

SIX Swiss Exchange Mitteilung Nr. 53/2013

Titel SWXess Maintenance Release 4 (SMR4) – Regularien und Migration
Kategorie SWXess Handelsplattform & Regularien
Autorisiert von Christoph Landis, Head Operations
 Rolf Broekhuizen, Head Business Engineering
Seiten 4
Datum 07.10.2013

Information 

Inhalt dieser Mitteilung:

- SMR4
 - Aktualisierte Weisungen SIX Swiss Exchange und Scoach Schweiz
 - Übersicht der Weisungsanpassungen
 - Prozess für Migration von CTI auf OTI/QTI
 - Prozess für produktive Aufschaltung der neuen Benutzer für OTI, IMI und GLIMPSE
 - Bestätigung der Einführung am 4. November 2013
- Emissionsgebühr

SWXess Maintenance Release 4 (SMR4)

In der [SIX Swiss Exchange Mitteilung Nr. 47/2013](#) kündigte SIX Swiss Exchange die Einführung des SWXess Maintenance Release 4 (SMR4) im November 2013 an und lieferte nähere Informationen zu den Änderungen in Bezug auf geschäftliche Transaktionen und neue Funktionalitäten in SMR4.

Die vorliegende Mitteilung informiert die Teilnehmer über die Veröffentlichung der relevanten Weisungsanpassungen für SMR4 und liefert detaillierte Informationen zur Migration von CTI auf OTI und QTI.

Regularien

Die nachfolgenden Weisungen wurden aufgrund von SMR4 geändert und sind ab sofort auf den Internetseiten von [SIX Swiss Exchange](#) und [Scoach Schweiz](#) abrufbar:

- Weisungen
 - Weisung 2: Technische Anbindung
 - Weisung 7: Gebühren und Kosten

Folgende funktionalen Änderungen haben zu Anpassungen in den Regularien geführt:

- Einführung OUCH Trading Interface (OTI) für OBM – Partition 2 «Non-Equity»
- Einführung ITCH Market Data Interface (IMI) für OBM – Partition 2 «Non-Equity»
- Einführung Quote Trading Interface (QTI) für OBM – Partition 2 «Non-Equity»

Die nachfolgende Tabelle enthält eine detaillierte Übersicht der Anpassungen:

Weisung	Art der Änderung	Referenz SIX Swiss Exchange	Referenz Scoach Schweiz	Titel
Weisung 2: Technische Anbindung	Geändert	Ziff. 6.1.1	Ziff. 6.1.1	Standard Trading Interface (STI)
	Geändert	Ziff. 6.1.3	Ziff. 6.1.3	OUCH Trading Interface (OTI)
	Neu	Ziff. 6.1.4	Ziff. 6.1.4	Quote Trading Interface (QTI)
	Geändert	Ziff. 6.2.2 Abs. 1	Ziff. 6.2.2 Abs. 1	Market Data Interface (MDI) und ITCH Market Data Interface (IMI)

Weisung	Art der Änderung	Referenz SIX Swiss Exchange	Referenz Scoach Schweiz	Titel
Weisung 7: Gebühren und Kosten	Geändert	Ziff. 1.2	-	Gebührenübersicht
	Geändert	Ziff. 2	Ziff. 2	Begriffe
	Geändert	Ziff. 6 Abs. 4	-	Emissionsgebühr
	Geändert	Ziff. 9.2	-	FTPS-Kapazitätsgebühr
	Neu	Ziff. 9.3	-	OTPS-Kapazitätsgebühr
	Geändert	Anhang K, Ziff. 1		Direktanbindung via Managed/ Leased Line
	Geändert	Anhang K, Ziff. 6.1	-	Standard Trading Interface (STI)
	Geändert	Anhang K, Ziff. 6.2	-	Standard Trading Interface für Aktienmärkte (STI-Equity)
	Neu	Anhang K, Ziff. 6.4	-	OUCH Trading Interface (OTI)
	Neu	Anhang K, Ziff. 6.5	-	Quote Trading Interface (QTI)

Eine Auflistung der Revisionen der Weisungen von SIX Swiss Exchange mit Angaben über inhaltliche Änderungen, betroffene Ziffern und Termine der Inkraftsetzung finden sie unter folgendem Link:

http://www.six-swiss-exchange.com/participants/regulation/revisions/rule_book_de.html

Die Trading Guides wurden im Zusammenhang mit der Einführung von SMR4 ebenfalls überarbeitet und sind ab sofort unter folgendem Link verfügbar:

http://www.six-swiss-exchange.com/participants/regulation/trading_guides_de.html

Migration

Die Einführung von SMR4 erfordert bei den betroffenen Teilnehmern die Migration und Aufschaltung von neuen Benutzern. Die nachfolgende Tabelle bietet den Teilnehmern eine Übersicht über die notwendigen Massnahmen:

Teilnehmer	Massnahme	Szenario	Referenz
Teilnehmer verwendet heute CTI für Market Making	Migration auf QTI	Gleichzeitige Benutzung von CTI und QTI in der Produktions-Umgebung nicht möglich. QTI Benutzer werden nach Bestätigung des Teilnehmers für die Umstellung in der Produktions-Umgebung aufgeschaltet. 5 Arbeitstage nach der Umstellung werden die CTI User gelöscht.	Abschnitt 1.1.
Teilnehmer verwendet heute CTI für Proprietary Trading	Migration auf OTI	Gleichzeitige Benutzung von CTI und OTI in der Produktions-Umgebung wird unterstützt. OTI Benutzer werden per erstem Handelstag von SMR4 für die Produktions-Umgebung aufgeschaltet CTI Benutzer werden nach Bestätigung des Teilnehmers gelöscht.	Abschnitt 1.2.
Teilnehmer möchte die neuen OTI, IMI und GLIMPSE Schnittstellen verwenden	Aufschaltung neue Benutzer	Neue Benutzer werden per erstem Handelstag von SMR4 für die Produktions-Umgebung aufgeschaltet.	Abschnitt 2.

1. Migration von CTI auf die neuen Schnittstellen OTI und QTI

Gemäss Ankündigung wird das «Capacity Trading Interface» (CTI) für Eigenhandel im Aktienmarkt und Market Making auf OBM Partition 2 «Nicht-Aktien» sechs Monate nach der Einführung von SMR4 ausser Betrieb genommen. Alle Teilnehmer, die heute CTI nutzen, sind gebeten bis zur Ausserbetriebnahme des CTI im Mai 2014 für Eigenhandel auf das OUCH Trading Interface (OTI) und für Market Making auf das Quote Trading Interface (QTI) zu migrieren.

1.1. Umstellung CTI auf QTI für Market Making

Die Teilnehmer können den Zeitpunkt der produktiven Umstellung von CTI auf die neue QTI Schnittstelle selbst festlegen. Wir bitten die betroffenen Teilnehmer für die Umstellung auf die neue Schnittstelle das Formular «[Migration CTI to New Interfaces](#)» zu unterzeichnen und drei Arbeitstage vor dem geplanten produktiven Umstellungsdatum bei Member Services (member.services@six-group.com) einzureichen.

Wir bitten die Teilnehmer zu beachten, dass sie in der Produktions-Umgebung nicht gleichzeitig CTI **und** das neue Interface QTI für Market Making parallel verwenden können. Member Services wird daher die QTI Benutzer auf das gewünschte Umstellungsdatum für die Produktions-Umgebung aufsetzen und aktivieren sowie gleichzeitig die bestehenden CTI Benutzer suspendieren. Sollten die Teilnehmer beim Market Making über die neue Schnittstelle QTI in der Produktions-Umgebung technische Probleme verzeichnen, ist eine Umstellung zurück auf CTI im Tagesverlauf jederzeit möglich; hierfür kontaktieren Sie bitte Member Services telefonisch unter +41 58 399 2473.

Fünf Arbeitstage nach der erfolgreichen Migration von CTI auf die neue Schnittstelle QTI und ohne Ihren Gegenbericht wird Member Services die alten CTI Benutzer löschen.

1.2. Umstellung CTI auf OTI für Proprietary Trading

Teilnehmer können in der Produktions-Umgebung während der Übergangsphase gleichzeitig CTI und OTI für Proprietary Trading auf OBM Partition 1 - «Aktien» verwenden.

Member Services wird die neu beantragten OTI Benutzer für die Produktions-Umgebung per erstem Handelstag von SMR4 für die Produktions-Umgebung aufsetzen. Wir bitten die betroffenen Teilnehmer, nach der erfolgreichen Migration von CTI für Proprietary Trading auf die Schnittstelle OTI mittels Formular «[Migration CTI to New Interfaces](#)» die Löschung der alten CTI Benutzer zu bestätigen.

Teilnehmer, die bisher lediglich für die Membertest-Umgebung die Einrichtung neuer OTI Benutzer in Auftrag gegeben haben, bitten wir mittels Formular «[Application SWXess User](#)» die Aufschaltung der neuen OTI Benutzer für OBM Partition 1 - «Aktien» für die produktive Umgebung bei Member Services (member.services@six-group.com) zu beauftragen.

2. Aufschaltung der neuen Benutzer für OTI, IMI und GLIMPSE für die Produktions-Umgebung

Mit SMR4 werden die nachfolgenden neuen optionalen Schnittstellen angeboten:

- OUCH Trading Interface (OTI) für OBM Partition 2 – «Nicht-Aktien»
- ITCH Market Data Interface (IMI) für OBM Partition 2 – «Nicht-Aktien»
- Snapshot Service «GLIMPSE» via ITCH Market Data Interface (IMI) für beide OBM Partitionen 1 und 2

Für den Handel via OTI sowie den Bezug von Marktdaten via IMI und die Nutzung von GLIMPSE auf beiden OBM Partitionen ist es notwendig, entsprechende Benutzer anzulegen. Bitte verwenden Sie hierfür das Formular «[Application SWXess User](#)».

Teilnehmer, die bereits neue Benutzer für beide Umgebungen (Membertest und Produktion) beantragt haben, brauchen für deren produktive Nutzung nichts weiter zu unternehmen. Member Services wird die neuen OTI, IMI und GLIMPSE Benutzer per erstem Handelstag von SMR4 für die Produktions-Umgebung aufsetzen.

Teilnehmer, die bisher lediglich für die Membertest-Umgebung die Einrichtung neuer Benutzer in Auftrag gegeben haben, bitten wir mittels Formular «[Application SWXess User](#)» die Aufschaltung der neuen OTI, IMI und GLIMPSE Benutzer für die produktive Umgebung bei Member Services (member.services@six-group.com) zu beauftragen.

Einführung

SIX Swiss Exchange plant die Einführung von SMR4 wie folgt:

Datum	Umgebung
4. November 2013	Erster Handelstag mit SMR4 in der Produktions -Umgebung

Bitte beachten Sie, dass SIX Swiss Exchange den 25. November 2013 als Ausweichtermin für die produktive Einführung von SMR4 vorgesehen hat.

Bis zur produktiven Einführung von SMR4 haben Teilnehmer weiterhin die Möglichkeit, die funktionalen und technischen Veränderungen in der Membertest-Umgebung zu testen. Sollten Sie Unterstützung beim Testen benötigen, können Sie sich gerne an Member Services wenden.

Weitere Informationen zu SMR4 finden Sie in der [SIX Swiss Exchange Mitteilung Nr. 47/2013](#) sowie in den [Release Notes](#) auf der [Member Section](#) von SIX Swiss Exchange.

Emissionsgebühr

Zusätzlich zu den im Zusammenhang mit SMR4 einhergehenden Änderungen wird bei der Emissionsgebühr neu ein Maximalbetrag eingeführt (Ziff. 6 Abs. 4 der Weisung 7: Gebühren und Kosten von SIX Swiss Exchange).

SIX Swiss Exchange ist bestrebt, ihre Handelsplattform laufend weiterzuentwickeln und zu optimieren. Wir sind überzeugt, mit der Harmonisierung der Interfaces über alle Produktsegmente hinweg unseren Teilnehmern einen noch effizienteren Zugang zu unseren Dienstleistungen anzubieten.

Für Fragen steht Ihnen Member Services gerne zur Verfügung:

Telefon: +41 58 399 2473
E-Mail: member.services@six-group.com