

Weisung 4 – SIX Swiss Exchange

Attribute für Aufträge, Quotes und Meldungen

Version:

01.07.2008

Datum des Inkrafttretens:

16.02.2009

INHALTSVERZEICHNIS

1.	Börslicher Handel	1
1.1	Attribute für Aufträge	1
1.2	Attribute für Quotes	2
2.	Ausserbörslicher Handel	3

1. BÖRSLICHER HANDEL

1.1 Attribute für Aufträge

Aufträge müssen mit folgenden Attributen eingegeben werden. Fehlt ein obligatorisches Attribut, wird der Auftrag vom Börsensystem zurückgewiesen.

Attribut	Normaler Auftrag	Akzeptauftrag	Fill-or-Kill-Auftrag
Kauf/Verkauf	obligatorisch	obligatorisch	obligatorisch
Security	obligatorisch	obligatorisch	obligatorisch
Auftragsgrösse	obligatorisch	obligatorisch	obligatorisch
Preis/Limite	obligatorisch: Limite oder bestens	obligatorisch: Limite oder bestens	obligatorisch: Limite oder bes- tens
Gültigkeitsdauer	obligatorisch ¹	nicht anwendbar	nicht anwendbar
Trading Capacity Indikator	obligatorisch	obligatorisch	obligatorisch
Teilnehmerinterne Referenz	freiwillig	freiwillig	freiwillig

¹ Einzelheiten sind in SIX Swiss Exchange Guides geregelt.

1.2 Attribute für Quotes

Quotes im Handel an der SIX Swiss Exchange AG ("SIX Swiss Exchange") müssen mit den folgenden Attributen eingegeben werden. Fehlt ein obligatorisches Attribut, wird der Quote vom Börsensystem zurückgewiesen.

Attribut	
Security	obligatorisch
Kaufauftrag, bestehend sowohl aus einem Preis ² als auch einer Menge ³	freiwillig – pro Quote ist höchstens ein Kaufauftrag zulässig
Verkaufauftrag, bestehend sowohl aus einem Preis ² als auch einer Menge ³	freiwillig – pro Quote ist höchstens ein Verkaufauftrag zulässig
Teilnehmerinterne Referenz	freiwillig

Jeder neue Quote für eine Effekte ersetzt beide Seiten des bestehenden relevanten Quote in dieser Effekte.

Fehlt sowohl das Attribut Kaufauftrag als auch das Attribut Verkaufauftrag, hat dies die Löschung aller bestehenden Quotes in dieser Effekte zur Folge.

² Der Preis muss den festgelegten Kursabstufungen für die jeweilige Effekte entsprechen.

³ Die Menge muss einem Vielfachen der kleinsten handelbaren Einheit für die jeweilige Effekte entsprechen.

2. AUSSERBÖRSLICHER HANDEL

Meldungen von Abschlüssen die ausserbörslich getätigt werden müssen mit folgenden Attributen eingegeben werden:

Attribut	Abschluss- bestätigung (inkl. nachgemeldete Abschlüsse)	Abschlussmeldung
Kauf/Verkauf	obligatorisch	obligatorisch
Security Identification	obligatorisch	obligatorisch
Auftragsgrösse	obligatorisch	obligatorisch
Preis	obligatorisch	obligatorisch
Angaben über Gegenpartei	obligatorisch	obligatorisch Angabe ob Kunde, anderer Effektenhändler oder anderer Teilnehmer
Gültigkeitsdauer	nicht anwendbar	nicht anwendbar
Absender	nicht anwendbar	nicht anwendbar
Abschlussdatum	obligatorisch	obligatorisch
Abschlusszeit	obligatorisch	obligatorisch
Abwicklungs- datum	obligatorisch Default: T + 3	obligatorisch Default: T + 3
Angaben über manuelles Clearing	obligatorisch	nicht anwendbar
Trade Reversal Flag	obligatorisch	obligatorisch
Statement of Interest ID	nicht anwendbar	nicht anwendbar
Trading Capacity Indikator	obligatorisch	obligatorisch
Bankinterne Referenz	freiwillig	freiwillig
Trade Type Codes	freiwillig ⁴	freiwillig
Berücksichtigter Settle- mentbetrag und -währung	freiwillig	nicht anwendbar

Beschluss der Geschäftsleitung vom 1. Juli 2008; in Kraft seit 16.
Februar 2009.

⁴ Die SIX Swiss Exchange behält sich das Recht vor, bei bestimmten Transaktionen die Verwendung von Trade Type Codes zu verlangen: die Verwendung von Trade Type Codes wird von der SIX Swiss Exchange in SIX Swiss Exchange Guides veröffentlicht.