



Division de la balance des paiements

BP-54 Enquête sur les investissements de portefeuille des Canadiens



Statistics
Canada

Statistique
Canada

Canada

Comment obtenir d'autres renseignements...

Toute demande de renseignements au sujet du présent guide ou au sujet de statistiques ou de services connexes doit être adressée à:
Division de la balance des paiements, Statistique Canada, Ottawa, Ontario, K1A 0T6
(téléphone: (613) 951-9051 - facsimile: (613) 951-9031 - courriel: bdp.enquetes@statcan.ca).

Pour obtenir des renseignements sur l'ensemble des données de Statistique Canada qui sont disponibles, veuillez composer l'un des numéros sans frais suivants. Vous pouvez également communiquer avec nous par courriel ou visiter notre site Web.

Service national de renseignements	1 800 263-1136
Service national d'appareils de télécommunications pour les malentendants	1 800 363-7629
Renseignements concernant le Programme des bibliothèques de dépôt	1 800 700-1033
Télécopieur pour le Programme des bibliothèques de dépôt	1 800 889-9734
Renseignements par courriel	infostats@statcan.ca
Site Web	www.statcan.ca

Ce guide est aussi disponible sous forme électronique sur le site Internet de Statistique Canada. Les utilisateurs peuvent en obtenir un exemplaire en visitant notre site Web à www.statcan.ca. et en choisissant la rubrique produits et services.

If you prefer to receive this guide in English, please call toll free at 1-866-765-8143 or visit our web site at www.statcan.ca.

Normes de service à la clientèle

Statistique Canada s'engage à fournir à ses clients des services rapides, fiables et courtois, et ce, dans la langue officielle de leur choix. À cet égard, notre organisme s'est doté de normes de service à la clientèle qui doivent être observées par les employés lorsqu'ils offrent des services à la clientèle. Pour obtenir une copie de ces normes de service, veuillez communiquer avec Statistique Canada au numéro sans frais 1 800 263-1136.

BP-54 Enquête sur les investissements de portefeuille des Canadiens

But de l'enquête	3
Autorité	3
Confidentialité	3
Média	3
Information demandée	3
Format de soumission suggéré.....	4
Contenu des champs	5
Champs 1 : Code ou nom du fonds	5
Champs 2 : Numéro séquentiel	5
Champs 3 : Code d'identification de la valeur mobilière	5
Champs 4 : Symbole boursier	5
Champs 5 : Type de valeurs mobilières ou d'actifs	5
Champs 6 : Nom de l'émetteur	5
Champs 7 : Description de la valeur mobilière	5
Champs 8 : Description industrielle	6
Champs 9 : Valeur au marché	7
Champs 10 : Valeur unitaire	8
Champs 11 : Quantité	9
Champs 12 : Coût moyen	10
Champs 13 : Taux de change	10
Champs 14 : Devise originale	10
Champs 15 : Montant du titre sous prêt	10
Champs 16 : Pays de l'émetteur	10
Champs 17 : Date d'émission	10
Champs 18 : Date d'échéance	10
Champs 19 : Type de coupon - Fixe (F) ou Variable (V)	10
Champs 20 : Coupon ou dividende	10
Champs 21 : Statut	11
Annexe 1 - Types de valeurs mobilières	12
Annexe 2 - Symboles des pays et devises	15

BP-54 Enquête sur les investissements de portefeuille des Canadiens

But de l'enquête

Le but de l'enquête sur les investissements de portefeuille des Canadiens est d'enregistrer la valeur et le type de valeurs détenues par les Canadiens. L'enquête recueille de l'information sous forme détaillée, titre par titre. Les données sont utilisées dans la compilation de la balance des paiements et dans le bilan des investissements internationaux du Canada. L'enquête est coordonnée avec d'autres pays afin de faciliter les comparaisons de données au niveau international. L'enquête vise, en retour, à produire des statistiques sur la distribution industrielle, les instruments financiers et la distribution géographique par type de fonds et par secteur d'investissement.

Autorité

L'information est requise sous la Loi sur la statistique, Lois révisées du Canada, 1985, Chapitre S19. L'enquête est menée sur une base annuelle.

Confidentialité

Les données recueillies en vertu de la Loi sont traitées de façon confidentielle et sont expressément exclues des dispositions relatives à la divulgation que renferme la Loi sur l'accès à l'information.

Média

Les données doivent préférablement être soumises par courrier électronique, disquettes ou rubans magnétiques à l'intérieur d'un unique fichier Excel, Lotus ou ASCII avec délimiteurs. Dans le but d'aider les répondants à préparer leur soumission pour cette enquête, Statistique Canada a développé un format de soumission normalisé auquel vous pouvez vous référer (voir page : 'Format de soumission suggéré').

Mise en garde: L'information envoyée via télécopieur ou par courrier électronique peut, durant son transport, occasionner un risque de divulgation. Statistique Canada confirmera la réception de votre soumission. La confidentialité de l'information est assurée une fois les données acheminées à Statistique Canada.

Information demandée

La mise à jour de la liste de fonds ainsi que vos coordonnées (information pré-imprimée). Les investissements détaillés de vos fonds à l'intérieur d'un unique fichier électronique.

Veillez s.v.p. retourner l'information requise à l'adresse suivante :

Statistique Canada
Division de la balance des paiements
Enquête sur l'investissement de portefeuille des Canadiens (EIPC) 22^{ième}
étage, édifice R.H. Coats
Ottawa, Ontario K1A 0T6
Attention : Éric Boulay
Courrier électronique : cpiabop@statcan.ca
Fac-Similés : 1-613-951-9031

Si vous avez besoin d'éclaircissements au sujet de l'enquête, veuillez s.v.p. téléphoner Éric Boulay au (613) 951-1872 ou utiliser notre numéro sans frais (866) 765-8143.

FORMAT DE SOUMISSION SUGGÉRÉ

** Pour de plus amples renseignements, voir les instructions détaillées à la page suivante. **

Champs	Nom du champs	Nature	Largeur	Décimales
1	Code ou nom du fonds (M)	Alphanumérique	6	
2	Numéro séquentiel	Numérique	6	
3	Code d'identification de la valeur mobilière	Alphanumérique	12	
4	Symbole boursier	Alphanumérique	10	
5	Type de valeurs mobilières (M)	Numérique	2	
6	Nom de l'émetteur (M)	Caractère	65	
7	Description de la valeur mobilière	Caractère	65	
8	Description industrielle	Caractère	40	
9	Valeur au marché (M)	Numérique	12	
10	Valeur unitaire	Numérique	12	4
11	Quantité (M)	Numérique	12	
12	Coût moyen	Numérique	12	
13	Taux de change	Numérique	7	4
14	Devise originale (M)	Caractère	3	
15	Montant du titre sous prêt	Numérique	12	
16	Pays de l'émetteur (M)	Caractère	3	
17	Date d'émission	Date (MMJJAAAA)	8	
18	Date d'échéance (M)	Date (MMJJAAAA)	8	
19	Type de coupon	Caractère	1	
20	Coupon ou dividende	Numérique	7	4
21	Statut	Caractère	1	
(M) :	Champs obligatoires	TOTAL	234	12

CONTENU DES CHAMPS

- Champs 1 : *Code ou nom du fonds* - Incrire le code ou le nom des fonds.
- Champs 2 : *Numéro séquentiel* - En débutant avec 1, numéroter les enregistrements séquentiellement. Le dernier enregistrement devrait correspondre au nombre total d'enregistrements.
- Champs 3 : *Code d'identification de la valeur mobilière* - Incrire le code d'identification de la valeur mobilière. Par exemple, inscrire les 9 caractères pour un code CUSIP ou 12 caractères pour un code ISIN. Si un code n'est pas disponible, laisser ce champs vide. Ne pas utiliser de codes générés à l'interne.
- Champs 4 : *Symbole boursier* - Si disponible, inscrire le symbole boursier de la valeur mobilière.
- Champs 5 : *Type de valeurs mobilières ou d'actifs* - Incrire le type de valeurs mobilières en utilisant les codes suivants¹ :
1. Actions (incluant les bons et les droits de souscription)
 2. Obligations et débentures
 3. Instruments du marché monétaire
 4. Options
 5. Contrats à terme (futures)
 6. Contrats à terme hors cote (forwards)
 7. Encaisse
 8. Hypothèques
 9. Immobilisations
 10. Unités de fonds mutuels, pension, et sociétés en fiducie
 11. SWAPS
- Champs 6 : *Nom de l'émetteur* - Incrire le nom de l'émetteur de la valeur mobilière. Pour les produits dérivés, inscrire la valeur mobilière sous-jacente : Ex: Gouvernement du Canada
Ex: Corporation ABC
- Champs 7 : *Description de la valeur mobilière* - Fournir une information descriptive du titre. Pour les actions :
- Ex: ADR (certificat américain d'actions étrangères) Ex:
Actions subalternes
Ex: Reçu de versement
Ex: Actions privilégiées convertibles

¹ S.V.P. Consulter l'annexe 1 pour une description plus détaillée.

Ex: Actions ordinaires

Pour les obligations :

Ex: Débentures convertibles

Ex: Obligations à taux variable

Pour les instruments de marché monétaire : Ex:

Bon du Trésor

Pour les options :

Ex: Options d'achat et options de vente

Pour les contrats à terme (futures) : (non nécessaire)

Pour les contrats à terme hors cote (forward) :

Ex: Achat de livres sterling - Vente de dollars US

Champs 8: *Description industrielle* -Si possible, utiliser les codes qui suivent. Sinon, fournir une information descriptive.

Secteur	Description	SIC
A	Produits alimentaires, boissons, tabac	B
	Forêt et papier	
C	Énergie	
D	Produits chimiques et textiles	
E	Mines et produits métalliques	
F	Machinerie et équipement (sauf équipement électrique)	G
	Équipement de transport	
H	Produits électriques et électroniques	
I	Construction et activités reliées	
J	Services de transport	
K	Communications	
L	Finances et assurances	
M	Services généraux aux entreprises	
N	Services gouvernementaux	
O	Éducation, santé et services sociaux	
P	Restaurants et services récréatifs	
Q	Produits alimentaires, commerce de détail	R
	Biens et services de consommation	

Champs 9 : *Valeur au marché* - En dollars canadiens

Pour les actions (incluant bons et droits de souscription), inscrire le prix de l'action (champs 10) multiplié par le nombre d'actions (champs 11) converti en dollars canadiens.

Pour les obligations et les instruments du marché monétaire, inscrire le prix exprimé en pourcentage (champs 10) multiplié par la valeur au pair (champs 11).

Si vous rapportez une position négative, inscrire "R" au **champs 21**. *Une position négative existe lorsqu'un titre est acquis sous prêt de titres (security lending) ou de pension livrée (REPO) et qu'il est revendu à une tierce partie.*

Pour les options, inscrire le nombre de contrats, fois le multiplicateur, fois la prime.

Options sur actions

Exemple: 50 options d'achat IBM Jan97/ 130 à 8¾ (prix du marché à la date du sondage).

Calcul: Nombres de contrats (50) X multiplicateur (\$100) X prime
 $50 * 100 * (8\frac{3}{4}) = \$43,750 \text{ US\$} \quad \longrightarrow \quad 59,763 \text{ Cdn\$} (59,673 * 1.4433)$

Options sur indices

Exemple: 20 options d'achat S&P 500 May/655 à 14½ (prix du marché à la date du sondage).

Calcul: Nombres de contrats (20) X multiplicateur (\$500) X prime
 $20 * 500 * (14\frac{1}{2}) = \$145,000 \text{ US\$} \quad \longrightarrow \quad 198,070 \text{ Cdn\$} (145,000 * 1.4433)$

Options sur devises

Exemple: Transaction sur la bourse de Philadelphie 100 options d'achat livre sterling Dec/166. à .70 (prix du marché à la date du sondage).

Calcul: Nombres de contrats (100) X multiplicateur (\$31,250) X prime
 $100 * 31,250 * (.0070) = \$21,875 \text{ US\$} \quad 29,881 \text{ Cdn\$} (21,875 * 1.4433)$

Pour les contrats à terme (futures) :

Contrats sur obligations : inscrire le nombre de contrats fois le multiplicateur, fois le cours du contrat (spot price) moins le prix d'exercice (strike price).

Exemple: 20 / 5 ans US treasury. Prix d'exercice = 98.25 Cours du contrat = 97.75

Calcul: Nombre de contrats (20) X multiplicateur (\$100,000) X (cours-prix d'exercice)
 $20 * 100,000 * (.9775 - .9825) = -\$10,000 \text{ US\$} \quad \longrightarrow \quad -13,660 \text{ Cdn\$} (10,000 * 1.4433)$

Contrats sur indices : inscrire le nombre de contrats fois la valeur future du multiplicateur, fois le cours du contrat (spot price) moins le prix d'exercice (strike price).

Exemple: 50 S&P 500.

Calcul: Nombre de contrats (10) X multiplicateur (\$500) X (cours-prix d'exercice)
 $10 * 500 * (655.86 - 659.60) = -18,700 \text{ US\$ } -25,544 \text{ Cdn\$ } (18,700 * 1.4433)$

Contrats sur devises : inscrire le nombre de contrats fois la valeur future du multiplicateur, fois le cours du contrat (spot price) moins le prix d'exercice (strike price).

Exemple: 20 Mark .7618.

Calcul: Nombre de contrats (20) X multiplicateur (\$125,000) X (cours-prix d'exercice)
 $20 * 125,000 * (.6752 - .6685) = 16,750 \text{ Marks } \rightarrow 15,075 \text{ Cdn\$ } (16,750 * .9)$

Pour les contrats à terme hors cote (forwards) :

Inscrire la plus-value (moins-value) non-réalisée en dollars canadiens.

Pour l'encaisse :

Inscrire le montant en dollars canadiens.

Champs 10 : *Valeur unitaire*

Pour les actions, inscrire la valeur unitaire par action, bon ou droit de souscription en dollars canadiens.

Pour les obligations et les instruments du marché monétaire, inscrire la valeur unitaire en pourcentage de la valeur au pair détenue.

Pour les options, inscrire la valeur unitaire fois le multiplicateur en dollars canadiens. **Pour les contrats à terme (futures)**, inscrire la valeur unitaire en dollars canadiens. **Pour les contrats à terme hors cote (forwards)**, laisser ce champs vide.

Pour l'encaisse, laisser ce champs vide.

La valeur unitaire doit refléter le prix au marché au temps du sondage. Les valeurs mobilières doivent être converties en dollars canadiens en utilisant le taux de change qui prévaut à la date du sondage. S.v.p. indiquer tous les fonds non convertis en dollars canadiens.

Pour les actions (incluant bons et droits de souscription)

Pour les titres cotés à la bourse, le prix de clôture à la bourse à la date du sondage doit être utilisé.

Pour les titres non cotés, si le prix au marché n'est pas disponible à la date du sondage, estimer la valeur de l'actif en utilisant l'une des méthodes suivantes :

- le prix d'une transaction récente ;
- évaluation d'un directeur; ou
- valeur nette (la valeur nette équivaut à l'actif total, incluant les actifs incorporels moins le passif, excluant l'avoir des actionnaires et la valeur au livre des actions non-votantes acquises et payées. Les actifs et passifs devraient être enregistrés au prix courant et non au prix historique.)

Pour les obligations et les instruments du marché monétaire :

Les obligations doivent être enregistrées selon l'une des méthodes suivantes :

- un prix coté (exprimé en pourcentage) à la fermeture des marchés de la période enquêtée ;
- la valeur présente des sommes à recevoir du titre obligataire ou instrument du marché monétaire ;
- pour les titres non cotés, utiliser le prix d'évaluation pour fin comptable ;
- pour les obligations à prix inférieur au pair, utiliser le prix d'achat de l'émission plus l'amortissement entre le prix d'achat et le montant payable ;
- valeur qui peut se comparer à une obligation de même qualité.

Pour les options :

Le prix utilisé pour les options cotées en bourse et le prix de fermeture qui prévaut sur les marchés à la date du sondage.

Pour les options hors bourse ou celles cotées en bourse et dont le prix n'est pas disponible à la date du sondage, veuillez estimer la valeur de l'option en utilisant l'une des méthodes suivantes :

- le prix d'une transaction récente ;
- évaluation d'un directeur

Pour les contrats à terme (*futures*) :

Pour les contrats à terme (*futures*), inscrire le prix du marché. Le prix du marché équivaut au cours du contrat (*spot price*) de l'actif sous-jacent, moins le prix d'exercice (*strike price*) de l'actif sous-jacent. À partir de l'exemple pour le contrat à terme sur une obligation à l'**item 9**, le calcul du prix s'effectue comme suit :

$$.9775 \text{ (cours du contrat)} - .9825 \text{ (prix d'exercice)} = -.005 \text{ Pour}$$

les contrats à terme hors cote (*forwards*) :

Laisser ce champs vide.

Pour l'encaisse :

Laisser ce champs vide.

Champs 11 : *Quantité*

Pour les actions (incluant les bons et droits de souscription), inscrire le nombre d'actions.

Pour les fonds communs de placement ou les sociétés d'investissement en fiducie, inscrire le nombre arrondi d'unités.

Pour les obligations, inscrire la valeur au pair détenue en devises originales. Pour les titres adossés, inscrire la valeur au pair du montant principal qu'il reste à payer.

Pour les instruments du marché monétaire, inscrire la valeur au pair à l'échéance.

Pour les options et contrats à terme (*futures*), inscrire le nombre de contrats.

Pour les contrats à terme hors cote (*forwards*), inscrire le montant à recevoir à l'échéance du contrat en devises originales.

Pour l'encaisse, laisser ce champs vide.

Champs 12 : *Coût moyen* - Entrer le coût moyen (coût historique) de la valeur mobilière détenue.

Champs 13 : *Taux de change* - Inscrire le taux de change utilisé pour convertir le **champs 9** en dollars canadiens. Ce taux devrait être celui qui prévaut à la date du sondage.

Ex: La valeur au marché d'un titre américain converti en dollars canadiens (**champs 9**) divisée par la valeur au marché du titre américain en dollars américains.

Champs 14 : *Devise originale* - Inscrire le code à 3 lettres de la devise figurant à l'**annexe 2** du présent document.

Champs 15 : *Montant du titre sous prêt*

Pour les obligations, inscrire la valeur au pair du **champs 11** prêtée sous pension livrée (REPO)

Pour les actions, inscrire le nombre d'actions, apparaissant au **champs 11**, sous prêt de titres (*security lending*).

Champs 16 : *Pays de l'émetteur* - Inscrire le code à 2 lettres du pays d'émission de la valeur mobilière figurant à l'**annexe 2**.

Champs 17 : *Date d'émission* - Inscrire la date d'émission de la valeur mobilière. Format : **MMJJAAAA**.

Champs 18 : *Date d'échéance* - Inscrire la date d'échéance de la valeur mobilière. Format : **MMJJAAAA**. Pour une valeur mobilière rachetable, inscrire la date d'échéance et non la date de rachat.

Champs 19 : *Type de coupon* - Fixe (F) ou Variable (V)

Inscrire "F" pour un taux fixe ou "V" pour un taux flottant ou variable.

Champs 20 : *Coupon ou dividende*

Pour les obligations, inscrire le taux annuel du coupon. Pour les obligations à taux variable, inscrire le taux qui prévalait au moment de l'enquête.

Pour les actions, inscrire le valeur annuelle du dividende.

Pour les obligations à coupons détachés, inscrire 0.0000.

Champs 21 : *Statut* - Incrire "D" si la valeur mobilière est en défaut de paiement d'intérêt.

Incrire "R" si la valeur mobilière est obtenue dans une transaction de pension livrée (REPO) ou de prêts de titres (*security lending*) et revendue à une tierce partie.

ANNEXE 1 - TYPES DE VALEURS MOBILIÈRES

Actions = type de valeurs mobilières 1

- actions ordinaires ;
- actions de classe A, actions de classe B, actions subalternes;
- quittance dépositaire, i.e., certificats américains d'actions étrangères (ADR), devraient être attribués au pays de résidence de la compagnie émettrice;
- actions vendues sous pension livrée (REPO) et
- actions qui ont été prêtées sous prêts de titres (security lending) :
 - i) Les valeurs mobilières acquises sous prêts de titres (security lending) ou sous pension livrée (REPO) ne doivent pas être incluses dans le rapport;
 - ii) *Les valeurs mobilières acquises sous pension livrée (REPO) ou sous prêts de titres (security lending) et vendues à une tierce personne devraient être inscrites comme des positions négatives aux **champs 8 et 10** et la lettre "R" devrait apparaître au **champs 21**.*
- bons et droits de souscription
 - i) droits de souscriptions;
 - ii) bons de souscription;
 - iii) bons sur devises.

Obligations (ayant une échéance originale de plus d'un an) = type de valeurs mobilières 2

- obligations, obligations à coupons détachés ou coupon zéro, obligations à escompte, obligations liées aux devises (currency linked (i.e., dual-currency)), obligations à taux flottant, débentures convertibles, obligations type "eurobonds";
- titres adossés tels que titres hypothécaires, obligations garanties par nantissement d'hypothèques (CMO);
- billets ou dépôts liés à un indice (index-linked securities, i.e. "property index certificates");
- actions privilégiées (participantes, non-participantes, convertibles);
- différents types de billets à taux flottant (FRN), billets perpétuels (PRN), et billets à taux variable (VRN);
- billets à moyen terme;
- Schuldscheine (obligations allemandes), gilt (obligations de la Grande Bretagne), O.A.T. (obligations de France);
- obligations échéant en série ou par tranche et ayant une **échéance originale de plus d'un an**;
- débentures ayant une **échéance originale de plus d'un an**;

- certificats de dépôt négociables ayant une **échéance originale de plus d'un an**;
- autres valeurs mobilières ayant une **échéance originale de plus d'un an**;
- quittance dépositaire au porteur (bearer depositary receipts (BDR)), devrait être attribuée au pays de résidence de l'émetteur de cette valeur mobilière;
- titres obligataires ayant une **échéance originale de plus d'un an** prêtés sous pension livrée (REPO) ; et
- titres obligataires ayant une **échéance originale de plus d'un an** prêtés sous prêts de titres (security lending) :
 - i) Les valeurs mobilières acquises sous prêts de titres (security lending) ou sous pension livrée (REPO) ne doivent pas être incluses dans le rapport;
 - ii) *Les valeurs mobilières acquises sous pension livrée (REPO) ou sous prêts de titres (security lending) et vendues à une tierce personne devraient être inscrites comme des positions négatives aux **champs 8 et 10** et la lettre "R" devrait apparaître au **champs 21**.*

Instruments du marché monétaire (ayant une échéance originale de moins d'un an) = type de valeurs mobilières 3

- obligations, obligations coupons détachés ou zéro coupon, obligations à escompte, obligations liées aux taux de change (*currency linked*) (ex : obligations dont les intérêts et le principal sont payables en différentes devises), obligations à taux flottant, débentures convertibles et obligations de type Euro (eurobonds) ayant une échéance originale de moins d'un an;
- papier commercial;
- notes à escompte;
- titres adossés tels que titres hypothécaires, obligations garanties par nantissement de titres;
- billets ou dépôts liés à un indice (index-linked securities, (i.e., property index certificates);
- actions privilégiées non participantes;
- différents types d'obligations à taux flottant (FRN), billets perpétuels (PRN) et billets à taux variable (VRN);
- billets à moyen terme ;
- Schuldscheine (obligations allemandes), gilt (obligations de la Grande Bretagne), O.A.T. (obligations de France);
- obligations échéant en série et **ayant une échéance originale de moins d'un an**;
- débentures **ayant une échéance originale de moins d'un an**;
- certificats de dépôt négociables **ayant une échéance originale de moins d'un an**;
- autres valeurs mobilières à court terme **ayant une échéance originale de moins d'un an**;
- quittance dépositaire au porteur (bearer depositary receipts (BDR)), devrait être attribuée au pays de résidence de l'émetteur de la valeur mobilière;
- titres obligataires **ayant une échéance originale de moins d'un an** prêtés sous pension de titres (REPO) et;

- titres obligataires **ayant une échéance originale de moins d'un an** prêtés sous prêts de titres (security lending);
 - i) Les valeurs mobilières acquises sous prêts de titres (security lending) ou sous pension livrée (REPO) ne doivent pas être incluses dans le rapport ;
 - ii) *Les valeurs mobilières acquises sous pension livrée (REPO) ou sous prêts de titres (security lending) et vendues à une tierce personne devraient être inscrites comme des positions négatives aux **champs 8 et 10** et la lettre "R" devrait apparaître au **champs 21**.*

Produits dérivés

Options = type de valeurs mobilières 4 :

Options sur actions, indices, devises, taux d'intérêt, contrats à terme (futures) et marchandises.

Caractéristiques

- Options : achat, vente ;
- Acheteur ou vendeur ;
- Type américain ou européen.

Contrats à terme (futures) = type de valeurs mobilières 5 :

Contrats à terme (*futures*) sur devises, indices, taux d'intérêt, métaux, pétrole, et autres.

Caractéristiques

- Détenues ou vendus à découvert.

Contrats à terme hors cote (forwards) = type de valeurs mobilières 6 : Tous les

types de contrats à terme (*forwards*).

Encaisse = type de valeurs mobilières 7

- Encaisse et autres dépôts ;
- Autres investissements de portefeuille

ANNEXE 2 - SYMBOLES DES PAYS ET DEVISES

Veuillez s.v.p. utiliser les codes ci-dessous pour les pays et devises d'émission des titres rapportés.

PAYS	SYMBOLE	DEVISES	SYMBOLE
AFGHANISTAN	AF	AFGANI	AFA
AFRIQUE DU SUD	ZA	RAND	ZAR
ALBANIE	AL	LEK	ALL
ALGÉRIE	DZ	DINAR ALGÉRIEN	DZD
ALLEMAGNE	DE	DEUTSCHE MARK	DEM
ANDORRE	AD	FRANC FRANÇAIS, PESETA	ADP
ANGOLA	AO	KWANZA	AOK
ANTIGUA ET BARBUDA	AG	DOLLAR DES CARAÏBES ORIENTALES	XCD
ARABIE SAOUDITE	SA	RIYAL	SAR
ARGENTINE	AR	PESO	ARS
ARMÉNIE	AM	DRAM	AMD
AUSTRALIE	AU	DOLLAR AUSTRALIEN	AUD
AUTRICHE	AT	SCHILLING	ATS
AZERBAÏDJAN	AZ	MANAT	AZM
BAHAMAS	BS	DOLLAR DES BAHAMAS	BSD
BAHRAYN	BH	DINAR DE BAHREÏN	BHD
BANGLADESH	BD	TAKA	BDT
BARBADES	BB	DOLLAR DES BARBADES	BBD
BELARUS	BY	ROUBLE	BYR
BELGIQUE	BE	FRANC BELGE	BEF
BELIZE	BZ	DOLLAR DE BELIZE	BZD
BÉNIN	BJ	FRANC CFA-BCEAO	XOF
BERMUDES	BM	DOLLAR DES BERMUDES	BMD
BHOUTAN	BT	NGULTRUM	BTN
BOLIVIE	BO	BOLIVIANO	BOB
BOSNIE-HERZÉGOVINE	BA	DINAR	BAD
BOTSWANA	BW	PULA	BWP
BRÉSIL	BR	REAL	BRE
BRUNÉI	BN	DOLLAR DE BRUNÉI	BND
BULGARIE	BG	LEV	BGL
BURKINA FASO (HAUTE VOLTA)	BF	FRANC CFA-BCEAO	XOF
BURUNDI	BI	FRANC DU BURUNDI	BIF
CAMERON (RÉPUBLIQUE DU)	CM	FRANC CFA-BEAC	XAF
CANADA	CA	DOLLAR CANADIEN	CAD
CAP-VERT	CV	ESCUDO DU CAP-VERT	CVE
CHILI	CL	PESO CHILIEN	CLP
CHINE	CN	YUAN	CNY
CHYPRE	CY	LIVRE CYPRIOTE	CYP
COLOMBIE	CO	PESO COLOMBIEN	COP
COMMUNAUTÉ ÉCO. EUROPÉENNE	ZZ	UNITÉ DE COMPTE EUROPÉENNE	ECU
CONGO	CG	FRANC CFA-BEAC	XAF
CORÉE DU NORD	KP	WON	KPW
CORÉE DU SUD	KR	WON	KRW
COSTA RICA	CR	COLÒN	CRC
CÔTE D'IVOIRE	CI	FRANC CFA-BCEAO	XOF

ANNEXE 2 - SYMBOLES DES PAYS ET DEVISES (Suite)

Veuillez s.v.p. utiliser les codes ci-dessous pour les pays et devises d'émission des titres rapportés.

PAYS	SYMBOLE	DEVISES	SYMBOLE
CROATIE	HR	KUNA	HRK
CUBA	CU	PESO CUBAIN	CUP
DANEMARK	DK	COURONNE DANOISE	DKK
DJIBOUTI	DJ	FRANC DE DJIBOUTI	DJF
DOMINIQUE	DM	DOLLAR DES CARAÏBES ORIENTALES	XCD
ÉGYPTE	EG	LIVRE ÉGYPTIENNE	EGP
ÉMIRATS ARABES UNIS	AE	DIRHAM	AED
ÉQUATEUR	EC	SUCRE	ECS
ESPAGNE	ES	PESETA	ESP
ESTONIE	EE	COURONNE ESTONIENNE	EEK
ÉTATS-UNIS	US	DOLLAR AMÉRICAIN	USD
ÉTHIOPIE	ET	BIRR	ETB
FIDJI	FJ	DOLLAR FIDGIEN	FJD
FINLANDE	FI	MARKKA	FIM
FRANCE	FR	FRANC FRANÇAIS	FRF
GABON	GA	FRANC CFA-BEAC	XAF
GAMBIE	GM	DALASI	GMD
GEORGIE	GE	LARI	GEL
GHANA	GH	CÉDI	GHC
GIBRALTAR	GI	LIVRE DU GIBRALTAR	GIP
GRÈCE	GR	DRACHME	GDA
GUADELOUPE	GP	FRANC FRANÇAIS	FRF
GUATÉMALA	GT	QUETZAL	GTQ
GUINÉE	GN	FRANC GUINÉEN	GNF
GUINÉE ÉQUATORIALE	GQ	FRANC CFA-BEAC	XAF
GUINÉE-BISSAU	GW	PESO	GWP
GUYANNE	GY	DOLAR GUYANNAIS	GYP
HAÏTI	HT	GOURDE	HTG
HONDURAS	HN	LEMPIRA	HNL
HONG KONG	HK	DOLLAR DE HONG KONG	HKD
HONGRIE	HU	FORINT	HUF
ILES CAYMAN	KY	DOLLAR DES ILES CAYMAN	KYD
ILES MALOUINES	FK	LIVRE DE MALOUINE	FKP
ILES VIERGES AMÉRICAINES	VI	DOLLAR AMÉRICAIN	USD
ILES VIERGES BRITANNIQUES	VG	DOLLAR AMÉRICAIN	USD
INDE	IN	ROUPIE INDIENNE	INR
INDONÉSIE	ID	RUPIAH	IDR
IRAN	IR	RIAL	IRR
IRAQ	IQ	DINAR IRAKIEN	IQD
IRLANDE	IE	LIVRE IRLANDAISE	IEP
ISLANDE	IS	COURONNE ISLANDAISE	ISK
ISRAËL	IL	SHEKEL	ILS
ITALIE	IT	LIRE ITALIENNE	ITL
JAMAÏQUE	JM	DOLLAR JAMAÏCAIN	JMD
JAPON	JP	YEN	JPY

ANNEXE 2 - SYMBOLES DES PAYS ET DEVISES (Suite)

Veuillez s.v.p. utiliser les codes ci-dessous pour les pays et devises d'émission des titres rapportés.

PAYS	SYMBOLE	DEVISES	SYMBOLE
JORDANIE	JO	DINAR JORDANIEN	JOD
KAZAKHSTAN	KZ	TENGE	KZT
KÉNYA	KE	SHILLING DU KÉNYA	KES
KIRIBATI (CANTON & ENDERBURY)	KI	DOLLAR AUSTRALIEN	AUD
KOWEIT	KW	DINAR KOWEÏTIEN	KWD
KYRGHYZSTAN	KG	SOM	KGS
LAOS	LA	KIP	LAK
LESOTHO	LS	LOTI	LSM
LETTONIE	LV	LATS	LVL
LIBAN	LB	LIVRE LIBANAISE	LBP
LIBÉRIE	LR	DOLLAR LIBÉRIEN	LRD
LIBYE	LY	DINAR LIBYEN	LYD
LIECHTENSTEIN	LI	FRANC SUISSE	CHF
LITUANIE	LT	LITAS	LTL
LUXEMBOURG	LU	FRANC LUXEMBOURGEOIS	LUF
MACAU	MO	PATACA	MOP
MACÉDOINE	MK	DENAR	MKD
MADAGASCAR	MG	FRANC MALGACHE	MGF
MALAWI	MW	KWACHA	MWK
MALAYSIE	MY	RINGGIT	MYR
MALDIVES	MV	RUFYAA	MVR
MALI	ML	FRANC CFA-BCEAO	XOF
MALTE	MT	LIRE MALTAISE	MTL
MAROC	MA	DIRHAM	MAD
MAURICE	MU	ROUPIE MAURICIENNE	MUR
MAURITANIE	MR	OUGUIYA	MRO
MEXICO	MX	PESO MEXICAIN	MXN
MOLDAVIE	MD	LEU	MDL
MONACO	MC	FRANC FRANÇAIS	FRF
MONGOLIE	MN	TUGRIK	MNT
MOZAMBIQUE	MZ	METICAL	MZM
NAMIBIE	NA	DOLLAR NAMIBIEN	NAD
NÉPAL	NP	ROUPIE NÉPALAISE	NPR
NICARAGUA	NI	CÔRDOBA	NIC
NIGER	NE	FRANC CFA-BCEAO	XOF
NIGÉRIA	NG	NAIRA	NGN
NORVÈGE	NO	COURONNE NORVÉGIENNE	NOK
NOUVELLE ZÉLANDE	NZ	DOLLAR NÉO-ZÉLANDAIS	NZD
OMAN	OM	RIYAL D'OMAN	OMR
OUGANDA	UG	SHILLING OUGANDAIS	UGS
OUZBÉKISTAN	UZ	ROUBLE	UZR
PAKISTAN	PK	ROUPIE DU PAKISTAN	PKR
PANAMA	PA	BALBOA	PAB
PAPOUASIE- NOUVELLE GUINÉE	PG	KINA	PGK
PARAGUAY	PY	GUARANI	PYG

ANNEXE 2 - SYMBOLES DES PAYS ET DEVISES (Suite)

Veillez s.v.p. utiliser les codes ci-dessous pour les pays et devises d'émission des titres rapportés.

PAYS	SYMBOLE	DEVISES	SYMBOLE
PAYS-BAS	NL	FLORIN	NLG
PAYS-BAS HOLLANDAIS	AN	FLORIN HOLLANDAIS	ANG
PÉROU	PE	SOL	PEN
PHILIPPINES	PH	PESO	PHP
POLOGNE	PL	ZLOTY	PLZ
PORTUGAL	PT	ESCUDO	PTE
PUERTO RICO	PR	DOLLAR AMÉRICAIN	USD
QATAR	QA	RIYAL	QAR
RÉPUBLIQUE CENTRALE D'AFRIQUE	CF	FRANC CFA-BEAC	XAF
RÉPUBLIQUE DOMINICAINE	DO	PESO DOMINICAIN	DOP
RÉPUBLIQUE TCHÈQUE	CZ	COURONNE TCHÈQUE	CZK
ROUMANIE	RO	LEU	ROL
ROYAUME-UNI	GB	LIVRE STERLING	GBP
RUSSIE	RU	ROUBLE	RUR
RWANDA	RW	FRANC RWANDAIS	RWF
SAINTE-LUCIE	LC	DOLLAR DES CARAIBES	XCD
SAINT-PIERRE ET MIQUELON	PM	FRANC FRANÇAIS	FRF
SALVADOR	SV	COLÒN	SVC
SAMOA	WS	TALA	WST
SAO TOMÉ ET PRINCIPE	ST	DOBRA	STD
SÉNÉGAL	SN	FRANC CFA-BCEAO	XOF
SEYCHELLES	SC	ROUPIE DES SEYCHELLES	SCR
SIERRA LEONE	SL	LEONE	SLL
SINGAPOUR	SG	DOLLAR DE SINGAPOUR	SGD
SLOVÉNIE	SI	TOLAR	SIT
SOMALIE	SO	SHILLING	SOS
SOUDAN	SD	LIVRE SOUDANAISE	SDD
SRI LANKA	LK	ROUPIE SRI LANKAIS	LKR
SUÈDE	SE	COURONNE SUÉDOISE	SEK
SUISSE	CH	FRANC SUISSE	CHF
SURINAM	SR	GUINÉE DU SURINAME	SRG
SWAZILAND	SZ	LILANGENI	SZL
SYRIE	SY	LIVRE SYRIENNE	SYP
TADJIKISTAN	TJ	ROUBLE	TJR
TAIWAN	TW	DOLLAR DE TAIWAN	TWD
TANZANIE	TZ	SHILLING	TZS
TCHAD	TD	FRANC CFA-BCEAO	XOF
TERRITOIRE DE L'OCÉAN INDIEN	IO	DOLLAR AMÉRICAIN	USD
THAÏLANDE	TH	BAHT	THB
TIMOR EST	TP	RUPIAH	TPR
TOGO	TG	FRANC CFA-BCEAO	XOF
TRINITÉ ET TOBAGO	TT	DOLLAR DE LA TRINITÉ	TTD
TUNÉSIE	TN	DINAR TUNÉSIEN	TND
TURKMÉNISTAN	TM	MANAT	TMM
TURQUIE	TR	LIVRE TURQUE	TRL

ANNEXE 2 - SYMBOLES DES PAYS ET DEVISES (Suite)

Veillez s.v.p. utiliser les codes ci-dessous pour les pays et devises d'émission des titres rapportés.

PAYS	SYMBOLE	DEVISES	SYMBOLE
UKRAINE	UA	HRYVNA	UAH
UNION EUROPÉENNE	UE	EURO DOLLAR	EUR
URUGUAY	UY	PESO URUGAYEN	UYU
VÉNÉZUÉLA	VE	BOLIVAR	VEB
VIETNAM	VN	DONG	VND
YÉMEN	YE	RIAL DU YÉMEN	YER
YOUGOSLAVIE	YU	DINAR	YUD
ZAIRE	ZR	ZAIRE	ZRN
ZAMBIE	ZM	KWACHA	ZMK
ZIMBABWE	ZW	DOLLAR DU ZIMBABWE	ZWD

FORMAT DE SOUMISSION
ENTRÉE DE DONNÉES (EXEMPLES)

CHAMPS 1	CHAMPS 2	CHAMPS 3	CHAMPS 4	CHAMPS 5	CHAMPS 6	CHAMPS 7	CHAMPS 8	CHAMPS 9	CHAMPS 10	CHAMPS 11	CHAMPS 12	CHAMPS 13	CHAMPS 14	CHAMPS 15	CHAMPS 16	CHAMPS 17	CHAMPS 18	CHAMPS 19	CHAMPS 20	CHAMPS 21																					
Code du fonds (M)	Séquence	CUSIP - ISIN	Symbole boursier	Type de valeurs (M)	Nom de l'émetteur (M)	Description du titre	Description industrielle	Valeur marchande (M)	Valeur unitaire	Quantité (M)	Coût moyen	Taux de change	Devise originale (M)	Montant sous prêt	Pays de l'émetteur (M)	Date d'émission (MDDYYYY)	Date d'échéance (M)	Type de coupon	Coupon ou dividende	Statut																					
Alphanumérique	Numérique	Alphanumérique	Alphanumérique	Numérique	Caractère	Caractère	Caractère	Numérique	Numérique	Numérique	Numérique	Numérique	Caractère	Numérique	Caractère	Date (MDDYYYY)	Date (MDDYYYY)	Caractère	Numérique	Caractère																					
Largeur: 6	6	12	10	2	65	65	30	12	16	12	12	7	3	12	3	8	8	1	7	1																					
Décimales:									4				4				4																								
Positions: 1-6		7-12		13-24		25-34		35-36		37-66		67-106		107-136		137-148		149-164		165-176		177-188		189-195		196-198		199-210		211-213		214-221		222-229		230-230		231-237		238-238	
FONDS 01	1	135087V04		2	GOUVERNEMENT DU CANADA	OBLIGATIONS GOUV'T DU CANADA	Gouvernement	2,763,900	92.1300	3,000,000	2,760,400		CAD	1,000,000	CA		6012004	F	6.5000																						
FONDS 01	2	36962FW77	GE	2	GENERAL ELECTRIC CAPITAL CO	BILLETS À MOYENNE ÉCHÉANCE (MTN)	Placement privé	6,307,462	141.7407	4,450,000	6,257,459	1.370800	USD		US		05061996	F	6.8000																						
FONDS 01	3	31358KCS5	FNM	2	FEDERAL NATL MTG ASSN GTD	FANNI MAE	Gouvernement	936,905	124.9207	750,000	935,950	1.366000	USD		US		11252021	V	6.4000																						
FONDS 01	4		BMO.PR.D	2	BANQUE DE MONTRÉAL	ACTIONS PRIVILÉGIÉES	Placement privé	3,425,000	27.4000	125,000	3,550,400		CAD		CA			F	8.2500																						
FONDS 01	5		TEE.DB	2	TEE-COM	DÉBENTURES	Placement privé	(101,520)	101.5200	100,000			CAD		CA		06062001	F	5.2500	R																					
FONDS 01	6	912794Y32		3	GOUVERNEMENT AMÉRICAIN	BON DU TRÉSOR	Gouvernement	67,787,750	135.5755	50,000,000	65,520,145	1.366000	USD		US		07051996																								
FONDS 01	7			3	GOUVERNEMENT MEXICAIN	BON DU TRÉSOR	MEXICAIN	Gouvernement	18,117,000	11,160,874	2,030,200	0.183000	MXN		MX		01111996																								
FONDS 01	8	878742204	TEK.B	1	TECK CORP.	ACTIONS SUBALTERNES, CLASSE B	Mines et Minéraux	14,872,000	25.9909	572,200	14,015,265	1.366000	USD		CA				0.20																						
FONDS 02	1	500631106	KEP	1	KOREA ELECTRIC POWER CORP	CERT. D'ACTIONS ÉTRAN. US (ADR)	Électroniques	1,530,000	51.0000	30,000	1,425,600	1.366000	USD		KP																										
FONDS 02	2		HIT	1	HITACHI	HITACHI Y50 BDR	Communications	135,200	13.5200	10,000	135,700	0.012930	JPY		JP																										
FONDS 02	02	319276A1043		1	TELECOM ITALIA MOBILE	SPA ORD (IL50 PAR)	Communications	300,000	257.0000	74,890								0.000830		IT																					
FONDS 02	4			1	FRASER AND NEAVE LTD	ORD		630,000	10.5000	60,000	630,450	0.534600	SGD		SG																										
FONDS 02	5		IBM	4	IBM	OPTION ACHAT, IBM JAN 1997, 130	Hautes tech	59,763	11.9525	50		1.366000	USD		US		21011997																								
FONDS 02	6		OEX	4	S & P 500	OPTION ACHAT, S&P 500, MAY '96	Indices	198,070	19.8070	20		1.366000	USD		US		21051996																								
FONDS 02	7			4	LIVRES STERLING	OPTION ACHAT, LIVRES, DEC 166	Devises	29,881	0.9562	100		1.366000	USD		GB		12211996																								
FONDS 02	8			6	PAIE CDNS REÇOIT GBP	CONTRAT À TERME SUR DEVICES	Forward	-		645,000		2.036784	GBP		GB		04111996	07151996																							
FONDS 02	9			6	PAIE YEN REÇOIT US\$	CONTRAT À TERME SUR DEVICES	Forward	914		72,254		0.012950	USD		US		06151996	12151996																							
FONDS 02	10			5	US 5 YEAR TREASURY	MAY 1996, 98.5		(13,600)	(0.6830)	20		1.366000	USD		US		10121995	05151996																							
FONDS 02	11			5	S & P 500	MAY 1996, 659.60		(25,544)	(5.1088)	10		1.366000	USD		US		01011996	05051996																							
FONDS 02	12			5	D-MARK	D-MARK MAY 1996, 6685		22,881	0.0060	20		1.366000	USD		DE		12051995	05181996																							
FONDS 02	14			139	IMMEUBLE	COMMERCIAL				Immobilier	25,000																														
FONDS 02	14			7	DOLLARS US	US \$		1,400,000				1.366000	USA																												
FONDS 02	15		TEE.DB	2	TEE-COM	DÉBENTURES	Placement privé	(101,520)	101.52	100,000			CAD		CA		06062001	F	5.25	R																					

Position négative
Si vous rappez une position négative, inscrie 'R' au champs #21.

P.S.: Si vous possédez une table de correspondance pour vos codes de fonds, de pays, d'industries, de devises, nous apprécierions en recevoir une copie. Ceci nous aiderait dans le processus du traitement de votre fichier. Un guide d'enquête est disponible sur demande.