

Nasdaq Basic Canada



Table des matières

1.	Description de Nasdaq Basic Canada	2
2.	Options de protocole de réseau.....	3
3.	Architecture	3
4.	Types de données	3
5.	Messages sur les données du marché de Nasdaq Basic Canada	4
5.1	Message de cotation pour Nasdaq Basic Canada.....	4
5.2	Message de négociation pour Nasdaq Basic Canada	5
5.3	Message d'annulation de négociation.....	7
5.4	Message de correction de négociation.....	8
6.	Messages d'événements du système	9
7.	Message sur le répertoire des titres	10
8.	Message sur l'état du titre	11
9.	Version Control.....	12
10.	Renseignements sur la configuration IP	13
11.	Matrice de condition Dernière vente	14

1. Description de Nasdaq Basic Canada

Les caractéristiques techniques qui suivent sont constituées des exigences détaillées à l'égard de l'offre d'un nouveau produit par Nasdaq Canada : Nasdaq Basic Canada. Ce produit sur les données

de marché unique de Niveau 1 transmettra des renseignements sur les trois instruments de négociation de Nasdaq Canada : Nasdaq CXC, Nasdaq CX2 et Nasdaq CXD.

Les cotes fournies par Nasdaq Basic Canada évalueront le total de la liquidité disponible au sein de l'écart dans les deux registres transparents de Nasdaq Canada, Nasdaq CXC et Nasdaq CX2, dans un seul message de cotation. Nasdaq Basic Canada présentera toutes les opérations et les données pertinentes sur ces dernières depuis les instruments Nasdaq Canada CXC, Nasdaq Canada CX2 ainsi que Nasdaq Canada CXD.

2. Options de protocole de réseau

Nasdaq offrira les flux de données de Nasdaq Basic Canada à l'aide de MoldUDP64.

Pour un soutien réseau et des renseignements relatifs aux commandes, veuillez consulter la page « Nasdaq Direct Data Products Specifications » (caractéristiques techniques sur les produits de données de Nasdaq Direct) sur le site Web Business.Nasdaq.Com (en anglais seulement).

3. Architecture

Nasdaq Basic Canada sera composé d'une série de messages séquencés. La longueur de chaque message variera en fonction du type de message. Les messages qui composent le protocole de Nasdaq Basic Canada sont habituellement communiqués à l'aide d'un protocole de niveau plus élevé qui prend en charge le séquençement et les garanties de livraison.

4. Types de données

Tous les champs numériques sont des chiffres entiers codés sous forme binaire à extrémité large (ordre des octets du réseau) pour les champs d'une longueur de 4 chiffres et longs pour les champs de 8 chiffres. À moins d'indication contraire, ils ne sont pas signés.

Les cours sont des champs numériques, fournis avec une précision connexe. À moins d'une indication selon laquelle le cours est signé, les cours ne sont pas signés. Lorsqu'ils sont convertis en format décimal, les cours sont de format à virgule fixe, où la précision définit le nombre de décimales. Par exemple, un champ indiqué comme Cours (8) comporte un nombre implicite de 8 décimales.

L'horodateur indique l'heure du système Nasdaq à laquelle le message sortant a été généré par le moteur d'appariement. Nasdaq indique l'heure sous la forme du nombre de nanosecondes après minuit. Le fuseau horaire est l'heure de l'Est aux États-Unis.

Tous les champs alphanumériques sont des champs ASCII justifiés à gauche. Des espaces de remplissage figurent du côté droit au besoin.

Les horodateurs sont présentés sous forme de nanosecondes à compter de minuit

5. Messages sur les données du marché de Nasdaq Basic Canada

Ce qui suit présente tous les renseignements qu'un client devrait s'attendre à recevoir quotidiennement, et des directives pertinentes sur la façon d'utiliser ce contenu.

5.1 Message de cotation pour Nasdaq Basic Canada

Le message qui suit est utilisé pour transmettre le rapport de cotation de Nasdaq Basic Canada. Le MCAV de Nasdaq Canada diffusera une mise à jour en temps réel chaque fois que le meilleur cours acheteur et vendeur de la Bourse sera mis à jour pendant un jour de négociation. Le message de cotation de Nasdaq Basic Canada indique le volume sous la forme d'une valeur combinée, avec une attribution de volume au lieu sous-jacent de provenance de l'ordre ou des ordres

Message de cotation				
Nom	Décalage	Longueur	Type	Valeur/Description
Type de message	0	1	Alphanumérique	C = Rapport combiné sur les cotations
Horodatage	1	8	Numérique	Indique l'horodateur de l'instrument de négociation de Nasdaq Canada ayant généré le message de cotation.
Symbole boursier	9	10	Alphanumérique	Indique l'identifiant du titre de Nasdaq Canada à l'égard duquel le message de cotation du meilleur cours vendeur et acheteur de Nasdaq est généré.
Meilleur cours acheteur de Nasdaq Canada	19	8	Cours (8)	Indique le meilleur cours acheteur parmi tous les marchés de Nasdaq Canada - le cours le plus élevé de l'ordre ou des ordres d'achat sur le marché dans le ou les instrument(s) de négociation de Nasdaq Canada.
Volume au meilleur cours acheteur de Nasdaq Canada	27	4	Numérique	Indique le nombre total des actions disponibles pour l'affichage dans le ou les instrument(s) de négociation de Nasdaq Canada au meilleur cours acheteur
Volume au meilleur cours acheteur de Nasdaq CXC	31	4	Numérique	Indique le nombre total des actions disponibles pour l'affichage dans l'instrument de négociation de Nasdaq CXC au meilleur cours acheteur de Nasdaq Canada.
Volume au meilleur cours acheteur de Nasdaq CX2	35	4	Numérique	Indique le nombre total des actions disponibles pour l'affichage dans l'instrument de négociation de Nasdaq

				CX2 au meilleur cours acheteur de Nasdaq Canada.
Meilleur cours vendeur de Nasdaq Canada	39	8	Cours (8)	Indique le meilleur cours vendeur parmi tous les marchés de Nasdaq Canada - le cours le plus élevé de l'ordre ou des ordres d'achat sur le marché dans le ou les instrument(s) de négociation de Nasdaq Canada.
Volume au meilleur cours vendeur de Nasdaq Canada	47	4	Numérique	Indique le nombre total des actions disponibles pour l'affichage dans le ou les instrument(s) de négociation de Nasdaq Canada au meilleur cours vendeur
Volume au meilleur cours vendeur de Nasdaq CXC	51	4	Numérique	Indique le nombre total des actions disponibles pour l'affichage dans l'instrument de négociation de Nasdaq CXC au meilleur cours vendeur de Nasdaq Canada.
Volume au meilleur cours vendeur de Nasdaq CX2	55	4	Numérique	Indique le nombre total des actions disponibles pour l'affichage dans l'instrument de négociation de Nasdaq CX2 au meilleur cours vendeur de Nasdaq Canada.

5.2 Message de négociation pour Nasdaq Basic Canada

Le message qui suit est utilisé pour transmettre toutes les opérations disponibles depuis ou déclarées par les trois instruments de négociation de Nasdaq Canada pour le jour ouvrable en cours.

Message de rapport de négociation												
Nom	Décalage	Longueur	Type	Valeur/Description								
Type de message	0	1	Alphanumérique	T = Rapport de négociation								
Horodatage	1	8	Numérique	Indique l'horodateur de l'instrument de négociation de Nasdaq Canada ayant généré le message de négociation.								
Identifiant du marché d'origine	9	1	Alphanumérique	Indique l'instrument de négociation de Nasdaq Canada ayant généré le message de négociation. Les valeurs permises sont les suivantes : <table border="1" data-bbox="992 1598 1511 1852"> <thead> <tr> <th>Code</th> <th>Valeur</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>C</td> <td>L'instrument de négociation Nasdaq CXC</td> </tr> <tr> <td>X</td> <td>L'instrument de négociation Nasdaq CX2</td> </tr> <tr> <td>D</td> <td>L'instrument de négociation Nasdaq CXD</td> </tr> </tbody> </table>	Code	Valeur	C	L'instrument de négociation Nasdaq CXC	X	L'instrument de négociation Nasdaq CX2	D	L'instrument de négociation Nasdaq CXD
Code	Valeur											
C	L'instrument de négociation Nasdaq CXC											
X	L'instrument de négociation Nasdaq CX2											
D	L'instrument de négociation Nasdaq CXD											

Symbole boursier	10	10	Alphanumérique	Indique l'identifiant du titre de Nasdaq Canada à l'égard duquel le rapport de négociation est généré.														
Numéro de négociation	20	4	Numérique	Indique le numéro interne de la source associé à l'opération de négociation reçue. Veuillez prendre note que le numéro de négociation est propre à l'instrument de négociation source reflété dans le champ de l'identifiant du marché. Ce numéro est utilisé à titre de champ clé pour les annulations et les corrections de négociations.														
Cours de négociation	24	8	Cours (8)	Cours associé à l'opération de négociation déclarée.														
Volume de négociation	32	4	Numérique	Indique le nombre déclaré d'actions lié à l'opération de négociation.														
Courtier	36	3	Alphanumérique	Numéro de courtier numérique à trois chiffres de l'acheteur, ou 001 s'il est anonyme.														
Courtier de contrepartie	39	3	Alphanumérique	Numéro de courtier numérique à trois chiffres du vendeur, ou 001 s'il est anonyme.														
Modifiant de la condition de vente	42	4	Alphanumérique	Le modifiant de la condition de vente est composé de quatre niveaux, définis ci-après														
Modifiant de la condition de vente — Niveau 1	42	1	Alphanumérique	Utilisé pour les renseignements sur les caractéristiques de négociation <table border="1"> <thead> <tr> <th>Code</th> <th>Valeur</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td><vierge></td> <td>Négociation régulière</td> </tr> <tr> <td>B</td> <td>Contournement (applications seulement)</td> </tr> <tr> <td>L</td> <td>M-ELO</td> </tr> <tr> <td>P</td> <td>CXD Pure Stream</td> </tr> </tbody> </table>	Code	Valeur	<vierge>	Négociation régulière	B	Contournement (applications seulement)	L	M-ELO	P	CXD Pure Stream				
Code	Valeur																	
<vierge>	Négociation régulière																	
B	Contournement (applications seulement)																	
L	M-ELO																	
P	CXD Pure Stream																	
Modifiant de la condition de vente — Niveau 2	43	1	Alphanumérique	Utilisé pour les renseignements sur les types d'applications <table border="1"> <thead> <tr> <th>Code</th> <th>Valeur</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>I</td> <td>Internes</td> </tr> <tr> <td>B</td> <td>De base</td> </tr> <tr> <td>C</td> <td>Conditionnelles</td> </tr> <tr> <td>V</td> <td>CMPV</td> </tr> <tr> <td>X</td> <td>Intentionnelles</td> </tr> <tr> <td>D</td> <td>Liées à des instruments dérivés</td> </tr> </tbody> </table>	Code	Valeur	I	Internes	B	De base	C	Conditionnelles	V	CMPV	X	Intentionnelles	D	Liées à des instruments dérivés
Code	Valeur																	
I	Internes																	
B	De base																	
C	Conditionnelles																	
V	CMPV																	
X	Intentionnelles																	
D	Liées à des instruments dérivés																	
Modifiant de la condition de	44	1	Alphanumérique	Utilisé pour des renseignements sur les modalités de règlement <table border="1"> <thead> <tr> <th>Code</th> <th>Valeur</th> </tr> </thead> <tbody> </tbody> </table>	Code	Valeur												
Code	Valeur																	

vente — Niveau 3				T	Comptant aujourd'hui
				C	Comptant demain
				D	Livraison différée
Modifiant de la condition de vente — Niveau 4	45	1	Alphanumérique	Utilisé pour transmettre des renseignements sur l'admissibilité de lots réguliers	
				Code	Valeur
				A	Lot irrégulier
				B	Lot régulier ou plus grand

5.3 Message d'annulation de négociation

Si une négociation est annulée le même jour que son exécution, Nasdaq Basic Canada enverra un message d'annulation de négociation. Ce message indiquera le numéro de contrôle de négociation du message de négociation initial, et il incombe donc à l'utilisateur de ce contenu de gérer le contenu quotidien « Heures et Ventes » afin d'assurer que les données peuvent être gérées localement pour influencer sur toute modification des données du marché représentée par l'annulation de la négociation.

Message d'annulation de négociation					
Nom	Décalage	Longueur	Type	Valeur/Description	
Type de message	0	1	Alphanumérique	X = Annulation de négociation	
Horodatage	1	8	Numérique	Indique l'horodateur du système de Nasdaq Canada ayant généré le message d'annulation de négociation.	
Numéro de contrôle de négociation	9	4	Numérique	Indique le numéro de contrôle interne de la source associé à l'opération de négociation reçue. Veillez prendre note que le numéro de contrôle de négociation est propre au système source reflété dans le champ de l'identifiant du marché. Ce numéro est utilisé à titre de champ clé pour les annulations et les corrections de négociations.	
Identifiant du marché d'origine	13	1	Alphanumérique	Indique l'instrument de négociation de Nasdaq Canada ayant généré le message d'annulation de négociation. Les valeurs permises sont les suivantes :	
				Code	Value
				C	L'instrument de négociation Nasdaq CXC
				X	L'instrument de négociation Nasdaq CX2

				D	L'instrument de négociation Nasdaq CXD
--	--	--	--	---	---

5.4 Message de correction de négociation

Si une négociation est corrigée le même jour que son exécution, Nasdaq Basic Canada enverra un message de correction de négociation. Ce message indiquera le numéro de contrôle de négociation du message de négociation initial, et il incombe donc à l'utilisateur de ce contenu de gérer le contenu quotidien « Heures et Ventes » afin d'assurer que les données peuvent être gérées localement pour influencer sur toute modification des données du marché représentée par la correction de la négociation.

Message de correction de négociation					
Nom	Décalage	Longueur	Type	Valeur/Description	
Type de message	0	1	Alphanumérique	Z = Correction de négociation	
Horodatage	1	8	Numérique	Indique l'horodateur de l'instrument de négociation de Nasdaq Canada ayant généré la correction de négociation.	
Identifiant du marché d'origine	9	1	Alphanumérique	Indique l'instrument de négociation de Nasdaq Canada ayant généré le message de correction de négociation. Les valeurs permises sont les suivantes :	
				Code	Valeur
				C	L'instrument de négociation Nasdaq CXC
				X	L'instrument de négociation Nasdaq CX2
D	L'instrument de négociation Nasdaq CXD				
Symbole boursier	10	10	Alphanumérique	Indique le symbole boursier du titre de Nasdaq Canada à l'égard duquel le rapport de correction est généré.	
Original Trade Number	20	4	Numérique	Indique le numéro interne de la source associé à l'opération de négociation reçue. Veuillez prendre note que le numéro de négociation est propre à l'instrument de négociation source reflété dans le champ de l'identifiant du marché. Ce numéro est utilisé à titre de champ clé pour les annulations et les corrections de négociations.	
Cours de négociation initial	24	8	Cours (8)	Cours associé à l'opération de négociation initiale.	
Volume initial de négociation	32	4	Numérique	Indique le nombre déclaré d'actions lié à l'opération de négociation initiale	

Cours de négociation corrigé	36	8	Cours (8)	Cours associé à la correction de négociation déclarée.
Volume de négociation corrigé	44	4	Numérique	Indique le nombre déclaré d'actions lié à la correction de négociation.

6. Messages d'événements du système

Le type de message d'événement du système sera émis afin d'indiquer un événement d'état du marché.

Message d'événement du système					
Nom	Décalage	Longueur	Type	Valeur/Description	
Type de message	0	1	Alphanumérique	S = Message d'événement du système	
Horodatage	1	8	Numérique	Indique l'horodateur de l'instrument de négociation de Nasdaq Canada ayant généré le message d'événement du système.	
Identifiant du marché d'origine	9	1	Alphanumérique	Indique l'instrument de négociation de Nasdaq Canada ayant généré le message d'événement. Les valeurs permises sont les suivantes :	
				Code	Valeur
				C	L'instrument de négociation Nasdaq CXC
				X	L'instrument de négociation Nasdaq CX2
				D	L'instrument de négociation Nasdaq CXD
A	Tous les marchés (CXC, CX2, CXD)				
Code d'événement	10	1	Alphanumérique	Indique le code d'événement du système de marché de Nasdaq Canada. Les valeurs permises sont les suivantes :	
				Code	Valeur
				O	Premier message du jour
				S	Début de la séance de négociation de Nasdaq Canada
Q	Début de la séance de négociation du marché primaire				

				M	Fin de la séance de négociation du marché primaire Indique que les ordres à cours fixé ne peuvent plus être exécutés
				E	Fin de la séance de négociation de Nasdaq Canada
				C	Fin des messages Dernier message du jour
				W	Négociation interrompue pour cause de coupe-circuit à l'échelle du marché
				R	Reprise de négociation après un coupecircuit à l'échelle du marché

7. Message sur le répertoire des titres

Au début de chaque jour de négociation, Nasdaq diffuse des messages sur le répertoire des titres pour tous les symboles actifs du système d'exécution de Nasdaq. Veuillez noter que le nom d'affichage du titre est tronqué après 40 caractères

Message sur le répertoire des titres										
Nom	Décalage	Longueur	Type	Valeur/Description						
Type de message	0	1	Alphanumérique	R=Message sur le répertoire des titres						
Horodatage	1	8	Numérique	Indique l'horodateur de l'instrument de négociation de Nasdaq Canada ayant généré le message sur le répertoire des titres.						
Symbole boursier	9	10	Alphanumérique	Indique le symbole boursier du titre de Nasdaq Canada à l'égard duquel le message est généré.						
Nom d'affichage du titre	19	40	Alphanumérique	1*40 Imprimable ASCII; pas de valeur par défaut						
Marché d'inscription	59	1	Alphanumérique	Indique le marché d'inscription primaire du titre. Les valeurs permises sont les suivantes :* <table border="1" data-bbox="997 1749 1511 1892"> <tr> <th>Code</th> <th>Valeur</th> </tr> <tr> <td>T</td> <td>Marché principal du TMX (TSX)</td> </tr> <tr> <td>C</td> <td>Bourse des valeurs canadiennes</td> </tr> </table>	Code	Valeur	T	Marché principal du TMX (TSX)	C	Bourse des valeurs canadiennes
Code	Valeur									
T	Marché principal du TMX (TSX)									
C	Bourse des valeurs canadiennes									

				V	Bourse de croissance TMX
				N	La Bourse NEO
Volume du lot régulier	60	4	Alphanumérique	Indique le volume du lot régulier du symbole.	
Devise	64	1	Alphanumérique	Indique la devise du symbole	
				Code	Value
				U	\$ US
				C	\$ CA

8. Message sur l'état du titre

Ce message indique le statut de négociation actuel d'un titre. Au début de la journée, le fil enverra un message sur l'état du titre pour chacun des symboles négociés sur Nasdaq Canada. Par la suite, des messages sur l'état du titre seront envoyés lorsque la négociation d'un titre sera suspendue ou permise. Si la négociation d'un titre est suspendue dans un instrument de négociation, mais qu'elle demeure active dans un autre instrument de négociation, l'utilisateur continuera de recevoir des ordres sur Nasdaq Basic Canada, mais tous les ordres émaneront de l'instrument de négociation négociant activement le titre à ce moment. Si le message sur l'état du titre est envoyé avec l'indication de marché « A » et l'indication de l'état du système « H », cela signifie que la négociation est suspendue sur tous les instruments de négociation.

Remarque : En temps normal, la négociation de symboles est suspendue et reprise dans tous les instruments de négociation en utilisant la valeur de marché « A ».

Message sur l'état du titre					
Nom	Décalage	Longueur	Type	Valeur/Description	
Type de message	0	1	Alphanumérique	H=Message sur l'état du titre	
Horodatage	1	8	Numérique	Indique l'horodateur de l'instrument de négociation de Nasdaq Canada ayant généré le message sur l'état du titre.	
Symbole boursier	9	10	Alphanumérique	Indique le symbole du titre de Nasdaq Canada à l'égard duquel le message est généré.	
Marché	19	1	Alphanumérique	Indique l'instrument de négociation de Nasdaq Canada ayant généré le message. Les valeurs permises sont les suivantes :	
				Code	Valeur
				C	L'instrument de négociation Nasdaq CXC
				X	L'instrument de négociation Nasdaq CX2
				D	L'instrument de négociation Nasdaq CXD

				A	Tous les marchés (CXC, CX2, CXD)
État du système	20	1	Alphanumérique	Indique si l'état de négociation des instruments de négociation de Nasdaq Canada est actuellement en suspension. Les valeurs permises sont les suivantes :	
				Code	Valeur
				H	Suspension
				T	Négociation

9. Version Control

Date	Version	Commentaires
13 juin 2018	1.0	Caractéristiques techniques initiales
26 janvier 2023	1.4	Ajout de la valeur 'N' au champ Marché d'inscription du Message sur le répertoire des titres

10. Renseignements sur la configuration IP

Les tableaux qui suivent présentent un sommaire des adresses réseau et des paramètres de configuration nécessaires pour accéder aux services de données du marché multidiffusion de Nasdaq Basic Canada de la plateforme principale, de reprise après sinistre, de points de présence et de l'installation de test de Nasdaq.

Paramètres de configuration du réseau de Nasdaq Basic Canada				
Renseignements IP	Principale TR2 45 Parliament St, Toronto	DR CH4 350 E. Cermak Rd, Chicago	Markham POP 3500 Steeles Ave E, Markham	Plateforme INET de Nasdaq — Installation de test
Flux	Flux A	Stream C	Flux E	
Groupe Multidiffusion	233.128.23.121	233.187.20.23	233.128.23.75	233.128.33.68
Port Multidiffusion	18073	18073	18073	18073
Point de rendezvous (RP)	207.251.255.138	207.251.255.97	207.251.255.16	207.251.255.136
Source	206.200.1.224/28	206.200.95.0/25	206.200.58.240/29	206.200.59.240/28
MMRS	206.200.1.195	206.200.92.123	206.200.58.226	206.200.59.227
Port MMRS	18173	18173	18173	18173
Flux	Flux B	Flux D	Flux F	
Groupe Multidiffusion	233.128.23.122	233.211.120.23	233.128.23.79	
Port Multidiffusion	18073			
RP	207.251.255.139	207.251.255.98	207.251.255.17	
Source	206.200.1.240/28	206.200.95.128/25	206.200.58.248/29	
MMRS	206.200.1.211	206.200.92.126	206.200.58.234	
Port MMRS	18173	18173	18173	

11. Matrice de condition Dernière vente

Dans le secteur des données de marché, le terme « Dernière vente » est généralement utilisé pour désigner la dernière transaction de ronde ou de lot mixte déclarée par un centre de marché avec un code de condition de vente admissible pour la session ordinaire du marché canadien. Pour Nasdaq Canada, les entreprises doivent utiliser le champ d'horodatage du message du rapport sur les opérations pour déterminer l'ordre correct de la séquence des opérations pour le calcul de la dernière vente ainsi que l'affichage de l'heure et des ventes.

Pour faciliter le calcul de la « dernière vente », Nasdaq Canada inclut le modificateur de condition de vente. Le champ du modificateur de condition de vente est constitué de quatre niveaux. Une transaction ne doit être appliquée aux calculs du montant le plus haut, du montant le plus bas, de la dernière vente et du volume que si les quatre modificateurs des conditions de vente le permettent.

Condition de vente - Niveau 1 dénote le type d'attribut d'opération de la transaction

Code	Valeur	Haut/Bas	Dernière vente	Volume
<en blanc>	Ordinaire	O	O	O
B	Contournement	O	O	O
L	M-ELO	O	O	O

Condition de vente - Niveau 2 dénote le type de croisement de la transaction.

Code	Valeur	Haut/Bas	Dernière vente	Volume
<en blanc>	Ordinaire	O	O	O
I	Interne	O	O	O
B	Base	N	N	O
C	Contingent	O	O	O
V	VWAP	N	N	O
X	Croisement intentionnel	O	O	O
D	Relié aux dérivés	O	O	O

Condition de vente - Niveau 3 dénote les conditions de règlement de la transaction

Code	Valeur	Haut/Bas	Dernière vente	Volume
<en blanc>	Ordinaire	O	O	O
T	Espèces aujourd'hui	N	N	O
C	Espèces demain	N	N	O
D	Livraison retardée	N	N	O

Condition de vente - Niveau 4 dénote l'admissibilité de lot régulier de la transaction. n'est pas admissible comme valeur d'admissibilité de lot régulier.

Code	Valeur	Haut/Bas	Dernière vente	Volume
A	Lot irrégulier	N	N	O
B	Lot régulier ou supérieur	O	O	O