

## CanDeal DNA FAQs

### 1. Qu'est-ce que CanDeal Données et Analytique (DNA)?

Avec CanDeal Marchés et CanDeal Solutions, CanDeal DNA fait partie du groupe CanDeal. CanDeal DNA est la principale plateforme de données sur les opérations hors cote et leur tarification au Canada, qui donne accès au plus important ensemble de données de haute qualité sur les opérations et les prix de courtiers.

### 2. Quels titres sont couverts par CanDeal DNA?

CanDeal Données et Analyse (DNA) fournit aux professionnels du secteur des données sur les prix indépendantes, précises et transparentes qui sont les meilleures de leur catégorie pour **plus de 70 000** titres à revenu fixe libellés en dollars canadiens. DNA présente des données de grande qualité sur la tarification provenant des courtiers pour aider les clients à mieux suivre, comprendre et gérer leur exposition au marché.

Obligations	Crédit	Titres adossés à des actifs
Obligations du Canada	Obligations de sociétés canadiennes	Blocs d'hypothèques LNH
Obligations provinciales	Financement de projets	Fiducie du Canada pour l'habitation
Obligations d'agences fédérales et provinciales	Acceptations bancaires	Titrisations
Obligations à rendement réel	Papier commercial	Papier commercial adossé à des actifs
Obligations municipales	Obligations feuille d'érable	Titres adossés à des hypothèques commerciales
Coupons détachés et bons connexes	Coupons détachés connexes	Titres adossés à des hypothèques résidentielles

- 3. Quels sont les courtiers canadiens qui fournissent des données à CanDeal?** Les six grands courtiers canadiens soumettent leurs cotations en cours de journée. Il s'agit de Marchés mondiaux CIBC (CIBC), Banque Nationale du Canada (Banque Nationale), Banque de Montréal (BMO), RBC Dominion valeurs mobilières Inc. (RBC) et La Banque Toronto-Dominion (TD). D'autres courtiers se joindront à eux plus tard cette année.
- 4. Quels types de données sont recueillies et traitées par CanDeal DNA?** Notre ensemble unique de données se compose de cotations, de rapports d'opérations et de données de référence :
- Les cotations présentent le cours acheteur et le cours vendeur pour les transactions d'ordre institutionnel et sont directement extraites du moteur de tarification principal utilisé par les négociateurs en salle des marchés des maisons de courtage.
  - Les rapports sur les opérations sont les rapports complets des transactions de chaque courtier participant par tous les circuits et avec tous les clients, y compris les parties reliées.
  - Les données de référence sont des informations tirées directement des prospectus et offres de souscription provenant des équipes de syndication du courtier, établies en référence à d'autres sources du secteur.
- 5. Quels produits propose CanDeal DNA?**
- Service d'établissement des prix de référence, prix composite en cours de journée et prix évalués pour l'univers des titres à revenu fixe canadiens
  - Plateforme de données pour les opérations hors cote appliquant les calculs de modélisabilité et l'analyse prédictive de la FRTB
  - Vérification indépendante des prix (VIP) hors composite pour les valorisations
- 6. Quels types de données se trouvent dans chaque dossier d'établissement des prix de référence?**
- Cours acheteur et vendeur, prix et rendement
  - Prix composite
  - Prix évalués
  - Informations sur le titre : ISIN, CUSIP, symbole, coupon, échéance
  - Analyse de la catégorie de négociation
- 7. Comment les prix de CanDeal DNA sont-ils fixés?** CanDeal DNA utilise les prix composites ainsi qu'un moteur d'établissement des prix par évaluation pour produire des prix en cours de journée qui reflètent les marchés canadiens. Les modèles d'établissement des prix sont conçus en collaboration avec les meilleurs négociateurs du Canada.
- 8. Quels contrôles de qualité sont appliqués pour produire les ensembles de données?** CanDeal DNA suit les directives de l'OICV en matière de gouvernance et de prix pour les données fournies et déploie une solution qualité applicable aux données basée sur des règles qui a pour but de vérifier que les données fournies sont précises, à jour et exemptes d'erreurs sémantiques telles que des cotations croisées, des marchés bloqués et des valeurs aberrantes. Une plateforme technologique infonuagique entièrement automatisée permet à la société d'acquérir et de traiter des centaines de milliers de cotations de titres par jour.
- 9. Qu'est-ce que l'analyse de la classification des opérations de négociation?** La classification des opérations de CanDeal DNA est notre outil de métadonnées exclusif qui mesure la force de notre processus de validation pour chaque titre d'après sa liquidité et les prix auxquels il est négocié.
- 10. Quand de nouvelles émissions sont-elles ajoutées aux ensembles de données?** Les nouvelles émissions sont versées dans les ensembles de données sortantes à mesure qu'elles sont ajoutées aux cotations entrantes par les courtiers participants, ce qui se produit habituellement à la date de l'émission quand les courtiers commencent à établir des prix et à acheter et vendre le titre.

**11. À quelle fréquence les prix de CanDeal DNA sont-ils mis à jour?**

Le service de tarification de référence présente les prix pour l'univers de couverture 3 fois par jour :

- 13 h 00 HE
- 15 h 00 HE
- 16 h 00 HE
- 17 h 00 HE – fin de journée – clôture des livres de banque

**12. Quelle est le mode de livraison des produits CanDeal DNA?**

Les dossiers de prix sont livrés par protocole de transfert de fichiers SFTP.

**13. Quel type de soutien est offert par CanDeal?**

L'équipe Exploitation des données de CanDeal traite les contestations de prix dans un délai d'une journée. Notre réponse type comprend un rapport complet sur les prix présentés, expose les effets de notre processus de préparation des données ainsi qu'un diagnostic sur notre processus de prix évaluées. Pour présenter une contestation de prix, les clients doivent préciser la date, l'heure, les informations relatives au titre ainsi que le prix DNA et le prix attendu dans un courriel envoyé à l'adresse DNASupport@CanDeal.com.