

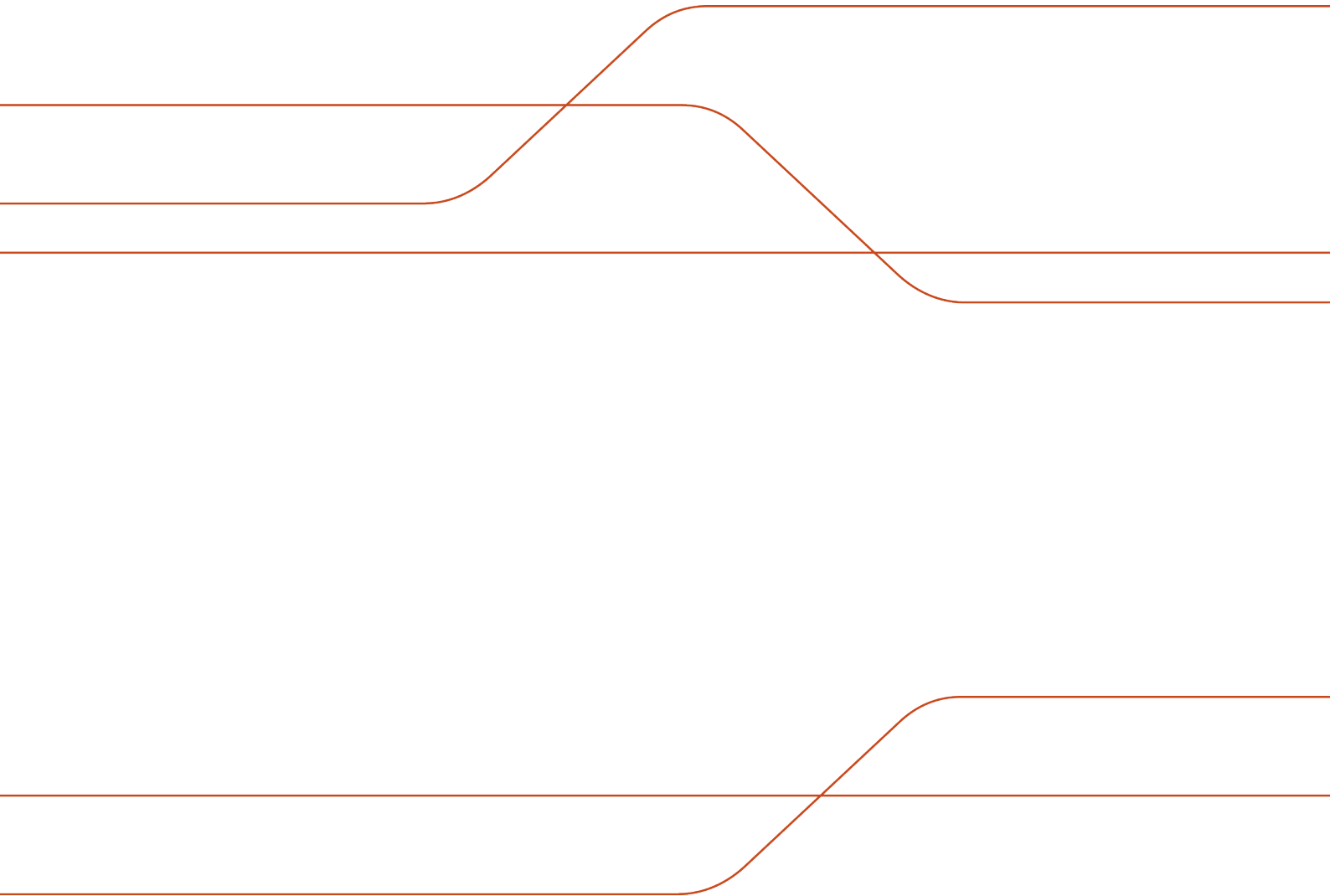


SIX Swiss Exchange AG

Weisung 2: Technische Anbindung

vom 08.06.2017

Datum des Inkrafttretens: 23.10.2017



Inhalt

1. Zweck und Grundlage	1
2. Allgemeines	1
3. Definitionen und Abkürzungen	1
4. Anbindungsarten für Handelsteilnehmer	1
4.1 Direkte Anbindung	1
4.2 ASP-Anbindung	2
4.2.1 Technisches Layout	2
4.2.2 ASP-Applikationen	2
5. Anbindung von Application Service Provider (ASP)	2
5.1 Technisches Layout	2
5.2 ASP-Applikationen	2
6. Schnittstellen	3
6.1 Handel	3
6.1.1 Standard Trading Interface (STI)	3
6.1.2 OUCH Trading Interface (OTI)	3
6.1.3 Quote Trading Interface (QTI)	3
6.2 Marktinformationen	3
6.2.1 Reference Data Interface (RDI)	3
6.2.2 Market Data Interface (MDI) und ITCH Market Data Interface (IMI)	3
6.2.3 SIX MDDX Multi-Dimensional Data fluX™ Interface (SIX MDDX)	3
7. Weitere Bestimmungen	4
7.1 Beauftragung Dritter	4
7.2 Personal	4
7.3 Auskunftsrecht	4

1. Zweck und Grundlage

Diese Weisung enthält Ausführungsbestimmungen zur technischen Anbindung an das Börsensystem und stützt sich auf Ziff. 3.4 und 4.7 Handelsreglement.

2. Allgemeines

¹ Für alle Anbindungsarten an die Handelsplattform SWXess (das "Börsensystem") der Börse wird vorausgesetzt, dass die Bestimmungen des Regelwerkes der Börse eingehalten werden und das Börsensystem durch die Anbindung des Teilnehmers nicht beeinträchtigt oder beschädigt wird.

² Es obliegt dem Teilnehmer bzw. Application Service Provider (ASP), sicherzustellen, dass sein Unternehmen zur Anbindung an das Börsensystem und zur Durchführung der geplanten Aktivitäten gemäss den anwendbaren Gesetzen und Vorschriften berechtigt ist. Dies gilt auch dann, wenn der Teilnehmer nicht direkt, sondern über die technischen Dienste eines ASP an das Börsensystem angeschlossen wird.

3. Definitionen und Abkürzungen

Anbindungsinfrastruktur	Infrastruktur der Teilnehmer und ASP, um sich an das Börsensystem für den Handel und Marktdatenbezug anzubinden.
ASP	Application Service Provider: der ASP stellt Teilnehmern und Marktdatenempfängern Applikationen für die technische Anbindung an das Börsensystem zur Verfügung.
Zugangsinfrastruktur	Infrastruktur der Börse, namentlich die Schnittstellen für den Handel und den Marktdatenbezug.

4. Anbindungsarten für Handelsteilnehmer

Teilnehmer können zwischen einer der nachfolgenden Anbindungsarten wählen.

4.1 Direkte Anbindung

¹ Die technische Anbindung des Teilnehmers an das Börsensystem erfolgt über eigene Applikationen.

² Die Börse kann auf Gesuch eines Teilnehmers die Nutzung der Anbindungsinfrastruktur eines vom Teilnehmer beauftragten und von der Börse anerkannten Dritten gestatten, wenn die Einhaltung der Bestimmungen des Regelwerkes der Börse auch durch den Dritten gewährleistet ist.

³ Die technische Anbindung von eigenen Applikationen und der Anbindungsinfrastruktur von Dritten liegt in der Verantwortung des Teilnehmers. Die Börse kann eine Abnahme oder Zertifizierung von eigenen Applikationen und der Anbindungsinfrastruktur von Dritten vornehmen respektive verlangen.

⁴ Falls die eigenen Applikationen oder die Anbindungsinfrastruktur oder Leitungen eines Dritten den Betrieb des Börsensystems gefährden, kann die Börse ihren Einsatz untersagen respektive suspendieren.

4.2 ASP-Anbindung

4.2.1 Technisches Layout

Die technische Anbindung des Teilnehmers an das Börsensystem mittels ASP-Anbindung erfolgt über die Applikation eines ASP. Der Teilnehmer tätigt seine Transaktionen über die vom ASP zur Verfügung gestellten Infrastruktur und Funktionalitäten.

4.2.2 ASP-Applikationen

¹ Der ASP sorgt auf eigene Verantwortung für die Auswahl geeigneter ASP-Applikationen, die es dem Teilnehmer ermöglichen, regelkonform auf das Börsensystem zuzugreifen. Die Börse übernimmt keine Gewähr für die Sicherheit, Verfügbarkeit und Performance dieser ASP-Applikationen.

² Installation, Betrieb und Wartung der ASP-Applikationen erfolgen durch den ASP auf dessen Kosten.

³ Falls die ASP-Applikationen den Betrieb des Börsensystems gefährden, beeinträchtigen oder beschädigen, kann die Börse ihren Einsatz suspendieren oder verbieten.

5. Anbindung von Application Service Provider (ASP)

5.1 Technisches Layout

¹ Die technische Anbindung eines ASP an das Börsensystem erfolgt über eigene Applikationen des ASP.

² Die Börse kann auf Gesuch eines ASP die Nutzung der Anbindungsinfrastruktur eines vom ASP beauftragten und von der Börse anerkannten Dritten gestatten, wenn die Einhaltung der Bestimmungen des Regelwerks der Börse auch durch den Dritten gewährleistet ist.

³ Die technische Anbindung von ASP-Applikationen und der Anbindungsinfrastruktur von Dritten liegt in der Verantwortung des ASP. Die Börse kann eine Abnahme oder Zertifizierung von ASP-Applikationen und der Anbindungsinfrastruktur von Dritten vornehmen respektive verlangen.

⁴ Falls die ASP-Applikationen oder die Anbindungsinfrastruktur oder Leitungen eines Dritten den Betrieb des Börsensystems gefährden, beeinträchtigen oder beschädigen, kann die Börse ihren Einsatz suspendieren oder verbieten.

⁵ Der ASP ist nicht berechtigt, an der Börse zu handeln.

5.2 ASP-Applikationen

¹ Der ASP sorgt auf eigene Verantwortung für die Auswahl geeigneter ASP-Applikationen, die es dem Teilnehmer ermöglichen, regelkonform auf das Börsensystem zuzugreifen. Die Börse übernimmt keine Gewähr für die Sicherheit, Verfügbarkeit und Performance dieser ASP-Applikationen.

² Installation, Betrieb und Wartung der ASP-Applikationen erfolgen durch den ASP auf dessen Kosten.

³ Falls die ASP-Applikationen den Betrieb des Börsensystems gefährden, beeinträchtigen oder beschädigen, kann die Börse ihren Einsatz suspendieren oder verbieten.

6. Schnittstellen

6.1 Handel

Für die Anbindung zum Handel stehen dem Teilnehmer mehrere Schnittstellen gemäss dieser Ziffer zur Verfügung. Der Teilnehmer wählt die für ihn am besten geeignete Schnittstelle und anerkennt, dass nicht alle Schnittstellen über die gleichen Funktionalitäten verfügen. Für die korrekte Auswahl der Schnittstelle ist der Teilnehmer selber verantwortlich.

6.1.1 Standard Trading Interface (STI)

Das Standard Trading Interface (STI) ermöglicht den Teilnehmern den Zugang zum Auftragsbuch sowie zum Handel ohne Vorhandelstransparenz und zu den Meldedefunktionalitäten. Es unterstützt die Eingabe von Aufträgen und Abschlussmeldungen und empfängt die Ausführungsbestätigungen für die Weiterverarbeitung.

6.1.2 OUCH Trading Interface (OTI)

Das OUCH Trading Interface (OTI) ermöglicht den Teilnehmern und Liquiditätsgebern den direkten Zugang zum Auftragsbuch. Es unterstützt die Eingabe von Aufträgen und empfängt die Ausführungsbestätigungen für die Weiterverarbeitung.

6.1.3 Quote Trading Interface (QTI)

Das Quote Trading Interface (QTI) ermöglicht den Market Makern und Liquiditätsgebern den direkten Zugang zum Auftragsbuch. Es unterstützt die Eingabe von Quotes und empfängt die Ausführungsbestätigungen für die Weiterverarbeitung.

6.2 Marktinformationen

6.2.1 Reference Data Interface (RDI)

¹ Das Reference Data Interface (RDI) ermöglicht Teilnehmern, ASP und Marktdatenempfängern den Bezug von Referenzdaten.

² Für die Nutzung und Weitergabe von Referenzdaten muss zusätzlich eine entsprechende Vereinbarung (Data Distribution Agreement) mit SIX Exfeed AG abgeschlossen werden. Einzelheiten regelt die Weisung «Marktinformationen».

6.2.2 Market Data Interface (MDI) und ITCH Market Data Interface (IMI)

¹ Das Market Data Interface (MDI) und das ITCH Market Data Interface (IMI) ermöglichen Teilnehmern, ASP und Marktdatenempfängern den Bezug von Echtzeitmarktinformationen.

² Für die Nutzung und Weitergabe von Marktinformationen muss eine entsprechende Vereinbarung (Data Distribution Agreement) mit SIX Exfeed AG abgeschlossen werden. Einzelheiten regelt die Weisung «Marktinformationen».

6.2.3 SIX MDDX Multi-Dimensional Data fluX™ Interface (SIX MDDX)

¹ Das SIX MDDX Multi-Dimensional Data fluX™ Interface (SIX MDDX) ermöglicht Teilnehmern und Marktdatenempfängern den Bezug von Echtzeitmarktinformationen.

² Für die Nutzung und Weitergabe von Marktinformationen muss zusätzlich eine entsprechende Vereinbarung (Data Distribution Agreement) mit SIX Exfeed AG abgeschlossen werden. Einzelheiten regelt die Weisung «Marktinformationen».

7. Weitere Bestimmungen

7.1 Beauftragung Dritter

Beauftragt die Börse Dritte mit der Ausführung der ihr übertragenen Aufgaben, beschränkt sich ihre Haftung auf die sorgfältige Auswahl und Instruktion der von ihr beauftragten Dritten.

7.2 Personal

Jeder Teilnehmer und ASP ist verpflichtet, qualifiziertes Personal in ausreichender Anzahl jederzeit während den Börsenzeiten sowie bei Wartungs- und Weiterentwicklungsarbeiten auch ausserhalb der Handelszeiten bereitzuhalten und eine telefonische Erreichbarkeit sicherzustellen, um den ordnungsgemässen Betrieb zu gewährleisten und um insbesondere im Fall von technischen Störungen nach Anweisung der Börse entsprechende Massnahmen ergreifen zu können.

7.3 Auskunftsrecht

Die Börse kann von Teilnehmern bzw. ASP jederzeit Auskünfte und die Vorlage von Unterlagen verlangen, soweit sie im Zusammenhang mit der Anbindung an das Börsensystem bzw. zur Verhinderung oder Beseitigung technischer Störungen erforderlich sind.

Beschluss des Ausschusses für Teilnehmerregulierung (Participants & Surveillance Committee) des Regulatory Board vom 8. Juni 2017; in Kraft seit 23. Oktober 2017.