

SECRETARIAT DU CONSEIL DU TRÉSOR DU CANADA PRÉAVIS D'ADJUDICATION DE CONTRAT

Description du travail

Le groupe d'analyse financière du Secrétariat du Conseil du Trésor du Canada (SCT) fournit des données sur l'économie et sur les marchés financiers pour soutenir la mise au point des projections du SCT sur les marchés financiers et pour entreprendre l'établissement d'un modèle économique interne et une analyse des risques. Le groupe d'analyse financière doit avoir accès aux mêmes données économiques et financières sur les marchés et aux mêmes instruments analytiques que l'Office d'investissement des régimes de pensions du secteur public (OIRPSP) et d'autres gestionnaires des biens du secteur privé.

Le groupe d'analyse financière du SCT a besoin d'une application logicielle analytique permettant d'accéder à une base de données intégrée des marchés économiques et financiers et à un logiciel d'application. Le SCT utilisera cette application logicielle pour simplifier l'analyse des conjonctures économiques et des conjonctures du marché au Canada, aux États-Unis et dans le monde, et il fournira directement les données dans les modèles prévisionnels de l'analyse financière, ce qui permettra au secteur de faire appel et de conseiller l'OIRPSP, le bureau de l'actuaire en chef et d'autres partenaires, ainsi que de fournir au président du Conseil du Trésor les conseils nécessaires en matière de financement et de gestion des risques. La base de données et l'application logicielle du fournisseur doivent fournir des flux de données, des fonctionnalités cartographiques, des instruments analytiques et des intégrations basées sur Excel pour simplifier le travail proposé.

Le groupe d'analyse financière dispose actuellement d'un contractant, Macrobond, qui répond aisément à toutes ces exigences. Macrobond fournit toutes les données nécessaires pour enrichir nos modèles prévisionnels, tout en proposant des intégrations basées sur Excel.

Exigences

Le groupe d'analyse financière a besoin d'une base de données incorporée des marchés économiques et financiers et d'une application logicielle analytique.

La portée comprend :

Une série de données

- Le logiciel doit fournir des données actuelles et des données antérieures couvrant, au minimum, la balance des paiements, le prix des produits de base, la construction, la démographie, le marché des actions, les finances publiques, le marché du travail, le revenu fixe, la comptabilité nationale, le taux d'intérêt, le taux de change, la monnaie, la banque, le crédit, l'élaboration et les données sur le commerce. Les mises à jour des données doivent être traitées dans les 10 minutes suivant la publication des données officielles. La couverture des données doit être mondiale (Canada, États-Unis, Royaume-Uni, G7, G20, marchés émergents, etc.).

Complément d'Excel

- Le logiciel doit inclure des compléments capables de fournir des flux de données rapidement dans Excel sans besoin de programmation ciblée. Il doit également permettre aux utilisateurs de changer les propriétés des flux de données et de les renouveler directement à partir d'Excel.

Conversions des données

- Le logiciel doit comporter une fonction de conversion automatique des données, permettant de changer les données en fonction de la fréquence et de la monnaie sans avoir besoin de recourir à une programmation ciblée.
- Il doit comprendre un traitement des « valeurs manquantes » basé sur une forme de technique d'interpolation linéaire ou de fonction spline cubique.

Cartographie de données

- Le logiciel doit comporter des fonctionnalités cartographiques avancées semblables à celles disponibles dans Microsoft Excel.
- Il doit permettre le téléchargement direct de séries de données à partir de l'ordinateur de l'utilisateur.

Flux de distribution de tiers

- Le logiciel doit avoir la capacité d'intégrer et de distribuer des flux de données provenant d'autres fournisseurs indépendants, si le SCT en a la licence, y compris, mais sans s'y limiter, les flux de données du module amélioré de Microsat Systems Canada Inc (MSCI), ceux de l'indice des obligations de JPMorgan, ceux de l'indice des obligations de Merrill Lynch, ceux de Consensus Economics et ceux de Bloomberg.

Accords commerciaux et ententes sur les revendications territoriales globales

Cette exigence est soumise aux dispositions de l'Accord sur les marchés publics de l'Organisation mondiale du commerce (AMP-OMC), de l'Accord de libre-échange Canada-Corée, de l'Accord de libre-échange Canada-Chili, de l'Accord de libre-échange Canada-Pérou, de l'Accord de libre-échange Canada-Colombie, de l'Accord de libre-échange Canada-Panama, l'Accord de libre-échange Canada-Honduras, l'Accord de libre-échange Canada-Ukraine, l'Accord économique et commercial global (AECG) entre le Canada et l'Union européenne, l'Accord de partenariat transpacifique global et progressiste (PTPGP), l'Accord de continuité commerciale Canada-Royaume-Uni (ACC Canada-R.-U.) et l'Accord de libre-échange canadien (ALEC).

Justification

Le groupe d'analyse financière a besoin d'accéder aux mêmes données économiques et financières sur les marchés et aux mêmes instruments analytiques que l'OIRPSP et d'autres gestionnaires des biens du secteur privé. Le groupe d'analyse financière a établi que Macrobond était la seule source capable de lui fournir ces renseignements sur la base de la disponibilité des données, de leur livraison, de l'utilisabilité du système, des services analytiques, de la fonctionnalité des cartographies et des fonctions de soutien. Macrobond est le seul produit apte à répondre aux exigences de ce projet. Il est aussi le seul capable de fournir toutes les données nécessaires pour enrichir nos modèles prévisionnels, tout en offrant des intégrations ou des services analytiques basés sur Excel.

L'appel d'offres restreint pour cette exigence est conforme aux dispositions de l'article 6 du Règlement sur les marchés de l'État, lorsqu'une seule entreprise est en mesure d'exécuter le contrat, mais aussi à l'article 506, paragraphe 12, de l'ALEC, lorsqu'un seul fournisseur est en mesure de répondre aux exigences d'un marché public; il est aussi conforme à l'article 1016, alinéa 2(b) de l'Accord de libre-échange Canada-Corée, lorsque, pour des œuvres d'art, ou pour des raisons liées à la protection conférée par un brevet, des droits d'auteur ou d'autres droits exclusifs, ou des renseignements exclusifs, ou en cas d'absence de concurrence pour des raisons techniques, les biens ou les services ne peuvent être fournis que par un fournisseur précis et qu'il n'existe pas de solution de rechange ou de substitut raisonnable; et à l'article 1409, sous-alinéa 1(b)(ii) de l'Accord de libre-échange Canada-Colombie et de l'Accord de libre-échange Canada-Pérou, lorsque les produits ou les services ne peuvent être livrés que par un fournisseur précis et qu'il n'existe aucune solution de rechange qui soit raisonnable ou de produits

ou de services de remplacement pour l'une des raisons suivantes : la protection de brevets, les droits d'auteur ou d'autres droits exclusifs; et à l'alinéa XV.1(b) de l'Accord sur les marchés publics de l'Organisation mondiale du commerce (AMP-OMC) lorsque, pour les œuvres d'art ou lorsqu'il est question de la protection de droits exclusifs, tels que les brevets ou les droits d'auteur, ou en l'absence de concurrence pour des raisons techniques, les produits ou les services ne peuvent être fournis que par un fournisseur précis et qu'il n'y a aucune solution de rechange ou de remplacement possible.

Propriété intellectuelle

La propriété intellectuelle établie au cours du contrat est dévolue au contractant. En d'autres termes, la propriété de l'application et des données sera dévolue au contractant.

Durée du contrat

L'application logicielle analytique et la base de données intégrée des marchés économiques et financiers sont requises pour une période initiale de trois ans, avec deux périodes d'option supplémentaires d'un an.

Valeur estimée

La valeur estimée du contrat initial est de 193 101,82 \$ + la TVH de l'Ontario, 74 929,98 \$ supplémentaires + la TVH de l'Ontario pour l'année d'option 1 et 80 924,38 \$ supplémentaires + la TVH de l'Ontario pour l'année d'option 2.

Soumission de l'énoncé des capacités

Les fournisseurs qui s'estiment pleinement qualifiés et disponibles pour répondre aux exigences définies peuvent soumettre un énoncé des capacités par écrit à l'autorité contractante désignée dans le présent avis au plus tard à la date de clôture du présent avis. Cet énoncé doit clairement démontrer comment le fournisseur répond aux exigences annoncées.

Exigences minimales requises

Tout fournisseur intéressé doit démontrer, au moyen d'un énoncé de capacités, qu'il satisfait les exigences suivantes :

1. Le contractant doit démontrer que le logiciel et les compléments associés sont entièrement opérationnels dans un environnement Microsoft Office, avec tous les composants implantés, sans qu'aucun intergiciel ou service d'infrastructure supplémentaire ne soit nécessaire.

En outre, l'application logicielle et la fonctionnalité de fourniture de flux de données ne doivent pas nécessiter l'installation d'une base de données, et toutes les données chargées doivent pouvoir être sauvegardées et partagées sur un compte d'entreprise dans l'application logicielle, ce qui permet aux utilisateurs agréés du SCT d'accéder aux mêmes fichiers sauvegardés et d'y travailler.

2. Le contractant doit démontrer que le logiciel fournira des flux de données actuelles et des flux de données antérieurs concernant, au moins, les marchés canadiens, les marchés américains et les marchés internationaux, établis et émergents :

- Données de la balance des paiements
- Statistiques sur le domaine de compétence
- Données indiciaires sur les produits de base et l'énergie
- Données sur la construction et l'immobilier

- Données démographiques
- Données du groupe des systèmes de prévisions budgétaires
- Données des comptes financiers
- Prévisions
- Données relatives aux finances internationales
- Fonds
- Données sur le gouvernement et les finances publiques
- Données sur les revenus et les gains
- Données sur les taux d'intérêt et les taux de change
- Données sur le marché du travail
- Données sur la monnaie, les opérations bancaires et le crédit.
- Données sur la comptabilité nationale
- Prix
- Données de production
- Données de sondages et d'indicateurs avancés
- Données sur le commerce
- Données sur les transports et les communications
- Prix, rendement global, capitalisation boursière, bénéfice par action (BPA), taux de rendement des actions et données cours/bénéfice du S&P/TSX, du S&P 500 et du S&P 600.
- Prix des données de l'Indice mondial de Morgan Stanley Capital International (MSCI) (inclus) + (enrichi si licencié).
- Données sur les obligations de sociétés de J.P. Morgan :

3. Le contractant doit démontrer que le logiciel est facile à utiliser et à naviguer grâce à sa structure organisationnelle et à ses séquences de clics, et qu'il dispose d'une fonctionnalité de recherche précise et avancée pour aider les utilisateurs à trouver et à récupérer des flux de données. Il doit également s'intégrer facilement à Microsoft Excel et inclure un complément susceptible de fournir des flux de données dans Excel rapidement sans avoir besoin de programmation ciblée (mais il doit aussi toujours pouvoir être exécuté à l'aide de Visual Basic for Applications [VBA]). Le logiciel doit également permettre aux utilisateurs d'apporter des changements aux propriétés des flux de données et de les actualiser directement dans Excel, sans qu'il y ait de blocage, sans qu'Excel se fige, et qu'une fois la mise à jour effectuée, l'utilisateur n'ait pas besoin de se trouver dans l'application logicielle pour voir et exploiter les données chargées. Le complément Excel doit être facile à configurer pour la fourniture de données avec des flux de données qui sont mis à jour et traités dans les 10 minutes suivant leur publication officielle.

4. Le contractant doit démontrer que le logiciel comprend une fonctionnalité de conversion automatique des données, permettant de modifier les données en fonction de la périodicité et de la devise sans avoir besoin d'une programmation ciblée. Il doit également démontrer que le logiciel comprend un traitement des « valeurs manquantes » basé sur une forme de technique d'interpolation linéaire ou de fonction spline cubique.

5. Le contractant doit démontrer que le logiciel comprend des fonctionnalités cartographiques avancées supérieures à celles disponibles dans Microsoft Excel. Il doit également démontrer que le logiciel permet le téléversement direct de série de données depuis l'ordinateur de l'utilisateur.

6. Le contractant doit démontrer qu'il a conclu des accords de distribution avec des tiers et que le logiciel a la capacité d'intégrer et de distribuer des flux de données provenant de fournisseurs indépendants, si le SCT en a la licence, y compris, mais sans s'y limiter, les flux de données du module amélioré de MSCI, ceux de l'indice des obligations de JPMorgan, ceux de l'indice des obligations de Merrill Lynch, ceux de Consensus Economics et ceux de Bloomberg.

7. Le contractant doit démontrer qu'il dispose d'un personnel de soutien technique adéquat pour coopérer

avec les Services informatiques du SCT afin de résoudre les problèmes liés au système, le cas échéant, et de réduire le temps d'arrêt du SCT au minimum.

8 Le contractant doit démontrer qu'il dispose de systèmes de soutien au client réceptifs pour répondre aux questions du SCT, le cas échéant.

9. Le contractant doit démontrer que le logiciel proposé est performant et fiable, qu'on l'utilise depuis plus de cinq ans et qu'on l'a implanté et utilisé avec succès dans au moins cinq organisations mondiales d'au moins 1000 employés au cours des cinq dernières années.

10. Le contractant doit fournir un accès aux flux de données canadiens et aux flux de données américains suivants :

- Ventes d'automobiles
- Ventes au détail et ventes dans les magasins à succursales multiples
- Ventes au détail dans les commerces en ligne
- Inventaires au prix de détail
- Indicateurs du sentiment des consommateurs et de la confiance des consommateurs
- Ventes de logements existants et ventes de logements neufs
- Indicateurs du prix des logements neufs
- Indicateurs de l'abordabilité du logement
- Taux d'inoccupation
 - Appartements
 - Bureaux
 - Usines
- Vente de véhicules à moteur
- Rapport entre la valeur comptable et la valeur du marché et les commandes à expédier non remplies.
- Ratios stocks/chiffre d'affaires
- Stocks des entreprises
- Inventaires des ventes en gros
- Commandes de biens durables
- Commandes d'usine
- Permis de construire et mises en chantier
- Indice de la production industrielle et indice des prix des produits industriels
- Utilisation de la capacité
 - Écart de production (par exemple, filtre multivarié étendu)
 - Ratio d'utilisation (biens non agricoles)
 - Taux d'utilisation de la capacité (fabrication)
- Mesures de l'indice des directeurs d'achats du secteur de la fabrication
- Taux d'épargne des particuliers
- Dépenses fédérales et déficit
- Dette nationale et produit intérieur brut (PIB)
- Taux d'imposition fédéral
 - Particuliers
 - Entreprises
- Prix du cuivre
- Inventaires du London Metal Exchange
- Prix de l'or
- Réserves de pétrole et prix du pétrole
- Prix du gaz naturel
- Données du livre beige de la réserve fédérale

- Marges de craquage
- Résultats de l'enquête sur les perspectives des entreprises
- Indices de confiance des entreprises
- Mesures des conditions de crédit
 - Assouplissement et resserrement des conditions de crédit (enquêtes auprès de l'agent principal des prêts)
- Taux d'intérêt directeurs
 - Taux du financement à un jour
 - Taux des fonds fédéraux
- PIB et PIB par habitant
- Masse monétaire
 - Masse monétaire M1 et M2
- Indices des indicateurs avancés
- Nombre d'appareils de forage Baker–Hughes
- Bénéfices des entreprises
 - Marges nettes
 - Rendement du capital investi
- Courbes de rendement du Trésor
- Écart de taux (structure de risque des taux d'intérêt)
 - Fédéral–AAA
 - Fédéral–BBB
 - AAA–BBB
- Indice de confiance des investisseurs de State Street
- Taux de chômage
- Taux de participation
- Emploi à temps partiel et à temps plein
- Nombre de travailleurs qui sont découragés.
- Nombre de demandes de travailleurs sans emploi.
- Taux de fécondité
- Coût unitaire de main-d'œuvre
 - Salaires horaires moyens
 - Salaires réels
 - Paie agricole et non agricole
 - Revenu du travail du PIB
- Revenu personnel disponible
- Baltic Dry Index
- Commerce international
 - Commerce de marchandises
 - Commerce des services
 - Balance commerciale
 - Déficit ou excédent de la balance des opérations courantes
- Prix de l'importation et de l'exportation
- Compte capital et flux internationaux de capitaux du Trésor
- Commerce de gros
- Résultats de l'enquête de Tankan
- Indices des prix à la consommation
- Indices des prix à la production
- Déflateur du PIB
- Écart entre les bons du Trésor et les dépôts à terme en eurodollars.
- Indice de volatilité du Chicago Board Options Exchange (CBOE)

11. Le contractant doit démontrer que le logiciel contient des capacités analytiques avancées, permettant aux utilisateurs de faire ceci :

- Effectuer des tests statistiques;
- Effectuer des régressions linéaires et non linéaires, de même que des prévisions de séries temporelles standard.

Exigences en matière de sécurité

Aucune exigence de sécurité ne s'applique à cette exigence.

Nom et adresse du contractant envisagé

Macrobond Financial Inc.,
1450, Broadway, 30/F,
New York, NY 10018, É.-U

La date et l'heure de fin pour l'acceptation des énoncés des capacités sont les suivantes :

Le 7 novembre 2023 HNE à 14 h

Les demandes de renseignements et les énoncés des capacités doivent être envoyés par courrier électronique à l'adresse suivante :

Dawn Dormer, agent supérieur des contrats

Adresse courriel : Dawn.Dormer@tbs-sct.gc.ca

Secrétariat du Conseil du Trésor du Canada
90, rue Elgin,
Ottawa, ON, K1A 0R2
Numéro de téléphone : 343-542-8102