq Canada soit fermé pour l'entretien de nuit de Nasdaq Canada. Remarque : Toute autre valeur entraînera le rejet de l'ordre.
60	TransactTime	Y	Heure à laquelle cette demande d'ordre a été initiée par le client.
100	ExDestination	N	Indique comment l'ordre doit être acheminé : CHIX CX2 CXD Stratégies Smart Order Router (SOR) : Les valeurs seront fournies par Nasdaq Canada Operations après la certification. Une valeur valide est requise dans TargetSubid (57) ou ExDestination (100).

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
110	MinQty	N	Quantité Minimale (MQ) : Quantité minimale de chaque événement d'exécution permettant l'agrégation des ordres de contrepartie. Quantité minimale acceptable (QMA) : Quantité minimale de chaque rapport d'exécution. Les ordres n'interagiront pas avec des ordres de contrepartie de plus petite taille. (par défaut, utiliser la balise 18 pour sélectionner MQ) L'ordre sera rejeté si Bypass=Y est combiné avec MinQty.
111	MaxFloor	N	Ordre de taille de réserve. Doit être égal à ou un multiple de STU (Standard Trading Unit) Ordre masqué : Une valeur de 0 masque l'ordre Toute autre valeur fournie par le client entraînera le rejet de l'ordre. (Non pris en charge sur CXD)
126	ExpireTime	N	Heure/Date d'expiration de l'ordre en GMT. Valable uniquement lorsque TimeInForce (59) = 6 (Bon jusqu'à date). La date doit être la date de négociation d'aujourd'hui. Des données erronées entraînent un refus de l'ordre.
211	PegDifference	N	Montant en dollars par tranches de 0,01 \$ ajouté au prix d'indexation. Les valeurs positives sont plus agressives, les valeurs négatives plus passives.
847	TargetStrategy	N	1000 = Taux de référence Plage de 5-15 % 1001 = Taux de référence Plage de 5-30 % 1002 = Plage de taux de référence Mach2 de 10 à 200 % 1003 = Plage de fréquence de référence personnalisée de X-Y % 1004 = Recherche de liquidité (LS) Plage de taux de référence sans restriction. Requis pour les ordres CXD PureStream.
1724	OrderOrigination	N	Le courtier doit faire rapport, comme il est précisé par le client 5 = Ordre reçu d'un client à accès direct (DEA) 6 = Ordre reçu d'un équivalent de courtier étranger (FDE) 7 = Ordre reçu d'un service d'exécution seulement (OEO)
2883	RoutingArrangement Indicator	N	0 = Pas d'accord d'acheminement en place 1 = Accord d'acheminement en place

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
6750	UMIRAccountType	Y	Obligatoire pour la déclaration réglementaire canadienne. CL = Client (Défaut) NC = Non-Client ST = Spécialiste IN = Inventaire OF = Compte ferme options OT = Teneur de marché options BU = Regroupé MC = Clients multiples Remarque : Si non spécifié, la valeur par défaut s'applique
6751	UMIRUserID	Y	Obligatoire pour la déclaration réglementaire canadienne, le code d'utilisateur du système de négociation pour le négociateur.
6754	BasketTrade	N	Identification d'ordre dans le cadre d'une opération sur panier : N = Non (Défaut) 1* 5Chiffres = Numéro de panier
6755	ProgramTrade	N	Un ordre qui fait partie d'une transaction de panier composée de titres indiciaires pour compenser une position sur contrats à terme standardisés ou d'options. Y = Oui N = Non (Défaut)
6757	Jitney	N	Pour marquer un ordre comme étant exécuté pour le compte d'un autre courtier : Numéro de courtier TSX, 3 chiffres.
6759	GEFEligible	N	Indicateur pour établir si un ordre est admissible à la Fonction d'exécution garantie (FEG). Y = L'ordre est admissible à la FEG
6761	Anonymous	N	Si le numéro de courtier TSX doit être masqué dans le carnet d'ordres et l'exécution. Y = Oui N = Non (Défaut)
6763	UMIRRegulationID	N	Marqueur d'identification pour les désignations propres aux RUIM des ordres et des opérations. IA = Compte d'initié NA = Sans objet SS = Actionnaire important
6791	Bypass	N	Le marqueur d'ordre qui indique que l'ordre ne doit traiter que dans les volumes affichés, c'est-à-dire ignorer les quantités masquées. Ces ordres sont traités comme des ordres COI. "Y" "N"; par défaut "N" (Non pris en charge dans CXD). L'ordre sera rejeté si Bypass=Y est combiné avec MinQty.

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
7713	NoTradeFeat	N	Définit le comportement de prévention de l'autonégociation lors de l'utilisation de NoTradeKey. 2 caractères (non séparés par un espace) : 1^{er} caractère : N = Annuler l'ordre le plus récent (l'ordre actif est annulé) (Défaut) O = Annuler l'ordre le plus ancien (l'ordre au repos est annulé et l'inscription du nouvel ordre est autorisée) D = Décroître et annuler (la quantité du plus grand ordre est réduite et les ordres plus petits sont annulés) E = Exécuter transaction (La transaction est empêchée dans le flux de données de marché public) Field ExecuteMatch (7733) apparaît dans le message Rapport de transaction. 2^e caractère : M ou B = Prévention d'autonégociation au niveau courtier (seuls les ordres portant le même numéro de courtier sont interdits de confrontation) (Défaut) Le NoTradeFeat de l'ordre entrant a préséance.
7714	NoTradeKey	N	Cette clé générée par le participant empêche l'ordre de se négocier contre des ordres ayant la même valeur de clé. 6*Alphanumérique, pas de défaut
7729	ShortMarkingExempt	N	Identifie un ordre comme Exempt d'identification à découvert (SME). N'est pas valable pour les ordres de vente à découvert. 0 = SME
7731	SeekPriceImprovement	N	1 = Négociation avec des ordres masqués avec amélioration du cours (l'ordre doit être immédiat ou annuler)
7737	POComment	N	Une balise de transfert de forme libre mise à la disposition des Participants. Maximum of 32 caractères.
8020	DisplayRange	N	Quantité assignée aux ordres à plancher maximum indiquant la plage dans laquelle la quantité affichée augmentera ou diminuera de façon aléatoire. (Non pris en charge sur CXD)
8025	CustomerAccount	N	Numéro de compte pour les clients non admissibles à l'obtention d'un identifiant d'entité juridique (LEI) 20 Alphanumérique
8026	AlgorithmID	N	Identifiant unique pour le client final (ordres automatiquement générés sur une base prédéterminée) 20 Alphanumérique
8027	CustomerLEI	N	LEI pour les clients admissibles à l'obtention d'un LEI, y compris le LEI de l'équivalent de courtier étranger (cryptage requis) 52 Alphanumérique

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
8028	BrokerLEI	N	Courtier membre de l'OCRCVM d'une organisation non participante (Courtier correspondant) 20 Alphanumérique
23012	ConditionalOrder	N	C = Ordre conditionnel F = Indicateur de raffermisssement de l'ordre conditionnel CXD PureStream uniquement
23013	AllowConditional	N	Y = Oui N = Non (par défaut) Ordres CXD PureStream IOC/SOK uniquement
23014	FirmUpID	N	Le FirmUpID reçu en correspondance conditionnelle
27005	MinRate	N	Taux minimum pour les ordres CXD PureStream Custom Reference Rate Range (847=1003) et LS (847=1004) Spécifié en pourcentage sous forme de nombre entier (par exemple, 5 % doit être envoyé sous la forme 27005=5) Par défaut 1 % si non spécifié (Min 1%, Max 32 767%) Doit être inférieur ou égal à MaxRate<27006>
27006	MaxRate	N	Taux maximum requis pour les ordres CXD PureStream Custom Reference Rate Range (847=1003) Spécifié en pourcentage sous forme de nombre entier (par exemple, 5 % doit être envoyé sous la forme 27005=5) (Min 1%, Max 500%) Doit être supérieur ou égal à MinRate<27005>

5.2.1.2 Demande d'annulation d'ordre

Nasdaq Canada traite une quantité de demande d'annulation comme la quantité restante totale. Nasdaq Canada ne prend pas en charge les annulations partielles.

En plus des champs d'en-tête standard, de fin et de définition de symbole acceptés par Nasdaq Canada, Nasdaq Canada traite uniquement les champs suivants dans un message de **Demande d'annulation d'ordre** et ignore tous les autres champs :

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
11	ClOrdID	Y	ID unique de demande d'annulation assigné par le client. Maximum of 32 caractères.
38	OrderQty	Y	Requise par le protocole FIX, ignorée par Nasdaq Canada. Toutes les demandes d'annulation correspondent à la quantité totale restante.
41	OrigClOrdID	Y	ID unique de l'ordre original à annuler, assigné par le client. Maximum of 32 caractères.

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
54	Côté	Y	
55	Symbole	Y	
60	TransactTime	Y	Heure à laquelle cette demande d'ordre a été initiée par le client.

5.2.1.3 Demande d'annulation/remplacement d'ordre

Les demandes d'annulation/remplacement sont traitées selon le protocole FIX. Les demandes d'annulation/remplacement qui ne peuvent pas être traitées seront rejetées à l'aide du message **Rejet d'annulation**. Si Nasdaq Canada rejette la demande d'annulation/remplacement, le numéro *ClOrdID* de l'ordre de remplacement sera inséré dans le champ *ClOrdID* du message Rejet d'annulation à des fins d'identification.

En plus des champs d'en-tête standard, de fin et de définition de symbole acceptés par Nasdaq Canada, Nasdaq Canada traite uniquement les champs suivants dans un message **Demande d'annulation/remplacement d'ordre** et ignore tous les autres champs.

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
11	ClOrdID	Y	ID unique de l'ordre de remplacement assigné par le client. Maximum of 32 caractères.
18	ExecInst	N	Pour un ordre de remplacement, ce champ doit être rempli à nouveau (c.-à-d. que les valeurs de l'ordre d'origine ne seront pas reportées à l'ordre de remplacement à moins qu'elles ne soient redéfinies dans ce message).
21	HandlInst	Y	
38	OrdQty	Y	Remarque : La quantité dans le message Annuler/Remplacer correspond à la quantité totale de l'ordre, telle que définie par le protocole FIX et la sémantique de la quantité totale de l'ordre. Veuillez consulter l'annexe A pour de plus amples renseignements.
40	OrdType	Y	Type du nouvel ordre pour la requête. Valeurs prises en charge : 1 = Marché 2 = Limite P = Indexé (exige ExecInst de M, R, P ou x)
41	OrigClOrdID	Y	ID unique de l'ordre à remplacer assigné par le client. Maximum of 32 caractères.
44	Prix	N	Requis pour les ordres Limite
54	Côté	Y	
55	Symbole	Y	
59	TimeInForce	N	L'absence indique un ordre de jour

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
60	TransactTime	Y	Heure à laquelle cette demande d'ordre a été initiée par le client.
110	MinQty	N	Voir la section Nouvel ordre unique.
111	MaxFloor	N	Voir la section Nouvel ordre unique.
126	ExpireTime	N	Si le client tente de modifier l'heure d'expiration à une date antérieure à l'heure actuelle, la demande d'annulation/remplacement sera rejetée.
847	TargetStrategy	N	Voir la section Nouvel ordre unique.
1724	OrderOrigination	N	Le courtier doit faire rapport, comme il est précisé par le client 5 = Ordre reçu d'un client à accès direct (DEA) 6 = Ordre reçu d'un équivalent de courtier étranger (FDE) 7 = Ordre reçu d'un service d'exécution seulement (OEO)
2883	RoutingArrangement Indicator	N	0 = Pas d'accord d'acheminement en place 1 = Accord d'acheminement en place
6763	UMIRRegulationID	N	Marqueur d'identification pour les désignations propres aux RUIM des ordres et des opérations. IA = Compte d'initié NA = Sans objet SS = Actionnaire important
6761	Anonymous	N	Si le numéro de courtier TSX doit être masqué dans le carnet d'ordres et l'exécution. Y = Oui N = Non (Défaut)
8020	DisplayRange	N	Quantité assignée aux ordres à plancher maximum indiquant la plage dans laquelle la quantité affichée augmentera ou diminuera de façon aléatoire. (Non pris en charge sur CXD)
8025	CustomerAccount	N	Numéro de compte pour les clients non admissibles à l'obtention d'un identifiant d'entité juridique (LEI) 20 Alphanumérique
8026	AlgorithmID	N	Identifiant unique pour le client final (ordres automatiquement générés sur une base prédéterminée) 20 Alphanumérique
8027	CustomerLEI	N	LEI pour les clients admissibles à l'obtention d'un LEI, y compris le LEI de l'équivalent de courtier étranger (cryptage requis) 52 Alphanumérique
8028	BrokerLEI	N	Courtier membre de l'OCRCVM d'une organisation non participante (Courtier correspondant) 20 Alphanumérique
23012	ConditionalOrder	N	Voir la section Nouvel ordre unique.

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
23013	AllowConditional	N	Voir la section Nouvel ordre unique.
27005	MinRate	N	Voir la section Nouvel ordre unique.
27006	MaxRate	N	Voir la section Nouvel ordre unique.

5.2.2 Messages d'inscription d'ordre de Nasdaq Canada

5.2.2.1 Réponse à Nouvel ordre unique

En plus des champs d'en-tête standard, de fin et de définition de symbole acceptés par Nasdaq Canada, Nasdaq Canada fournira les champs suivants dans un message **Rapport d'exécution** en réponse à une demande de Nouvel ordre unique.

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
6	AvgPx	Y	Cours moyen de toutes les actions échangées. Par défaut à 0 pour les confirmations d'ordre.
11	ClOrdID	N	Nasdaq Canada remplit toujours ce champ avec la valeur assignée par le client dans le message Nouvel ordre unique.
14	CumQty	Y	Nombre total d'actions échangées par rapport à la quantité de l'ordre initial Par défaut à 0 pour les confirmations d'ordre. Par défaut à 0 pour les confirmations d'ordre.
15	Devise	N	Devise associée au symbole dans le champ Symbol (55)
17	ExecID	Y	Identificateur unique de message d'exécution assigné par Nasdaq Canada.

Bal.	Nom du champ	Obl	Commentaires
18	ExecInst	N	Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada (certaines valeurs peuvent être combinées et doivent être séparées par une espace) : G = Tout ou Rien (AON) P = Indexation au marché M = Indexation au prix médian R = Indexation primaire L = M-ELO (CXC seulement) f = DAO (Non prise en charge dans CXD) m= Quantité minimale acceptable – pour un ordre apparié au seuil (CXD seulement) (nécessite la balise 110 et TimeInForce(59) = 3) t= Quantité minimale – pour un ordre apparié au seuil (CXD seulement) (nécessite la balise 110 et TimeInForce(59) = 3) x = Amélioration de prix minimale z = Quantité minimale (MQ) (balise 110 requise) o = ordre de lots irréguliers pour l'ajout de liquidités (OLP) (CXD seulement) Remarque : Toute autre valeur sera ignorée. Les ordres de DAO à CXD seront acceptés, mais les DAO seront ignorés.
20	ExecTransType	Y	0 = Nouveau
21	HandlInst	Y	Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada : 1 = Modification du prix OPR 5 = Annulation OPR 6 = Modification du prix OPR
22	SecurityIDSource	N	Identifie la classe ou source de la valeur SecurityID (48). (Copie de sécurité seulement) Valeur prise en charge par Nasdaq Canada : 1=CUSIP
31	LastPx	Y	Par défaut à 0 pour les confirmations d'ordre.
32	LastShares	Y	Par défaut à 0 pour les confirmations d'ordre.
35	MsgType	Y	8 = Rapport d'exécution
37	OrderID	Y	Numéro de référence d'ordre de Nasdaq Canada.
38	OrderQty	Y	Quantité de l'ordre original.

Bal.	Nom du champ	Obl	Commentaires
39	OrdStatus	Y	0 = Nouveau 5 = Remplacé 8 = Rejeté
40	OrdType	N	Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada : 1 = Marché 2 = Limite 5 = Marché à la clôture B = Limite à la clôture (SOR seulement) P = Indexé (exige ExecInst de M, R, P ou x)
44	Prix	N	Prix limite Obligatoire pour les ordres limite seulement.
48	SecurityID	N	Valeur de l'identificateur de sécurité du type de SecurityIDSource (22). (Copie de sécurité seulement)
54	Côté	Y	Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada : 1 = Acheter 2 = Vendre 5 = Vendre à découvert
55	Symbole	Y	Symbole local/bourse
59	TimeInForce	N	Apparaîtra dans la réponse s'il a été fourni dans le message original Nouvel ordre unique.
63	SettlType	N	Conditions de règlement de l'ordre : 1 = Espèces (T+0) 2 = Jour suivant (T+1) 6 = Futur (utilisé en combinaison avec SettlDate (64))
64	SettlDate	N	Date précise du règlement de l'opération au format AAAAMMJJ. Ce champ apparaît dans la réponse si la valeur de SettlType (63) est 6.
76	ExecBroker	N	Valeurs possibles : CHIX, CX2, CXD, TSX, PURE, ALPH, MATCH, OMGA, LYNX, AEQN, AEQL, CSE2
103	OrdRejReason	N	Utilisé avec OrdStatus = 8 (Rejeté) si la raison peut être définie.
150	ExecType	Y	0 = Nouveau 5 = Remplacé 8 = Rejeté
151	LeavesQty	Y	Nombre d'actions qui demeure pour exécution.

Bal.	Nom du champ	Obl	Commentaires
198	SecondaryOrderID	N	S'il est présent, le numéro d'ordre de NASDAQ tel qu'il apparaît dans le flux de données de marché (CHIXMD); autrement, utiliser la balise 37.
847	TargetStrategy	N	1000 = Taux de référence Plage de 5-15 % 1001 = Taux de référence Plage de 5-30 % 1002 = Plage de taux de référence Mach2 de 10 à 200 % 1003 = Plage de fréquence de référence personnalisée de X-Y % 1004 = Recherche de liquidité (LS) Plage de taux de référence sans restriction. Requis pour les ordres CXD PureStream.
1724	OrderOrigination	N	Le courtier doit faire rapport, comme il est précisé par le client 5 = Ordre reçu d'un client à accès direct (DEA) 6 = Ordre reçu d'un équivalent de courtier étranger (FDE) 7 = Ordre reçu d'un service d'exécution seulement (OEO)
2883	RoutingArrangementIndicator	N	0 = Pas d'accord d'acheminement en place 1 = Accord d'acheminement en place
6750	UMIRAccountType	Y	Obligatoire pour la déclaration réglementaire canadienne. CL = Client (Défaut) NC = Non-Client ST = Spécialiste IN = Inventaire OF = Compte ferme options OT = Teneur de marché options BU = Regroupé MC = Clients multiples Remarque : Si non spécifié, la valeur par défaut s'applique
6751	UMIRUserID	Y	Obligatoire pour la déclaration réglementaire canadienne, le code d'utilisateur du système de négociation pour le négociateur.
6757	Jitney	N	Pour marquer un ordre comme étant exécuté pour le compte d'un autre courtier : Numéro de courtier TSX, 3 chiffres.
6761	Anonymous	N	Si le numéro de courtier TSX doit être masqué dans le carnet d'ordres et l'exécution. Y = Oui N = Non (Défaut)

Bal.	Nom du champ	Obl	Commentaires
6759	GEFEligible	N	Indicateur pour établir si un ordre est admissible à la Fonction d'exécution garantie (FEG). Y = L'ordre est admissible à la FEG
6763	UMIRRegulationID	N	Marqueur d'identification pour les désignations propres aux RUIM des ordres et des opérations. IA = Compte d'initié NA = Sans objet SS = Actionnaire important
6791	Bypass	N	Apparaîtra dans la réponse s'il a été fourni dans le message original Nouvel ordre unique.
6774	Numéro de courtier	N	Numéro de courtier TSX, 3 chiffres. (Copie de sécurité seulement)
7729	ShortMarkingExempt	N	Apparaîtra dans la réponse s'il a été fourni dans le message original Nouvel ordre unique.
7731	SeekPriceImprovement	N	1 = Négociation avec des ordres masqués avec amélioration du cours
7737	POComment	N	Une balise de transfert de forme libre mise à la disposition des Participants. Maximum of 32 caractères.
8114	RepriceReason	N	Rempli avec un code de raison si le prix de l'ordre est modifié : 1 = Prix modifié pour éviter transaction 2 = Prix modifié pour éviter verrouillage 3 = Prix modifié pour éviter opération croisée 4 = Prix modifié pour les planchers du marché
8115	NBBOSetter	N	L'ordre fixe le MCAVN Valeur(s) prise(s) en charge par Nasdaq Canada : Y = L'ordre fixe le MCAVN
8025	CustomerAccount	N	Numéro de compte pour les clients non admissibles à l'obtention d'un identifiant d'entité juridique (LEI) 20 Alphanumérique
8026	AlgorithmID	N	Identifiant unique pour le client final (ordres automatiquement générés sur une base prédéterminée) 20 Alphanumérique
8027	CustomerLEI	N	LEI pour les clients admissibles à l'obtention d'un LEI, y compris le LEI de l'équivalent de courtier étranger (cryptage requis) 52 Alphanumérique
8028	BrokerLEI	N	Courtier membre de l'OCRCVM d'une organisation non participante (Courtier correspondant) 20 Alphanumérique

Bal.	Nom du champ	Obl	Commentaires
9688	OrigSendercompID	N	SenderCompID de la session d'inscription de l'ordre à l'origine. (Copie de sécurité seulement)
23012	ConditionalOrder	N	C = Ordre conditionnel F = Indicateur de raffermisssement de l'ordre conditionnel CXD PureStream uniquement
23013	AllowConditional	N	Y = Oui N = Non (par défaut) Ordres CXD PureStream IOC/SOK uniquement
23014	FirmUpID	N	Le FirmUpID reçu en correspondance conditionnelle
27005	MinRate	N	Taux minimum pour les ordres CXD PureStream Custom Reference Rate Range (847=1003) et LS (847=1004) Spécifié en pourcentage sous forme de nombre entier (par exemple, 5 % doit être envoyé sous la forme 27005=5) Par défaut 1 % si non spécifié (Min 1%, Max 32 767%) Doit être inférieur ou égal à MaxRate<27006>
27006	MaxRate	N	Taux maximum requis pour les ordres CXD PureStream Custom Reference Rate Range (847=1003) Spécifié en pourcentage sous forme de nombre entier (par exemple, 5 % doit être envoyé sous la forme 27005=5) (Min 1%, Max 500%) Doit être supérieur ou égal à MinRate<27005>

5.2.2.2 Confirmation d'annulation d'ordre

En plus des champs d'en-tête standard, de fin et de définition de symbole acceptés par Nasdaq Canada, Nasdaq Canada fournira les champs suivants dans un message **Rapport d'exécution** en réponse à une demande d'annulation ou d'annulation/remplacement d'ordre acceptée par Nasdaq Canada.

Bal.	Nom du champ	Obl	Commentaires
6	AvgPx	Y	Cours moyen de toutes les actions échangées.
11	ClOrdID	N	Nasdaq Canada remplit toujours ce champ avec la valeur assignée par le client dans le message Nouvel ordre unique.
14	CumQty	Y	Nombre total d'actions échangées par rapport à la quantité de l'ordre initial Par défaut à 0 pour les confirmations d'ordre.

Bal.	Nom du champ	Obl	Commentaires
15	Devise	N	Devise associée au symbole dans le champ Symbol (55).
17	ExecID	Y	Identificateur unique de message d'exécution assigné par Nasdaq Canada.
18	ExecInst	N	Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada (certaines valeurs peuvent être combinées et doivent être séparées par une espace) : G = Tout ou Rien (AON) P = Indexation au marché M = Indexation au prix médian R = Indexation primaire L = M-ELO (CXC seulement) f = DAO (Non prise en charge dans CXD) m= Quantité minimale acceptable – pour un ordre apparié au seuil (CXD seulement) (nécessite la balise 110 et TimeInForce(59) = 3) t= Quantité minimale – pour un ordre apparié au seuil (CXD seulement) (nécessite la balise 110 et TimeInForce(59) = 3) x = Amélioration de prix minimale z = Quantité minimale (MQ) (balise 110 requise) o = ordre de lots irréguliers pour l'ajout de liquidités (OLP) (CXD seulement) Remarque : Toute autre valeur sera ignorée. Les ordres de DAO à CXD seront acceptés, mais les DAO seront ignorés.
20	ExecTransType	Y	0 = Nouveau
21	HandlInst	Y	Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada : 1 = Modification du prix OPR 5 = Annulation OPR 6 = Modification du prix OPR
22	SecurityIDSource	N	Identifie la classe ou source de la valeur SecurityID (48). (Copie de sécurité seulement) Valeur prise en charge par Nasdaq Canada : 1=CUSIP
31	LastPx	Y	Par défaut à 0 pour les annulations d'ordre. Prix auquel l'appariement se serait produit s'il n'avait pas été empêché lors de l'annulation/remplacement par la non-autonégociation.

Bal.	Nom du champ	Obl	Commentaires
32	LastShares	Y	Par défaut à 0 pour les annulations d'ordre. Quantité d'actions qui aurait été appariée si la transaction n'avait pas été empêchée lors de l'annulation/remplacement par la non-autonégociation.
35	MsgType	Y	8 = Rapport d'exécution
37	OrderID	Y	Numéro de référence d'ordre de Nasdaq Canada.
38	OrderQty	Y	Quantité de l'ordre original.
39	OrdStatus	Y	4 = Annulé
40	OrdType	N	Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada : 1 = Marché 2 = Limite 5 = Marché à la clôture B = Limite à la clôture (SOR seulement) P = Indexé (exige ExecInst de M, R, P ou x)
41	OrigClOrdID	Y	ID unique de l'ordre original à annuler, assigné par le client.
44	Prix	N	Prix limite
48	SecurityID	N	Valeur de l'identificateur de sécurité du type de SecurityIDSource (22). (Copie de sécurité seulement)
54	Côté	Y	Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada : 1 = Acheter 2 = Vendre 5 = Vendre à découvert
55	Symbole	Y	Symbole local/bourse
59	TimeInForce	N	Apparaîtra dans la réponse s'il a été fourni dans le message original. Nouvel ordre unique.
150	ExecType	Y	4 = Annulé
151	LeavesQty	Y	Nombre d'actions qui demeure pour exécution.
6751	UMIRUserID	Y	Obligatoire pour la déclaration réglementaire canadienne, le code d'utilisateur du système de négociation pour le négociateur.
6761	Anonymous	N	Si le numéro de courtier TSX doit être masqué dans le carnet d'ordres et l'exécution. Y = Oui N = Non (Défaut)

Bal.	Nom du champ	Obl	Commentaires
6763	UMIRRegulationID	N	Marqueur d'identification pour les désignations propres aux RUIM des ordres et des opérations. IA = Compte d'initié NA = Sans objet SS = Actionnaire important
6791	Bypass	N	Apparaîtra dans la réponse s'il a été fourni dans le message original Nouvel ordre unique.
6774	Numéro de courtier	N	Numéro de courtier TSX, 3 chiffres. (Copie de sécurité seulement)
7729	ShortMarkingExempt	N	Apparaîtra dans la réponse s'il a été fourni dans le message original Nouvel ordre unique.
7731	SeekPriceImprovement	N	1 = Négociation avec des ordres masqués avec amélioration du cours
7737	POComment	N	Une balise de transfert de forme libre mise à la disposition des Participants. Maximum of 32 caractères.
9688	OrigSendercompID	N	SenderCompID de la session d'inscription de l'ordre à l'origine. (Copie de sécurité seulement)

Bal.	Nom du champ	Obl	Commentaires
9882	TradeLiquidityIndicator	N	Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada : A = L'ordre a ajouté de la liquidité R = L'ordre a retiré de la liquidité a = L'ordre a ajouté de la liquidité masquée r = L'ordre a retiré de la liquidité masquée d = L'ordre a ajouté de la liquidité masquée à la touche D = L'ordre a retiré de la liquidité masquée apparié au seuil g = L'ordre a ajouté à la liquidité masquée de la FEG G = L'ordre a retiré GEF de la liquidité masquée de la FEG S = Ordre affiché ajoutant de la liquidité qui améliore le MCAVN O = Enchère d'ouverture/de clôture E = Séance de négociation de la dernière vente (TSX/TSXV) L = M-ELO P = exécution résultante d'un flux CXD PureStream m = CXD PureStream LS bloc prix médian a ajouté à la liquidité M = CXD PureStream LS bloc prix médian a retiré de la liquidité Indicateur de liquidité si l'appariement avait eu lieu s'il n'avait pas été empêché lors de l'annulation/remplacé en raison de l'absence d'autonégociation.
23012	ConditionalOrder	N	C = Ordre conditionnel F = Indicateur de raffermisssement de l'ordre conditionnel CXD PureStream uniquement
23013	AllowConditional	N	Y = Oui N = Non (par défaut) Ordres CXD PureStream IOC/SOK uniquement
23014	FirmUpID	N	Le FirmUpID reçu en correspondance conditionnelle
27005	MinRate	N	Taux minimum pour les ordres CXD PureStream Custom Reference Rate Range (847=1003) et LS (847=1004) Spécifié en pourcentage sous forme de nombre entier (par exemple, 5 % doit être envoyé sous la forme 27005=5) Par défaut 1 % si non spécifié (Min 1%, Max 32 767%) Doit être inférieur ou égal à MaxRate<27006>

Bal.	Nom du champ	Obl	Commentaires
27006	MaxRate	N	Taux maximum requis pour les ordres CXD PureStream Custom Reference Rate Range (847=1003) Spécifié en pourcentage sous forme de nombre entier (par exemple, 5 % doit être envoyé sous la forme 27005=5) (Min 1%, Max 500%) Doit être supérieur ou égal à MinRate<27005>

5.2.2.3 Rejet d'Annulation d'ordre et d'Annulation/remplacement d'ordre

En plus des champs d'en-tête standard, de fin et de définition de symbole acceptés par Nasdaq Canada, Nasdaq Canada fournira les champs suivants dans un message Annuler le rejet en réponse à une demande d'annulation d'ordre qui est rejetée.

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
11	ClOrdID	Y	Nasdaq Canada remplira toujours ce champ avec la valeur assignée par le client dans le message Annuler ou Annuler/Remplacer l'ordre.
35	MsgType	Y	9 = Rejet d'annulation d'ordre
37	OrderID	Y	Numéro de référence d'ordre de Nasdaq Canada.
39	OrdStatus	Y	Valeur OrdStatus une fois que le rejet d'annulation est appliqué.
41	OrigClOrdID	Y	Nasdaq Canada remplira toujours ce champ avec la valeur assignée par le client dans le dernier message accepté de Nouvel ordre unique ou Annuler/Remplacer.
58	Text	N	Raison du rejet de l'annulation.
66	ListID	N	Obligatoire pour les rejets d'ordres qui ont été soumis dans le cadre d'une liste.
434	CxlRejResponseTo	Y	Type de demande à laquelle ceci répond : 1= Demande d'annulation d'ordre 2= Demande d'annulation/remplacement d'ordre

5.2.2.4 Réponse au Remplacement

Veuillez consulter la section « Réponse à Nouvel ordre unique » pour savoir comment Nasdaq Canada répond aux demandes d'annulation/remplacement selon le protocole FIX.

5.2.2.5 Retraitement

Veuillez consulter la section « Retraitement » pour savoir comment Nasdaq Canada répond aux demandes d'annulation/remplacement selon le protocole FIX.

Bal.	Nom du champ	Obl	Commentaires
6	AvgPx	Y	Cours moyen de toutes les actions échangées. Par défaut à 0 pour les confirmations d'ordre.
11	ClOrdID	N	Nasdaq Canada remplit toujours ce champ avec la valeur assignée par le client dans le message Nouvel ordre unique.
14	CumQty	Y	Nombre total d'actions échangées par rapport à la quantité de l'ordre initial Par défaut à 0 pour les confirmations d'ordre. Par défaut à 0 pour les confirmations d'ordre.
15	Devise	N	Devise associée au symbole dans le champ Symbol (55)
17	ExecID	Y	Identificateur unique de message d'exécution assigné par Nasdaq Canada.
20	ExecTransType	Y	0 = Nouveau
21	HandlInst	Y	Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada : 1 = Modification du prix OPR 5 = Annulation OPR 6 = Modification du prix OPR
22	SecurityIDSource	N	Identifie la classe ou source de la valeur SecurityID (48). (Copie de sécurité seulement) Valeur prise en charge par Nasdaq Canada : 1=CUSIP
35	MsgType	Y	8 = Rapport d'exécution
37	OrderID	Y	Numéro de référence d'ordre de Nasdaq Canada.
38	OrderQty	Y	Quantité de l'ordre original.
39	OrdStatus	Y	4 = Annulé O = flux activé X = diffusion désactivée
40	OrdType	N	Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada : 1 = Marché 2 = Limite 5 = Marché à la clôture B = Limite à la clôture (SOR seulement) P = Indexé (exige ExecInst de M, R, P ou x)
44	Prix	N	Prix limite Obligatoire pour les ordres limite seulement.
48	SecurityID	N	Valeur de l'identificateur de sécurité du type de SecurityIDSource (22). (Copie de sécurité seulement)

Bal.	Nom du champ	Obl	Commentaires
54	Côté	Y	Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada : 1 = Acheter 2 = Vendre 5 = Vendre à découvert
55	Symbole	Y	Symbole local/bourse
59	TimeInForce	N	Apparaîtra dans la réponse s'il a été fourni dans le message original Nouvel ordre unique.
76	ExecBroker	N	Valeurs possibles : CHIX, CX2, CXD, TSX, PURE, ALPH, MATCH, OMGA, LYNX, AEQN, AEQL, CSE2
150	ExecType	Y	D = Retraité
151	LeavesQty	Y	Nombre d'actions qui demeure pour exécution.
198	SecondaryOrderID	N	S'il est présent, le numéro d'ordre de NASDAQ tel qu'il apparaît dans le flux de données de marché (CHIXMD); autrement, utiliser la balise 37.
847	TargetStrategy	N	1000 = Taux de référence Plage de 5-15 % 1001 = Taux de référence Plage de 5-30 % 1002 = Plage de taux de référence Mach2 de 10 à 200 % 1003 = Plage de fréquence de référence personnalisée de X-Y % 1004 = Recherche de liquidité (LS) Plage de taux de référence sans restriction. Requis pour les ordres CXD PureStream.
1724	OrderOrigination	N	Le courtier doit faire rapport, comme il est précisé par le client 5 = Ordre reçu d'un client à accès direct (DEA) 6 = Ordre reçu d'un équivalent de courtier étranger (FDE) 7 = Ordre reçu d'un service d'exécution seulement (OEO)
2883	RoutingArrangementIndicator	N	0 = Pas d'accord d'acheminement en place 1 = Accord d'acheminement en place

Bal.	Nom du champ	Obl	Commentaires
6750	UMIRAccountType	Y	Obligatoire pour la déclaration réglementaire canadienne. CL = Client (Défaut) NC = Non-Client ST = Spécialiste IN = Inventaire OF = Compte ferme options OT = Teneur de marché options BU = Regroupé MC = Clients multiples Remarque : Si non spécifié, la valeur par défaut s'applique
6751	UMIRUserID	Y	Obligatoire pour la déclaration réglementaire canadienne, le code d'utilisateur du système de négociation pour le négociateur.
6757	Jitney	N	Pour marquer un ordre comme étant exécuté pour le compte d'un autre courtier : Numéro de courtier TSX, 3 chiffres.
6761	Anonymous	N	Si le numéro de courtier TSX doit être masqué dans le carnet d'ordres et l'exécution. Y = Oui N = Non (Défaut)
6763	UMIRRegulationID	N	Marqueur d'identification pour les désignations propres aux RUIM des ordres et des opérations. IA = Compte d'initié NA = Sans objet SS = Actionnaire important
6774	Numéro de courtier	N	Numéro de courtier TSX, 3 chiffres. (Copie de sécurité seulement)
7729	ShortMarkingExempt	N	Apparaîtra dans la réponse s'il a été fourni dans le message original Nouvel ordre unique.
7731	SeekPriceImprovement	N	1 = Négociation avec des ordres masqués avec amélioration du cours
7737	POComment	N	Une balise de transfert de forme libre mise à la disposition des Participants. Maximum of 32 caractères.
8114	RepriceReason	N	Rempli avec un code de raison si le prix de l'ordre est modifié : 1 = Prix modifié pour éviter transaction 2 = Prix modifié pour éviter verrouillage 3 = Prix modifié pour éviter opération croisée 4 = Prix modifié pour les planchers du marché

Bal.	Nom du champ	Obl	Commentaires
8115	NBBOSetter	N	L'ordre fixe le MCAVN Valeur(s) prise(s) en charge par Nasdaq Canada : Y = L'ordre fixe le MCAVN
8025	CustomerAccount	N	Numéro de compte pour les clients non admissibles à l'obtention d'un identifiant d'entité juridique (LEI) 20 Alphanumérique
8026	AlgorithmID	N	Identifiant unique pour le client final (ordres automatiquement générés sur une base prédéterminée) 20 Alphanumérique
8027	CustomerLEI	N	LEI pour les clients admissibles à l'obtention d'un LEI, y compris le LEI de l'équivalent de courtier étranger (cryptage requis) 52 Alphanumérique
8028	BrokerLEI	N	Courtier membre de l'OCRCVM d'une organisation non participante (Courtier correspondant) 20 Alphanumérique
9688	OrigSendercompID	N	SenderCompID de la session d'inscription de l'ordre à l'origine. (Copie de sécurité seulement)
23012	ConditionalOrder	N	R = Demande de confirmation d'ordre conditionnel CXD PureStream uniquement
23013	AllowConditional	N	Y = Oui N = Non (par défaut) Ordres CXD PureStream IOC/SOK uniquement
23014	FirmUpID		ID ferme unique pour une correspondance conditionnelle
27005	MinRate	N	Taux minimum pour les ordres CXD PureStream Custom Reference Rate Range (847=1003) et LS (847=1004) Spécifié en pourcentage sous forme de nombre entier (par exemple, 5 % doit être envoyé sous la forme 27005=5) Par défaut 1 % si non spécifié (Min 1%, Max 32 767%) Doit être inférieur ou égal à MaxRate<27006>

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
27006	MaxRate	N	Taux maximum requis pour les ordres CXD PureStream Custom Reference Rate Range (847=1003) Spécifié en pourcentage sous forme de nombre entier (par exemple, 5 % doit être envoyé sous la forme 27005=5) (Min 1%, Max 500%) Doit être supérieur ou égal à MinRate<27005>

5.2.2.6 Rapport de transaction

NASDAQ envoie vos rapports de transactions via le message **Rapport d'exécution**. Le rapport de transaction donne des renseignements sur l'exécution des ordres, y compris : le cours moyen des actions négociées, le nombre total d'actions échangées par rapport à la quantité d'ordre originale, l'heure de transaction et la date de la transaction. Veuillez noter que cela n'inclut pas les données de règlement, comme la commission ou les renseignements fiscaux.

REMARQUE : L'*ExecID* est considéré comme l'identificateur unique d'un message d'exécution par Nasdaq Canada, selon le protocole FIX. Il est de la responsabilité du client de détecter et de traiter correctement les ExecIDs qui peuvent être en duplicata, que l'indicateur PossResend ait été activé ou non dans le message.

En plus des champs d'en-tête standard, de fin et de définition de symbole acceptés par Nasdaq Canada, Nasdaq Canada ne fournit que les champs suivants dans un **Rapport d'exécution** :

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
1	Account	N	Identifie le compte de négociation. Maximum of 32 caractères.
6	AvgPx	Y	Cours moyen de toutes les actions échangées.
11	ClOrdID	N	Nasdaq Canada remplit toujours ce champ avec la valeur initiale assignée par le client dans le message Nouvel ordre unique .
14	CumQty	Y	Nombre total d'actions négociées par rapport à la quantité de l'ordre original.
15	Devise	N	Devise dans laquelle le titre est négocié.
17	ExecID	Y	Identificateur unique de message d'exécution assigné par Nasdaq Canada.

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
18	ExecInst	N	Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada (certaines valeurs peuvent être combinées et doivent être séparées par une espace) : G = Tout ou Rien (AON) P = Indexation au marché M = Indexation au prix médian R = Indexation primaire L = M-ELO (CXD seulement) f = DAO (Non prise en charge dans CXD) m= Quantité minimale acceptable – pour un ordre apparié au seuil (CXD seulement) (nécessite la balise 110 et TimeInForce(59) = 3) t= Quantité minimale – pour un ordre apparié au seuil (CXD seulement) (nécessite la balise 110 et TimeInForce(59) = 3) x = Amélioration de prix minimale z = Quantité minimale (MQ) (balise 110 requise) o = ordre de lots irréguliers pour l'ajout de liquidités (OLP) (CXD seulement) Remarque : Toute autre valeur sera ignorée. Les ordres de DAO à CXD seront acceptés, mais les DAO seront ignorés.
19	ExecRefID	N	Utilisé dans un message d'annulation ou de correction de transaction (<i>ExecTransType</i> = 1 or 2) pour faire référence au Rapport d'exécution précédent auquel le message actuel s'applique.
20	ExecTransType	Y	Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada : 0 = Nouveau pour indiquer un rapport de transaction 1 = Annuler pour indiquer l'annulation d'une transaction 2 = Corriger pour indiquer la modification d'une transaction
22	SecurityIDSource	N	Identifie la classe ou source de la valeur SecurityID (48). (Copie de sécurité seulement) Valeur prise en charge par Nasdaq Canada : 1=CUSIP
31	LastPx	Y	Cours des actions achetées ou vendues à cette exécution.
32	LastShares	Y	Quantité d'actions achetées ou vendues à cette exécution.
37	OrderID	Y	Numéro de référence d'ordre de Nasdaq Canada.
38	OrderQty	Y	Quantité de l'ordre original.

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
39	OrdStatus	Y	1 = Partiellement exécuté 2 = Exécuté 4 = Annulé
40	OrdType	N	Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada : 1 = Marché 2 = Limite 5 = Marché à la clôture B = Limite à la clôture (SOR seulement) P = Indexé (exige ExecInst de M, R, P ou x)
44	Prix	N	Prix limite Obligatoire pour les ordres limite seulement.
48	SecurityID	N	Valeur de l'identificateur de sécurité du type de SecurityIDSource (22). (Copie de sécurité seulement)
54	Côté	Y	Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada : 1 = Acheter 2 = Vendre 5 = Vendre à découvert
55	Symbole	Y	Fait apparaître le symbole local/boursier du titre négocié.
59	TimeInForce	N	Apparaîtra dans la réponse s'il a été fourni dans le message original Nouvel ordre unique.
60	TransactTime	N	Heure et date d'exécution (exprimées en GMT).
63	SettlType	N	Conditions de règlement de l'ordre : 1 = Espèces (T+0) 2 = Jour suivant (T+1) 6 = Futur (utilisé en combinaison avec SettlDate (64))
64	SettlDate	N	Date précise du règlement de l'opération au format AAAAMMJJ. Ce champ est obligatoire si la valeur de SettlType (63) est 6.
75	TradeDate	N	Date de l'opération au format AAAAMMJJ.
76	ExecBroker	N	Valeurs possibles : CHIX, CX2, CXD, TSX, PURE, ALPH, MATCH, OMGA, LYNX, AEQN, AEQL, CSE2
150	ExecType	Y	1 = Partiellement exécuté 2 = Exécuté
151	LeavesQty	Y	Nombre d'actions qui demeure pour exécution.
198	SecondaryOrderID	N	S'il est présent, le numéro d'ordre de NASDAQ tel qu'il apparaît dans le flux de données de marché (CHIXMD); autrement, utiliser la balise 37.

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
207	SecurityExchange	Y	Bourse d'inscription du titre : XTSE = TSX XTSX = Bourse de croissance TSX XCNQ = CSE
375	ContraBroker	N	Numéro du courtier TSX du côté opposé de la transaction. Ne sera pas rempli si le courtier de contrepartie est anonyme.
382	NoContraBrokers	Y	Nombre de courtiers du côté opposé de la transaction. Ne sera pas rempli si le courtier de contrepartie est anonyme.
847	TargetStrategy	N	1000 = Taux de référence Plage de 5-15 % 1001 = Taux de référence Plage de 5-30 % 1002 = Plage de taux de référence Mach2 de 10 à 200 % 1003 = Plage de fréquence de référence personnalisée de X-Y % 1004 = Recherche de liquidité (LS) Plage de taux de référence sans restriction. Requis pour les ordres CXD PureStream.
1724	OrderOrigination	N	Le courtier doit faire rapport, comme il est précisé par le client 5 = Ordre reçu d'un client à accès direct (DEA) 6 = Ordre reçu d'un équivalent de courtier étranger (FDE) 7 = Ordre reçu d'un service d'exécution seulement (OEO)
2883	RoutingArrangementIndicator	N	0 = Pas d'accord d'acheminement en place 1 = Accord d'acheminement en place
6750	UMIRAccountType	Y	Obligatoire pour la déclaration réglementaire canadienne. CL = Client (Défaut) NC = Non-Client ST = Spécialiste IN = Inventaire OF = Compte ferme options OT = Teneur de marché options BU = Regroupé MC = Clients multiples Remarque : Si non spécifié, la valeur par défaut s'applique
6751	UMIRUserID	Y	Obligatoire pour la déclaration réglementaire canadienne, le code d'utilisateur du système de négociation pour le négociateur.

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
6757	Jitney	N	Pour marquer un ordre comme étant exécuté pour le compte d'un autre courtier : Numéro de courtier TSX, 3 chiffres.
6761	Anonymous	N	Si le numéro de courtier TSX doit être masqué dans le carnet d'ordres et l'exécution. Y = Oui N = Non (Défaut)
6763	UMIRRegulationID	N	Marqueur d'identification pour les désignations propres aux RUIM des ordres et des opérations. IA = Compte d'initié NA = Sans objet SS = Actionnaire important
6774	Numéro de courtier	N	Numéro de courtier TSX, 3 chiffres. (Copie de sécurité seulement)
6776	PrincipalTrade	N	Transaction de principal entre un courtier en valeurs mobilières et le compte d'un client du courtier. Y = Oui
6777	WashTrade	N	Transaction qui se produit entre comptes exclusifs d'une même firme membre. Y = Oui
6791	Bypass	N	Apparaîtra dans la réponse s'il a été fourni dans le message original Nouvel ordre unique.
7729	ShortMarkingExempt	N	Apparaîtra dans la réponse s'il a été fourni dans le message original Nouvel ordre unique.
7731	SeekPricImprovement	N	1 = Négociation avec des ordres masqués avec amélioration du cours
7733	ExecuteMatch	N	Transaction appariée et empêchée en raison de la non-autonégociation. Y = Oui
7737	POComment	N	Une balise de transfert de forme libre mise à la disposition des Participants. Maximum of 32 caractères.
8116	BrokerPref	N	Transaction appariée par préférence du courtier. Y = Oui
8025	CustomerAccount	N	Numéro de compte pour les clients non admissibles à l'obtention d'un identifiant d'entité juridique (LEI) 20 Alphanumérique
8026	AlgorithmID	N	Identifiant unique pour le client final (ordres automatiquement générés sur une base prédéterminée) 20 Alphanumérique

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
8027	CustomerLEI	N	LEI pour les clients admissibles à l'obtention d'un LEI, y compris le LEI de l'équivalent de courtier étranger (cryptage requis) 52 Alphanumérique
8028	BrokerLEI	N	Courtier membre de l'OCRCVM d'une organisation non participante (Courtier correspondant) 20 Alphanumérique
9688	OrigSendercompID	N	SenderCompID de la session d'inscription de l'ordre à l'origine. (Copie de sécurité seulement)
9882	TradeLiquidityIndicator	N	Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada : A = L'ordre a ajouté de la liquidité R = L'ordre a retiré de la liquidité a = L'ordre a ajouté de la liquidité masquée r = L'ordre a retiré de la liquidité masquée d = L'ordre a ajouté de la liquidité masquée à la touche D = L'ordre a retiré de la liquidité masquée apparié au seuil g = L'ordre a ajouté à la liquidité masquée de la FEG G = L'ordre a retiré GEF de la liquidité masquée de la FEG C = Marché à la fermeture S = Ordre affiché ajoutant de la liquidité qui améliore le MCAVN O = Enchère d'ouverture/de clôture E = Séance de négociation de la dernière vente (TSX/TSXV) L = M-ELO P = exécution résultante d'un flux CXD PureStream m = CXD PureStream LS bloc prix médian a ajouté à la liquidité M = CXD PureStream LS bloc prix médian a retiré de la liquidité
23013	AllowConditional	N	Y = Oui N = Non (par défaut) Ordres CXD PureStream IOC/SOK uniquement

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
27005	MinRate	N	Taux minimum pour les ordres CXD PureStream Custom Reference Rate Range (847=1003) et LS (847=1004) Spécifié en pourcentage sous forme de nombre entier (par exemple, 5 % doit être envoyé sous la forme 27005=5) Par défaut 1 % si non spécifié (Min 1%, Max 32 767%) Doit être inférieur ou égal à MaxRate<27006>
27006	MaxRate	N	Taux maximum requis pour les ordres CXD PureStream Custom Reference Rate Range (847=1003) Spécifié en pourcentage sous forme de nombre entier (par exemple, 5 % doit être envoyé sous la forme 27005=5) (Min 1%, Max 500%) Doit être supérieur ou égal à MinRate<27005>

5.2.2.7 Messages FIX non pris en charge

Nasdaq Canada ne prend pas en charge les types de messages FIX suivants :

- Messages Allocation et Allocation ACK
- Messages Cotation et Demande de cotation
- Messages de publicité, courriels et nouvelles
- Liste d'ordres, Statut d'ordre
- Annuler liste, Exécuter liste et Statut de liste

5.3 Opérations croisées

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
11	ClOrdID	Y	Doit être unique pour chaque ordre tout au long de la journée de négociation, pour tous les titres et côtés d'un même ID de session FIX.
18	ExecInst	N	f = DAO
21	HandlInst	Y	Instructions pour le traitement de l'ordre dans le système de négociation de Nasdaq Canada. Valeur prise en charge par Nasdaq Canada : 1 = Ordre d'exécution automatisée, privé, sans intervention de courtier. REMARQUE : Toutes les autres valeurs seront modifiées à 1.
38	OrderQty	Y	Quantité de l'ordre.
40	OrdType	Y	Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada pour les opérations croisées : 2 = Limite
44	Prix	N	Obligatoire pour les ordres limite.
54	Côté	Y	Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada pour les opérations croisées : 8 = Opération croisée 9 = Opération croisée à découvert
55	Symbole	Y	Symbole local/boursier seulement
57	TargetSubid	N	Indique comment l'ordre doit être acheminé : CHIX CX2 CXD Stratégies Smart Order Router (SOR) : Les valeurs seront fournies par Nasdaq CXC Operations après la certification. Une valeur valide est requise dans TargetSubid (57) ou ExDestination (100).
59	TimeInForce	N	L'absence de ce champ indique un ordre journalier. Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada pour les opérations croisées : 0 = Jour

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
60	TransactTime	Y	Heure à laquelle cette demande d'ordre a été initiée par le client.
63	SettlType	N	Conditions de règlement de l'ordre : 1 = Espèces (T+0) 2 = Jour suivant (T+1) 6 = Futur (utilisé en combinaison avec SettlDate (64))
64	SettlDate	N	Date précise du règlement de l'opération au format AAAAMMJJ. Ce champ est obligatoire si la valeur de SettlType (63) est 6.
100	ExDestination	N	Indique comment l'ordre doit être acheminé : CHIX CX2 CXD Stratégies Smart Order Router (SOR) : Les valeurs seront fournies par Nasdaq Canada Operations après la certification. Une valeur valide est requise dans TargetSubid (57) ou ExDestination (100).
6751	UMIRUserID	Y	Obligatoire pour la déclaration réglementaire canadienne, le code d'utilisateur du système de négociation pour le négociateur.
6754	BasketTrade	N	Identification d'ordre dans le cadre d'une opération sur panier : N = Non (Défaut) 1* 5Chiffres = Numéro de panier
6755	ProgramTrade	N	Un ordre qui fait partie d'une transaction de panier composée de titres indicels pour compenser une position sur contrats à terme standardisés ou d'options. Y=Oui N = Non (Défaut)
6761	Anonymous	N	Le numéro de courtier TSX est toujours masqué dans le carnet d'ordres. Y = Oui N = Non (Défaut)

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
6767	CHIXBuyAccountType	Y	Obligatoire pour la déclaration réglementaire canadienne. CL = Client (Défaut) NC = Non-Client ST = Spécialiste IN = Inventaire OF = Compte ferme options OT = Teneur de marché options BU = Regroupé MC = Clients multiples Remarque : Si non spécifié, la valeur par défaut s'applique
6768	CHIXSellAccountType	Y	Obligatoire pour la déclaration réglementaire canadienne. CL = Client (Défaut) NC = Non-Client ST = Spécialiste IN = Inventaire OF = Compte ferme options OT = Teneur de marché options BU = Regroupé MC = Clients multiples Remarque : Si non spécifié, la valeur par défaut s'applique
6769	CHIXBuyAccountID	N	Identifie le compte de négociation du côté Acheter de l'opération croisée.
6770	CHIXSellAccountID	N	Identifie le compte de négociation du côté Vendre de l'opération croisée.
6771	CHIXBuyRegulationID	N	Marqueur d'identification pour les désignations propres aux RUIM des ordres et des opérations. IA = Compte d'initié NA = Sans objet SS = Actionnaire important
6772	CHIXSellRegulationID	N	Marqueur d'identification pour les désignations propres aux RUIM des ordres et des opérations. IA = Compte d'initié NA = Sans objet SS = Actionnaire important

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
6773	CrossType	N	Fait référence aux types d'opérations croisées spécialisées. I = Interne C = Contingent B = Base V = VWAP D = Lié à des dérivés
6781	CHIXBuyJitney	N	Pour indiquer que le côté Acheter de l'opération croisée est exécuté au nom d'un autre courtier : Numéro de courtier
6782	CHIXSellJitney	N	Pour indiquer que le côté Vendre de l'opération croisée est exécuté au nom d'un autre courtier : Numéro de courtier
6791	Bypass	N	Marqueur réglementaire indiquant que l'ordre est placé en conjonction avec des ordres de contournement. « Y » « N »; la valeur par défaut est « N »
7729	ShortMarkingExempt	N	Identifie un ordre comme Exempt d'identification à découvert (SME). N'est pas valable pour les ordres de vente à découvert. 1 = Acheter SME 2 = Vendre SME 3 = Acheter et vendre SME Les valeurs 2 et 3 ne sont pas valables pour les ordres d'opérations croisées à découvert.
7737	POComment	N	Une balise de transfert de forme libre mise à la disposition des Participants. Maximum of 32 caractères.
20050	FacilitationQty	N	Quantité maximale d'actions pour faciliter un ordre « balayer et croiser » lorsque la facilitation ne se fait pas avec le côté client de l'opération croisée.
20051	FacilitationSide	N	Identifie le côté du marché qui va utiliser FacilitationQty. 1 = Acheter 2 = Vendre
20201	BuyCustomerAccount	N	Numéro de compte pour les clients non admissibles à l'obtention d'un LEI pour le côté Acheter de l'opération croisée 20 Alphanumérique
20202	SellCustomerAccount	N	Numéro de compte pour les clients non admissibles à l'obtention d'un LEI pour le côté Vendre de l'opération croisée 20 Alphanumérique
20203	BuyAlgorithmID	N	Identifiant unique pour le client final du côté Vendre de l'opération croisée (ordres automatiquement générés sur une base prédéterminée) 20 Alphanumérique

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
20204	SellAlgorithmID	N	Identifiant unique pour le client final du côté Acheter de l'opération croisée (ordres automatiquement générés sur une base prédéterminée) 20 Alphanumérique
20205	BuyCustomerLEI	N	LEI pour les clients admissibles à l'obtention d'un LEI, y compris le LEI de l'équivalent de courtier étranger, pour le côté Acheter de l'opération croisée (cryptage requis) 52 Alphanumérique
20206	SellCustomerLEI	N	LEI pour les clients admissibles à l'obtention d'un LEI, y compris le LEI de l'équivalent de courtier étranger, pour le côté Vendre de l'opération croisée (cryptage requis) 52 Alphanumérique
20207	BuyBrokerLEI	N	Courtier membre de l'OCRCVM d'une organisation non participante pour le côté Acheter de l'opération croisée (Courtier correspondant) 20 Alphanumérique
20208	SellBrokerLEI	N	Courtier membre de l'OCRCVM d'une organisation non participante pour le côté Vendre de l'opération croisée (Courtier correspondant) 20 Alphanumérique
20209	BuyOrderOrigination	N	Le courtier doit faire rapport pour le côté Acheter de l'opération croisée, comme il est précisé par le client. 5 = Ordre reçu d'un client à accès direct (DEA) 6 = Ordre reçu d'un équivalent de courtier étranger (FDE) 7 = Ordre reçu d'un service d'exécution seulement (OEO)
20210	SellOrderOrigination	N	Le courtier doit faire rapport pour le côté Vendre de l'opération croisée, comme il est précisé par le client. 5 = Ordre reçu d'un client à accès direct (DEA) 6 = Ordre reçu d'un équivalent de courtier étranger (FDE) 7 = Ordre reçu d'un service d'exécution seulement (OEO)
20211	BuyRoutingArrangementIndicator	N	0 = Pas d'accord d'acheminement en place 1 = Accord d'acheminement en place
20212	SellRoutingArrangementIndicator	N	0 = Pas d'accord d'acheminement en place 1 = Accord d'acheminement en place

5.4 Participant au marché

5.4.1 Commande d'un participant au marché

En plus des champs d'en-tête et de fin standard, Nasdaq Canada traite uniquement les champs suivants dans un message **Commande d'un participant au marché** et ignore tous les autres champs.

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
35	MsgType	Y	MC
54	Côté	Y	Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada : 1 = Acheter 2 = Vendre
55	Symbole	Y	Symbole local/bourse
100	ExDestination	N	CX2 (par défaut)
6751	UMIRUserID	Y	Obligatoire pour la déclaration réglementaire canadienne, le code d'utilisateur du système de négociation pour le négociateur.
6789	PartCommandID	Y	Identifiant unique attribué par le membre de la FEG au message. Maximum de 32 caractères.
6799	GEFCommitVolume	Y	La taille (actions) de l'engagement du membre de la FEG aux fins d'autoexécution. Doit correspondre à au moins la GMV du titre désigné.

5.4.2 Réponse à la commande d'un participant au marché

En plus des champs d'en-tête et de fin standard, Nasdaq Canada fournira les champs suivants dans un message de **Réponse à la commande d'un participant au marché** en réponse à une commande d'un participant au marché.

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
35	MsgType	Y	MR
54	Côté	Y	Valeurs prises en charge par Nasdaq Canada : 1 = Acheter 2 = Vendre
55	Symbole	Y	Symbole local/bourse
58	Text	N	Raison du rejet de la commande d'un participant au marché.
150	ExecType	Y	0 = Nouveau 8 = Rejeté Si le message de Commande d'un participant au marché est rejeté, l'engagement du membre à la FEG demeure à la valeur fixée antérieurement au message de Commande d'un participant au marché.

Bal.	Nom du champ	Obl.	Commentaires
6751	UMIRUserID	Y	Obligatoire pour la déclaration réglementaire canadienne, le code d'utilisateur du système de négociation pour le négociateur.
6789	PartCommandID	Y	Identifiant unique attribué par le membre de la FEG au message.
6799	GEFCommitVolume	Y	La taille (actions) de l'engagement du membre de la FEG aux fins d'autoexécution.

6 ANNEXE A – EXEMPLE DE MATRICES DE FLUX D'ORDRES

1 – Ordre exécuté

<u>Heure s</u>	<u>Message reçu</u> (CISID, OrigCISID)	<u>Message envoyé</u> (CISID, OrigCISID)	<u>Exec Type</u>	<u>OrdStatus</u>	<u>Exec Trans Type</u>	<u>Ordre Qty</u>	<u>Cum Qty</u>	<u>Leaves Qty</u>	<u>Last Shares</u>	<u>Commentaire</u>
1	Nouvel ordre (X)					10000				
2		Exécution (X)	Reje té	Rejeté	Nouv eau	10000	0	0	0	Si l'ordre est rejeté
2		Exécution (X)	Nou veau	Nouveau	Nouv eau	10000	0	10000	0	
3		Exécution (X)	Exéc - parti elle	Exécuté partiellem ent	Nouv eau	10000	2000	8000	2000	Exécution de 2000
4		Exécution (X)	Exéc - parti elle	Exécuté partiellem ent	Nouv eau	10000	3000	7000	1000	Exécution de 1000
5		Exécution (X)	Exéc uter	Exécuté	Nouv eau	10000	10000	0	7000	Exécution de 7000

2 – Demande d'annulation d'un ordre exécuté à zéro

<u>Heure</u> <u>s</u>	<u>Message</u> <u>reçu</u> (ClOrdID, OrigClOrdID)	<u>Message</u> <u>envoyé</u> (ClOrdID, OrigClOrdID)	<u>Exec</u> <u>Type</u>	<u>OrdStatus</u>	<u>Exec</u> <u>Trans</u> <u>Type</u>	<u>Ordre</u> <u>Qty</u>	<u>Cum</u> <u>Qty</u>	<u>Leaves</u> <u>Qty</u>	<u>Last</u> <u>Shares</u>	<u>Commentaire</u>
1	Nouvel ordre (X)					10000				
2		Exécution (X)	Rejeté	Rejeté	Nouv eau	10000	0	0	0	Si l'ordre est rejeté
2		Exécution (X)	Nouv eau	Nouveau	Nouv eau	10000	0	10000	0	
3	Demande annulation (Y,X)					10000				
4		Rejet annulation (Y,X)		Nouveau		10000				Si rejeté
4		Exécution (Y,X)	Annul é	Annulé	Nouv eau	10000	0	0	0	

3 – Demande d'annulation émise pour un ordre exécuté partiellement – des exécutions se produisent pendant que la demande d'annulation est active

<u>Heure</u> <u>s</u>	<u>Message</u> <u>reçu</u> (CLOrdID, OrigCLOrdID)	<u>Message</u> <u>envoyé</u> (CLOrdID, OrigCLOrdID)	<u>Exec</u> <u>Type</u>	<u>OrdStatus</u>	<u>Exec</u> <u>Trans</u> <u>Type</u>	<u>Ordre</u> <u>Qty</u>	<u>Cum</u> <u>Qty</u>	<u>Leaves</u> <u>Qty</u>	<u>Last</u> <u>Shares</u>	<u>Commentaire</u>
1	Nouvel ordre (X)					10000				
2		Exécution (X)	Rejeté	Rejeté	Nouv eau	10000	0	0	0	Si l'ordre est rejeté
2		Exécution (X)	Nouv eau	Nouveau	Nouv eau	10000	0	10000	0	
3		Exécution (X)	Exéc. partie lle	Exécuté partiellem ent	Nouv eau	10000	2000	8000	2000	Exécution pour 2000
4	Demande annulation (Y,X)					10000				
4		Exécution (X)	Exéc. partie lle	Exécuté partiellem ent	Nouv eau	10000	5000	5000	3000	Exécution pour 3000. Cette exécution croise la demande d'annulation dans la connexion.
5		Rejet annulation (Y,X)		Exécuté partiellem ent		10000				Si la demande est rejetée
5		Exécution (X)	Exéc. partie lle	Exécuté partiellem ent	Nouv eau	10000	6000	4000	1000	Exécution pour 1000 pendant que l'ordre est en attente d'annulation
6		Exécution (Y,X)	Annulé	Annulé	Nouv eau	10000	6000	0	0	Le statut d'ordre « Annulé » a préséance sur le statut d'ordre « partiellement exécuté ».

4 – Demande d'annulation pour un ordre qui est exécuté avant que la demande d'annulation ne puisse être acceptée

<u>Heure</u> <u>s</u>	<u>Message</u> <u>reçu</u> (CLOrdID, OrigCLOrdID)	<u>Message</u> <u>envoyé</u> (CLOrdID, OrigCLOrdID)	<u>Exec</u> <u>Type</u>	<u>OrdStatus</u>	<u>Exec</u> <u>Trans</u> <u>Type</u>	<u>Ordre</u> <u>Qty</u>	<u>Cum</u> <u>Qty</u>	<u>Leaves</u> <u>Qty</u>	<u>Last</u> <u>Shares</u>	<u>Commentaire</u>
1	Nouvel ordre (X)					10000				
2		Exécution (X)	Rejeté	Rejeté	Nouv eau	10000	0	0	0	Si l'ordre est rejeté
2		Exécution (X)	Nouv eau	Nouveau	Nouv eau	10000	0	10000	0	
3		Exécution (X)	Exéc. partie lle	Exécuté partiellem ent	Nouv eau	10000	2000	8000	2000	Exécution pour 2000
4	Demande annulation (Y,X)					10000				
4		Exécution (X)	Exéc. partie lle	Exécuté partiellem ent	Nouv eau	10000	5000	5000	3000	Exécution pour 3000. Cette exécution croise la demande d'annulation dans la connexion.
5		Rejet annulation (Y,X)		Exécuté partiellem ent		10000				Si la demande est rejetée
6		Exécution (X)	Exécu ter	Exécuté	Nouv eau	10000	10000	0	5000	Exécution pour 5000 pendant que l'ordre est en attente d'annulation. Le statut d'ordre « En attente d'annulation » a préséance sur le statut d'ordre « exécuté ».
7		Rejet annulation (Y,X)		Exécuté		10000				Demande d'Annulation rejetée – CxlRejectReason = 0 (trop tard pour annuler)

5 – Ordre exécuté à zéro, demande d'annulation/remplacement émise pour réduire la quantité de l'ordre

<u>Heure</u> <u>s</u>	<u>Message</u> <u>reçu</u> (CLOrdID, OrigCLOrdID)	<u>Message</u> <u>envoyé</u> (CLOrdID, OrigCLOrdID)	<u>Exec</u> <u>Type</u>	<u>OrdStatus</u>	<u>Exec</u> <u>Trans</u> <u>Type</u>	<u>Ordre</u> <u>Qty</u>	<u>Cum</u> <u>Qty</u>	<u>Leaves</u> <u>Qty</u>	<u>Last</u> <u>Shares</u>	<u>Commentaire</u>
1	Nouvel ordre (X)					10000				
2		Exécution (X)	Rejeté	Rejeté	Nouveau	10000	0	0	0	Si l'ordre est rejeté
2		Exécution (X)	Nouveau	Nouveau	Nouveau	10000	0	10000	0	
3	Demande de remplacement(Y,X)					9000				Demande de réduire la quantité de l'ordre à 9000
4		Rejet annulation (Y,X)		Nouveau		10000				Si rejeté par négociateur
4		Exécution (Y,X)	Remplacer	Remplacé	Nouveau	9000	0	9000	0	Le statut d'ordre « Remplacé » a préséance sur le statut d'ordre « Nouveau ».
5		Exécution (Y)	Exéc. partielle	Exécuté partiellement	Nouveau	9000	1000	8000	1000	Exécution pour 1000
6		Exécution (Y)	Exéc. partielle	Exécuté partiellement	Nouveau	9000	3000	7000	2000	Exécution pour 2000

6 – Ordre exécuté partiellement, suivi d'une demande d'annulation/remplacement pour réduire la quantité de l'ordre; l'exécution se produit pendant que l'ordre est en attente de remplacement

<u>Heure</u> <u>s</u>	<u>Message</u> <u>reçu</u> (COrdID, OrigCOrdID)	<u>Message</u> <u>envoyé</u> (COrdID, OrigCOrdID)	<u>Exec</u> <u>Type</u>	<u>OrdStatus</u>	<u>Exec</u> <u>Trans</u> <u>Type</u>	<u>Ordre</u> <u>Qty</u>	<u>Cum</u> <u>Qty</u>	<u>Leaves</u> <u>Qty</u>	<u>Last</u> <u>Shares</u>	<u>Commentaire</u>
1	Nouvel ordre (X)					10000				
2		Exécution (X)	Rejeté	Rejeté	Nouv eau	10000	0	0	0	Si l'ordre est rejeté
2		Exécution (X)	Nouv eau	Nouveau	Nouv eau	10000	0	10000	0	
3		Exécution (X)	Exéc. partie lle	Exécuté partielleme nt	Nouv eau	10000	1000	9000	1000	Exécution pour 1000
4	Demande de remplaceme nt(Y,X)					8000				Demande de réduction de la quantité de l'ordre à 8000
5		Rejet annulation (Y,X)		Exécuté partielleme nt		10000				Si la demande est rejetée
5		Exécution (X)	Exéc. partie lle	Exéc. partielle	Nouv eau	10000	1100	8900	100	Exécution pour 100 avant la réponse à la demande d'annulation/remplacement
5		Rejet annulation (Y,X)		Exécuté partielleme nt		10000				Si la demande est rejetée
6		Exécution (Y,X)	Remp lacer	Exécuté partielleme nt	Nouv eau	8000	1100	6900	0	Le statut d'ordre « Exécuté partiellement » a préséance sur le statut d'ordre « Remplacé ».
7		Exécution (Y)	Exécu ter	Exécuté	Nouv eau	8000	8000	0	6900	Exécution pour 6900

7 – La demande d'annulation/remplacement (pas pour un changement de quantité) est rejetée parce qu'une exécution s'est produite

<u>Heures</u>	<u>Message reçu</u> (COrdID, OrigCOrdID)	<u>Message envoyé</u> (COrdID, OrigCOrdID)	<u>Exec Type</u>	<u>OrdStatus</u>	<u>Exec Trans Type</u>	<u>Ordre Qty</u>	<u>Cum Qty</u>	<u>Leaves Qty</u>	<u>Last Shares</u>	<u>Commentaire</u>
1	Nouvel ordre (X)					10000				
2		Exécution (X)	Rejeté	Rejeté	Nouve au	10000	0	0	0	Si l'ordre est rejeté
2		Exécution (X)	Nouveau	Nouveau	Nouve au	10000	0	10000	0	
3		Exécution (X)	Exéc. partielle	Exécuté partiellement	Nouve au	10000	1000	9000	1000	Exécution pour 1000
4	Demande de remplacement(Y,X)					10000				
4		Exécution (X)	Exécuter	Exécuté	Nouve au	10000	10000	0	9000	Exécution pour 9000 – le message de demande de changement croise ce rapport d'exécution dans la connexion.
5		Rejet annulation (Y,X)		Exécuté		10000				CxlRejectReason = 0 (trop tard pour annuler)

8 – Demande d'annulation/remplacement pendant que l'exécution est en cours de rapport – la quantité demandée dépasse la quantité cumulée. L'ordre est remplacé puis exécuté.

<u>Heure</u> <u>s</u>	<u>Message</u> <u>reçu</u> (CLOrdID, OrigCLOrdID)	<u>Message</u> <u>envoyé</u> (CLOrdID, OrigCLOrdID)	<u>Exec</u> <u>Type</u>	<u>OrdStatus</u>	<u>Exec</u> <u>Trans</u> <u>Type</u>	<u>Ordre</u> <u>Qty</u>	<u>Cum</u> <u>Qty</u>	<u>Leaves</u> <u>Qty</u>	<u>Last</u> <u>Shares</u>	<u>Commentaire</u>
1	Nouvel ordre (X)					10000				
2		Exécution (X)	Rejeté	Rejeté	Nouv eau	10000	0	0	0	Si l'ordre est rejeté
2		Exécution (X)	Nouve au	Nouveau	Nouv eau	10000	0	10000	0	
3		Exécution (X)	Exéc. partiell e	Exécuté partiellem ent	Nouv eau	10000	1000	9000	1000	Exécution pour 1000
4	Demande de remplaceme nt(Y,X)					8000				Demande une réduction de la commande à 8000 (ce qui laisse 7000 actions ouvertes)
4		Exécution (X)	Exéc. partiell e	Exécuté partiellem ent	Nouv eau	10000	1500	8500	500	Exécution pour 500 envoyée. Le message de demande de changement croise ce rapport d'exécution dans la connexion.
5		Exécution (X)	Exéc. partiell e	Exécuté partiellem ent	Nouv eau	10000	1600	8400	100	Une exécution pour 100 se produit avant que la demande d'annulation/remplacement ne soit acceptée.
6		Rejet annulation (Y,X)		Exécuté partiellem ent		10000				Si la demande est rejetée

6		Exécution (Y,X)	Remplacer	Exécuté partiellement	Nouveau	8000	1600	6400	0	Le statut d'ordre « Exécuté partiellement » a préséance sur le statut d'ordre « Remplacé ». Le remplacement est accepté, car la quantité d'ordre demandée dépasse la quantité cumulée.
7		Exécution (Y)	Exécuter	Exécuté	Nouveau	8000	8000	0	6400	Exécution pour 6400.

9 – Une demande d'annulation/remplacement est envoyée pendant que l'exécution est en cours de rapport — la quantité d'ordre demandée est égale à la quantité cumulée — la quantité de l'ordre est amendée à la quantité cumulée

<u>Heure</u> <u>s</u>	<u>Message</u> <u>reçu</u> (COrdID, OrigCOrdID)	<u>Message</u> <u>envoyé</u> (COrdID, OrigCOrdID)	<u>Exec</u> <u>Type</u>	<u>OrdStatus</u>	<u>Exec</u> <u>Trans</u> <u>Type</u>	<u>Ordre</u> <u>Qty</u>	<u>Cum</u> <u>Qty</u>	<u>Leaves</u> <u>Qty</u>	<u>Last</u> <u>Shares</u>	<u>Commentaire</u>
1	Nouvel ordre (X)					10000				
2		Exécution (X)	Rejeté	Rejeté	Nouv eau	10000	0	0	0	Si l'ordre est rejeté
2		Exécution (X)	Nouv eau	Nouveau	Nouv eau	10000	0	10000	0	
3	Demande de remplaceme nt(Y,X)					7000				Le client désire amender l'ordre à 7000 actions
3		Exécution (X)	Exéc. partie lle	Exécuté partielleme nt	Nouv eau	10000	7000	3000	7000	Exécution pour 7000 - le message de demande de changement croise ce rapport d'exécution dans la connexion.
4		Exécution (Y,X)	Remp lacer	Exécuté	Nouv eau	7000	7000	0	0	La demande de remplacement est interprétée comme exigeant que le solde de l'ordre soit annulé – le statut d'ordre « Exécuté » a préséance sur « Annulé » ou « Remplacé »

10 – Une demande d'annulation/remplacement est envoyée pendant que l'exécution est en cours de rapport — la quantité d'ordre demandée est inférieure à la quantité cumulée — la quantité de l'ordre est amendée à la quantité cumulée

<u>Heure</u> <u>s</u>	<u>Message reçu</u> (CLOrdID, OrigCLOrdID)	<u>Message</u> <u>envoyé</u> (CLOrdID, OrigCLOrdID)	<u>Exec</u> <u>Type</u>	<u>OrdStatus</u>	<u>Exec</u> <u>Trans</u> <u>Type</u>	<u>Ordre</u> <u>Qty</u>	<u>Cum</u> <u>Qty</u>	<u>Leaves</u> <u>Qty</u>	<u>Last</u> <u>Shares</u>	<u>Commentaire</u>
1	Nouvel ordre (X)					10000				
2		Exécution (X)	Rejet é	Rejeté	Nouv eau	10000	0	0	0	Si l'ordre est rejeté
2		Exécution (X)	Nou veau	Nouveau	Nouv eau	10000	0	10000	0	
3	Demande de remplaceme nt(Y,X)					7000				Le client désire amender l'ordre à 7000 actions
3		Exécution (X)	Exéc . parti elle	Exécuté partielleme nt	Nouv eau	10000	8000	2000	8000	Exécution pour 8000 - le message de demande de changement croise ce rapport d'exécution dans la connexion.
4		Exécution (Y,X)	Rem plac er	Exécuté	Nouv eau	8000	8000	0	0	La demande de remplacement est interprétée comme exigeant que le solde de l'ordre soit annulé – le statut d'ordre « Exécuté » a préséance sur « Annulé » ou « Remplacé »

11 – Une demande d'annulation/remplacement est émise, qui est acceptée – une autre est émise, qui est également acceptée

<u>Heure</u> <u>s</u>	<u>Message reçu</u> (COrdID, OrigCOrdID)	<u>Message</u> <u>envoyé</u> (COrdID, OrigCOrdID)	<u>Exec</u> <u>Type</u>	<u>OrdStatus</u>	<u>Exec</u> <u>Trans</u> <u>Type</u>	<u>Ordre</u> <u>Qty</u>	<u>Cum</u> <u>Qty</u>	<u>Leaves</u> <u>Qty</u>	<u>Last</u> <u>Shares</u>	<u>Commentaire</u>
1	Nouvel ordre (X)					10000				
2		Exécution (X)	Rejeté	Rejeté	Nouv eau	10000	0	0	0	Si l'ordre est rejeté
2		Exécution (X)	Nouveau	Nouveau	Nouv eau	10000	0	10000	0	
3		Exécution (X)	Exéc. partielle	Exécuté partiellement	Nouv eau	10000	1000	9000	1000	Exécution pour 1000
4	Demande de remplacement(Y,X)					8000				La demande réduit la quantité de l'ordre à 8000, laissant 7000 actions ouvertes
5		Exécution (X)	Exéc. partielle	Exécuté partiellement	Nouv eau	10000	1500	8500	500	Exécution pour 500
6		Exécution (Y,X)	Remplacer	Exécuté partiellement	Nouv eau	8000	1500	6500	0	Le statut d'ordre « Exécuté partiellement » a préséance sur le statut d'ordre « Remplacé ».
7		Exécution (Y)	Exéc. partielle	Exécuté partiellement	Nouv eau	8000	3500	4500	2000	Exécution pour 2000
8	Demande de remplacement(Z,Y)					6000				La demande réduit la quantité de l'ordre à 6000, laissant 2500 actions ouvertes
9		Exécution (Z,Y)	Remplacer	Exécuté partiellement	Nouv eau	6000	3500	2500	0	Le statut d'ordre « Exécuté partiellement » a préséance sur le statut d'ordre « Remplacé ».
10		Exécution (Z)	Exécuter	Exécuté	Nouv eau	6000	6000	0	2500	Exécution pour 2500

12 – Annulation non sollicitée d'un ordre partiellement exécuté

<u>Heure</u> <u>s</u>	<u>Message reçu</u> (CLOrdID, OrigCLOrdID)	<u>Message envoyé</u> (CLOrdID, OrigCLOrdID)	<u>Exec Type</u>	<u>OrdStatus</u>	<u>Exec Trans Type</u>	<u>Ordre Qty</u>	<u>Cum Qty</u>	<u>Leave s Qty</u>	<u>Last Shares</u>	<u>Commentaire</u>
1	Nouvel ordre (X)					10000				
2		Exécution (X)	Rejeté	Rejeté	Nouveaux	10000	0	0	0	Si l'ordre est rejeté
2		Exécution (X)	Nouveau	Nouveau	Nouveaux	10000	0	10000	0	
3		Exécution (X)	Exéc. partielle	Exécuté partiellement	Nouveaux	10000	1000	9000	1000	Exécution pour 1000
4										NASDAQ accepte verbalement d'annuler l'ordre
5		Exécution (X)	Annulé	Annulé	Nouveaux	10000	1000	0	0	NASDAQ signifie que l'ordre a été annulé - ExecRestatementReason = Changement verbal

13– Ordre rejeté en raison d'un CLOrdID en duplicata

<u>Heure</u> <u>s</u>	<u>Message reçu</u> (CLOrdID, OrigCLOrdID)	<u>Message envoyé</u> (CLOrdID, OrigCLOrdID)	<u>Exec Type</u>	<u>OrdStatus</u>	<u>Exec Trans Type</u>	<u>Ordre Qty</u>	<u>Cum Qty</u>	<u>Leave s Qty</u>	<u>Last Shares</u>	<u>Commentaire</u>
1	Nouvel ordre (X)					10000				
2		Exécution (X)	Nouveau	Nouveau	Nouveaux	10000	0	10000	0	

<u>Heure</u> <u>s</u>	<u>Message</u> <u>reçu</u> (CLOrdID, OrigCLOrdID)	<u>Message</u> <u>envoyé</u> (CLOrdID, OrigCLOrdID)	<u>Exec</u> <u>Type</u>	<u>OrdStatu</u> <u>s</u>	<u>Exec</u> <u>Trans</u> <u>Type</u>	<u>Ordre</u> <u>Qty</u>	<u>Cum</u> <u>Qty</u>	<u>Leave</u> <u>s</u> <u>Qty</u>	<u>Last</u> <u>Share</u> <u>s</u>	<u>Commentaire</u>
3		Exécution (X)	Exéc. partielle	Exécuté partiellement	Nouveau	10000	1000	9000	1000	Exécution pour 1000
4	Nouvel ordre (X)					10000				Ordre soumis avec la même ID d'ordre
5		Exécution (X)	Rejeté	Exécuté partiellement	Nouveau	10000	1000	9000	0	OrdRejReason = ordre en duplicata

14 – Renvoi possible d'un ordre

<u>Heure</u> <u>s</u>	<u>Message</u> <u>reçu</u> (CLOrdID, OrigCLOrdID)	<u>Message</u> <u>envoyé</u> (CLOrdID, OrigCLOrdID)	<u>Exec</u> <u>Type</u>	<u>OrdStatus</u>	<u>Exec</u> <u>Trans</u> <u>Type</u>	<u>Ordre</u> <u>Qty</u>	<u>Cum</u> <u>Qty</u>	<u>Leaves</u> <u>Qty</u>	<u>Last</u> <u>Shares</u>	<u>Commentaire</u>
1	Nouvel ordre (X)					10000				
2		Exécution (X)	Nouvel	Nouveau	Nouvel	10000	0	10000	0	
3	Nouvel ordre (X)					10000				PossResend=Y
4		Exécution (X)	Nouvel	Nouveau	Statut	10000	0	10000		Étant donné que l'ordre X a déjà été reçu, reconfirmer le statut actuel de l'ordre. Last shares n'est pas nécessaire lorsque ExecTransType = Statut
5	Nouvel ordre (Y)					15000				PossResend=Y
6		Exécution (Y)	Nouvel	Nouveau	Nouvel	15000	0	15000	0	Étant donné que l'ordre Y n'a pas été reçu précédemment, reconfirmer comme nouvel ordre.

15 – Ordre Immédiat ou Annuler qui ne peut pas être exécuté immédiatement

<u>Heure</u> <u>s</u>	<u>Message</u> <u>reçu</u> (CLOrdID, OrigCLOrdID)	<u>Message</u> <u>envoyé</u> (CLOrdID, OrigCLOrdID)	<u>Exec</u> <u>Type</u>	<u>OrdStatus</u>	<u>Exec</u> <u>Trans</u> <u>Type</u>	<u>Ordre</u> <u>Qty</u>	<u>Cum</u> <u>Qty</u>	<u>Leaves</u> <u>s</u> <u>Qty</u>	<u>Last</u> <u>Shares</u>	<u>Commentaire</u>
1	Nouvel ordre (X)					10000				L'ordre est IOC
2		Exécution (X)	Rejeté	Rejeté	Nouvel	10000	0	0	0	Si l'ordre est rejeté
2		Exécution (X)	Nouvel	Nouveau	Nouvel	10000	0	10000	0	

3		Exécution (X)	Exéc. partielle	Exécuté partiellement	Nouveau	10000	1000	9000	1000	Exécution pour 1000
4		Exécution (X)	Annulé	Annulé	Nouveau	10000	1000	0	0	Si l'ordre ne peut pas être exécuté immédiatement

16 – Ordre exécuté, suivi d'une correction et d'une annulation des exécutions

Heures	Message reçu (CLOrdID, OrigCLOrdID)	Message envoyé (CLOrdID, OrigCLOrdID)	Exec Type	OrdStatus	Exec Trans Type	Ordre Qty	Cum Qty	Leaves Qty	AvgPx	Last Shares	Last Px	ExecID (ExecRefID)	Commentaire
1	Nouvel ordre (X)					10000							
2		Exécution (X)	Rejeté	Rejeté	Nouveau	10000	0	0		0		A	Si l'ordre est rejeté
2		Exécution (X)	Nouveau	Nouveau	Nouveau	10000	0	10000	0	0		B	
3		Exécution (X)	Exéc. partielle	Exécuté partiellement	Nouveau	10000	1000	9000	100	1000	100	C	Exécution pour 1000 @ 100
4		Exécution (X)	Exécuteur	Exécuté	Nouveau	10000	10000	0	109	9000	110	D	Exécution pour 9000 @ 110
5		Exécution (X)	Exécuteur	Exécuté	Annuler	10000	9000	1000	110	0	0	E (C)	Annuler exécution pour 1000
6		Exécution (X)	Exécuteur	Exécuté	Corriger	10000	9000	1000	100	9000	100	F (D)	Corriger prix d'exécution pour 9000 à 100

17 – Ordre exécuté entièrement (1 transaction), suivi de l'annulation de l'exécution.

Heures	Message reçu (CLOrdID, OrigCLOrdID)	Message envoyé (CLOrdID, OrigCLOrdID)	Exec Type	OrdStatus	Exec Trans Type	Ordre Qty	Cum Qty	Leaves Qty	AvgPx	Last Shares	Last Px	ExecId (ExecRef ID)	Commentaire
1	Nouvel ordre (X)					10000							
2		Exécution (X)	Rejeté	Rejeté	Nouveau	10000	0	0		0		A	Si l'ordre est rejeté
2		Exécution (X)	Nouveau	Nouveau	Nouveau	10000	0	10000	0	0		B	
3		Exécution (X)	Exécuter	Exécuté	Nouveau	10000	10000	0	100	10000	100	C	Exécution pour 10000 @ 100
4		Exécution (X)	Annulé	Annulé	Annuler	10000	0	0	0	0	0	D (C)	Annuler exécution pour 10000

18 – Ordre exécuté entièrement (plus d'une transaction), suivi de l'annulation d'une exécution.

Heures	Message reçu (CLOrdID, OrigCLOrdID)	Message envoyé (CLOrdID, OrigCLOrdID)	Exec Type	OrdStatus	Exec Trans Type	Ordre Qty	Cum Qty	Leaves Qty	Avg Px	Last Shares	Last Px	ExecId (ExecRef ID)	Commentaire
1	Nouvel ordre (X)					10000							
2		Exécution (X)	Rejeté	Rejeté	Nouveau	10000	0	0		0		A	Si l'ordre est rejeté
2		Exécution (X)	Nouveau	Nouveau	Nouveau	10000	0	10000	0	0		B	
3		Exécution (X)	Exécuter	Exécuté partiellement	Nouveau	10000	8000	2000	100	8000	100	C	Exécution pour 8000 @ 100
4		Exécution (X)	Exécuter	Exécuté	Nouveau	10000	10000	0	100	2000	100	D	Exécution pour 2000 @ 100

5		Exécution (X)	Exécuter	Exécuté	Annuler	10000	8000	0	100	2000	0	E (D)	Annuler exécution pour 2000
---	--	---------------	----------	---------	---------	-------	------	---	-----	------	---	-------	-----------------------------

19 – Ordre exécuté entièrement (1 transaction), suivi de l'annulation de l'exécution, et la quantité restante est négociée

Heures	Message reçu (CLOrdID, OrigCLOrdID)	Message envoyé (CLOrdID, OrigCLOrdID)	Exec Type	OrdStatus	Exec Trans Type	Ordre Qty	Cum Qty	Leaves Qty	Avg Px	Last Shares	Last Px	ExecId (ExecRefID)	Commentaire
1	Nouvel ordre (X)					10000							
2		Exécution (X)	Rejeté	Rejeté	Nouveau	10000	0	0		0		A	Si l'ordre est rejeté
2		Exécution (X)	Nouveau	Nouveau	Nouveau	10000	0	10000	0	0		B	
3		Exécution (X)	Exécuter	Exécuté partiellement	Nouveau	10000	8000	2000	100	8000	100	C	Exécution pour 8000 @ 100
4		Exécution (X)	Nouveau	Nouveau	Annuler	10000	0	2000	0	2000	0	D (C)	Annuler exécution pour 8000
5		Exécution (X)	Exécuter	Exécuté	Nouveau	10000	2000	0	100	2000	100	E	Exécution pour 2000 @ 100

20 – Ordre exécuté, suivi d'une correction du prix d'exécution.

Heures	Message reçu (CLOrdID, OrigCLOrdID)	Message envoyé (CLOrdID, OrigCLOrdID)	Exec Type	OrdStatus	Exec Trans Type	Ordre Qty	Cum Qty	Leaves Qty	Avg Px	Last Shares	Last Px	ExecId (ExecRefID)	Commentaire
1	Nouvel ordre (X)					10000							
2		Exécution (X)	Rejeté	Rejeté	Nouveau	10000	0	0		0		A	Si l'ordre est rejeté

2		Exécution (X)	Nouveau	Nouveau	Nouveau	10000	0	10000	0	0		B	
3		Exécution (X)	Exécuter	Exécuté	Nouveau	10000	10000	0	100	10000	100	C	Exécution pour 10000 @ 100
4		Exécution (X)	Exécuter	Exécuté	Corriger	10000	10000	0	101	10000	101	D (C)	Corriger exécution pour 10000 @ 101

21 – Ordre exécuté, suivi d'une correction de la quantité d'exécution.

Heures	Message reçu (ClOrdID, OrigClOrdID)	Message envoyé (ClOrdID, OrigClOrdID)	Exec Type	OrdStatus	Exec Trans Type	Ordre Qty	Cum Qty	Leaves Qty	AvgPx	Last Shares	Last Px	ExecId (ExecRefID)	Commentaire
1	Nouvel ordre (X)					10000							
2		Exécution (X)	Rejeté	Rejeté	Nouveau	10000	0	0		0		A	Si l'ordre est rejeté
2		Exécution (X)	Nouveau	Nouveau	Nouveau	10000	0	10000	0	0		B	
3		Exécution (X)	Exécuter	Exécuté	Nouveau	10000	10000	0	100	10000	100	C	Exécution pour 10000 @ 100
4		Exécution (X)	Exéc. partielle	Annulé	Corriger	10000	9000	0	100	9000	100	D (C)	Corriger exécution pour 9000 @ 100

22 – Ordre exécuté, suivi d'une correction du prix et l'annulation des exécutions

<u>Heures</u>	<u>Message reçu</u> (CLOrdID, OrigCLOrdID)	<u>Message envoyé</u> (CLOrdID, OrigCLOrdID)	<u>Exec Type</u>	<u>OrdStatus</u>	<u>Exec Trans Type</u>	<u>Ordre Qty</u>	<u>Cum Qty</u>	<u>Leaves Qty</u>	<u>Avg Px</u>	<u>Last Shares</u>	<u>Last Px</u>	<u>ExecId (ExecRefID)</u>	<u>Commentaire</u>
1	Nouvel ordre (X)					10000							
2		Exécution (X)	Rejeté	Rejeté	Nouveau	10000	0	0		0		A	Si l'ordre est rejeté
2		Exécution (X)	Nouveau	Nouveau	Nouveau	10000	0	10000	0	0		B	
3		Exécution (X)	Exéc. partielle	Exécuté partiellement	Nouveau	10000	1000	9000	100	1000	100	C	Exécution pour 1000 @ 100
4		Exécution (X)	Exécuteur	Exécuté	Nouveau	10000	10000	0	109	9000	110	D	Exécution pour 9000 @ 110
5		Exécution (X)	Exécuteur	Exécuté	Annuler	10000	9000	1000	110	0	0	E (C)	Annuler exécution pour 1000
6		Exécution (X)	Exécuteur	Exécuté	Corriger	10000	9000	1000	100	9000	100	F (D)	Corriger prix d'exécution pour 9000 à 100

7 ANNEXE B – DÉFINITION DES ORDRES INDEXÉS DE NASDAQ CANADA TYPE D'INDEXATION PRIMAIRE (PRIM)

7.1 Indexation primaire de base

Cette section donne des exemples d'ordres indexés PRIM de base et incrémentiels.

Indexation primaire de base

Les ordres indexés PRIM de base sont indexés au même côté de la meilleure cotation acheteur/vendeur du marché consolidé du titre. L'ordre n'a aucune discrétion et ne négociera donc qu'avec d'autres ordres à son prix affiché à ce moment-là. L'ordre flotte avec le marché jusqu'à atteindre le prix limite.

Type d'ordre indexé	Est-ce que l'affichage flotte?	Côté indexé
Primaire de base (PRIM)	Y	Même côté que la cotation du marché primaire

Dans l'exemple suivant, l'ordre est *Acheter 3000 à 10.20 indexé au PRIM* :

ExecInst (18)	OrderQty (38)	OrdType (40)	Prix ¹ (44)	Côté (54)
R	3000	P	10,20	1

La meilleure cotation acheteur/vendeur du marché consolidé est 10.10 – 10.16. L'ordre sera initialement affiché à 10.10 et flottera avec le marché, mais ne dépassera jamais la limite de 10.20. Il ne négociera qu'avec d'autres ordres au prix alors affiché.

7.2 Type d'indexation médiane (MID)

Cette section donne des exemples d'ordres indexés PRIM de base et incrémentiels.

Indexation médiane de base

Les ordres indexés MID sont indexés au centre de la meilleure cotation acheteur/vendeur du marché consolidé du titre. L'ordre n'a aucune discrétion et ne négociera donc qu'avec d'autres ordres à son prix

¹ Si aucun prix limite (*Prix*) n'est inscrit pour un ordre indexé PRIM, l'ordre flotte jusqu'à exécution complète. Ceci s'applique à tous les ordres à indexation primaire.

calculé à ce moment-là. L'ordre flotte avec le marché jusqu'à atteindre le prix limite. Les ordres indexés MID sont des ordres masqués et ne sont pas affichés dans le carnet.

Type d'ordre indexé	Est-ce que le prix masqué flotte?	Côté indexé
MID de base	Y	Médiane de la meilleure cotation acheteur/vendeur du marché consolidé

Dans l'exemple suivant, l'ordre est *Acheter 3000 à 10.20 indexé au MID* :

ExecInst (18)	OrderQty (38)	OrdType (40)	Prix ² (44)	Côté (54)
M	3000	P	10,20	1

La meilleure cotation acheteur/vendeur du marché primaire est 10.00 – 10.02. L'ordre sera donc initialement affiché à 10.01 et flottera avec le marché, mais ne dépassera jamais la limite de 10.20. Il négociera avec d'autres ordres au prix médian.

7.3 Type d'indexation au marché (MKT)

Cette section donne des exemples d'ordres indexés au marché (MKT) de base et incrémentiels.

Indexation au marché de base

Les ordres indexés MKT de base sont indexés au côté contrepartie du marché consolidé. L'ordre flotte avec le marché jusqu'à atteindre le prix limite.

Type d'ordre indexé	Est-ce que l'affichage flotte?	Côté indexé
Marché de base (MKT)	Y	Côté contrepartie du marché primaire

Dans l'exemple suivant, l'ordre est *Acheter 3000 à 10.20 indexé au MKT* :

² Si aucun prix limite (*Prix*) n'est inscrit pour un ordre indexé MID, l'ordre flotte jusqu'à exécution complète. Ceci s'applique à tous les ordres indexés MID.

ExecIns t (18)	OrderQ ty (38)	OrdTy pe (40)	Prix ³ (44)	Côté (54)
P	3000	P	10,20	1

La meilleure cotation acheteur/vendeur du marché consolidé est 10.01 – 10.06. L'ordre sera donc initialement affiché à 10.01 et flottera avec le marché, mais ne dépassera jamais la limite de 10.20.

³ Si aucun prix limite (*Prix*) n'est inscrit pour un ordre indexé MKT, l'ordre flotte jusqu'à exécution complète. Ceci s'applique à tous les ordres indexés MKT.