



Weisung 2: Technische Anbindung

SDX Trading AG

vom 18. Juni 2021

Datum des Inkrafttretens: 15. Oktober 2021

Inhaltsverzeichnis

1	Zweck und Grundlage	3
2	Allgemeines	3
3	Definitionen und Abkürzungen	3
4	Direkte Anbindung für Handelsteilnehmer	3
5	Schnittstellen	3
5.1	Handel.....	3
5.1.1	FIX Trading Interface (FTI).....	4
5.1.2	OUCH Trading Interface (OTI)	4
5.1.3	Quote Trading Interface (QTI)	4
5.2	Marktinformationen	4
5.2.1	Reference Data Interface (RDI).....	4
5.2.2	ITCH Market Data Interface (IMI)	4
5.2.3	SIX MDDX Multi-Dimensional Data fluX™ Interface (SIX MDDX)	4
6	Weitere Bestimmungen	5
6.1	Beauftragung Dritter	5
6.2	Personal.....	5
6.3	Auskunftsrecht	5

1 Zweck und Grundlage

Diese Weisung enthält Ausführungsbestimmungen zur technischen Anbindung an das Börsensystem und stützt sich auf Ziff. 3.4 und 4.6 Handelsreglement.

2 Allgemeines

¹ Für alle Anbindungsarten an die Handelsplattform (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 sicherzustellen, dass sein Unternehmen zur Anbindung an das Börsensystem und zur Durchführung der geplanten Aktivitäten gemäss den anwendbaren Gesetzen und Vorschriften berechtigt ist.

3 Definitionen und Abkürzungen

Anbindungsinfrastruktur	Infrastruktur der Teilnehmer, um sich an das Börsensystem für den Handel und Marktdatenbezug anzubinden.
Zugangsinfrastruktur	Infrastruktur der Börse, namentlich die Schnittstellen für den Handel und den Marktdatenbezug.

4 Direkte Anbindung für Handelsteilnehmer

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. Dies umfasst insbesondere auch die zwingende Teilnahme an der von der Börse anerkannten Settlement-Organisation SIX Digital Exchange AG.

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.

5 Schnittstellen

5.1 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.

5.1.1 FIX Trading Interface (FTI)

Das FIX Trading Interface (FTI) ermöglicht den Teilnehmern den Zugang zum Handel. Es unterstützt die Eingabe von Aufträgen und empfängt die Ausführungsbestätigungen für die Weiterverarbeitung.

5.1.2 OUCH Trading Interface (OTI)

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

5.1.3 Quote Trading Interface (QTI)

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

5.2 Marktinformationen

5.2.1 Reference Data Interface (RDI)

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

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

³ Einzelheiten regelt die Weisung «Marktinformationen».

5.2.2 ITCH Market Data Interface (IMI)

¹ Das ITCH Market Data Interface (IMI) ermöglicht den Teilnehmern und Marktdatenempfängern den Bezug von Marktinformationen in Echtzeit.

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

³ Einzelheiten regelt die Weisung «Marktinformationen».

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

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

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

³ Einzelheiten regelt die Weisung «Marktinformationen».

6 Weitere Bestimmungen

6.1 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.

6.2 Personal

Jeder Teilnehmer 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.

6.3 Auskunftsrecht

Die Börse kann von Teilnehmern 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.

Diese Weisung wurde am 18. Juni 2021 vom Ausschuss für Teilnehmerregulierung (Participants & Surveillance Committee) des Regulatory Board beschlossen und tritt am 15. Oktober 2021 in Kraft.