



SIX Repo AG

CO:RE-Handelsplattform

Praxisunterlagen zur Prüfungsvorbereitung für Händler

Januar 2024



Inhaltsverzeichnis

1.0	Zweck dieses Dokuments	4
2.0	CO:RE-Handelsplattform	4
3.0	CO:RE Reference Data GUI	4
3.1	Benutzerrollen	4
3.2	CO:RE Reference Data GUI – Desk Administrator	5
3.2.1	Party-Administration	5
3.3	CO:RE Reference Data GUI – Trading User	6
3.3.1	Distribution Lists	7
3.3.2	Counterparty Agreements	7
4.0	CO:RE Trading GUI	9
4.1	CO:RE Trading GUI einrichten	9
4.1.1	Generelle Einstellungen	9
4.1.2	Workspace erstellen	10
4.1.3	Workspace bearbeiten	11
4.1.4	View dem Workspace hinzufügen	11
4.1.5	Grösse der Views ändern	13
4.1.6	Spalten anordnen und filtern	13
4.1.6.1	Spalten anzeigen	13
4.1.6.2	Spalten anordnen und sortieren	13
4.1.6.3	Spalten Filtern	13
4.1.7	Master Filter	14
4.1.8	Limit Projection View	15
4.2	Quoting	18
4.2.1	Workspace einrichten	18
4.2.2	Quotes erfassen	20
4.2.3	Quotes anpassen	20
4.2.4	Quote beantworten	21
4.2.5	Antworten auf Orders zu eigenen Quotes	23
4.2.5.1	Auto Match	24
4.2.6	Quotes löschen	24
4.3	Bilateral Trading	26
4.3.1	Workspace einrichten	26
4.3.2	Repo Request Offer	26
4.3.2.1	Neuer Repo Request Offer erfassen	27
4.3.2.2	Repo Request Offer aushandeln	28
4.3.3	Repo Order	32

SIX Repo AG

CO:RE-Handelsplattform

4.3.3.1	Neuer Repo Order erfassen	32
4.3.3.2	Erhaltener Repo Order akzeptieren	33
4.3.4	Templates	35
4.3.5	Conversation History	35
4.4	Executions View	36
4.4.1	Trade Slip anzeigen	36
4.5	Auctions Overview	36
4.5.1	Teilnahme an einer Auktion	37
4.5.2	Auction Order löschen	38
4.6	Contract Inventory	39
4.7	Online Hilfe	39

1.0 Zweck dieses Dokuments

Dieses Dokument dient zur Vorbereitung auf den Praxisteil der Prüfung zur Händlerlizenz von SIX Repo AG und zugleich als Nachschlagewerk für die Benutzung der CO:RE-Handelsplattform. Für den theoretischen Teil der Prüfung gibt es ein separates Dokument. Dieses ist verfügbar unter: www.six-repo.com > Teilnehmerschaft > Händler > Schulung & Prüfung > Vorbereitungsunterlagen > Handel bei SIX Repo AG – Theorie-Unterlagen zur Prüfungsvorbereitung für Händler.

2.0 CO:RE-Handelsplattform

SIX Repo AG betreibt die CO:RE-Handelsplattform zur Abwicklung von Repo-Transaktionen zur Liquiditätssicherung und Liquiditätssteuerung. Die Plattform wird nur einer geschlossenen Teilnehmergruppe zur Verfügung gestellt.

Die CO:RE-Handelsplattform besteht aus zwei separaten Applikationen:

- CO:RE Reference Data GUI
- CO:RE Trading GUI

Technische Informationen sind in der «Participant Section» der Homepage von SIX Repo AG verfügbar (www.six-repo.com, Login erforderlich).

3.0 CO:RE Reference Data GUI

Das CO:RE Reference Data GUI wird **separat** vom CO:RE Trading GUI installiert.

Über das CO:RE Reference Data GUI sind folgende Aktionen möglich:

- Verwaltung der Desk-Administrator-Konten
- Verwaltung der User-Konten
- Festlegung der Distribution List
- Festlegung der Counterparty Agreements

3.1 Benutzerrollen

Folgende Benutzergruppen haben Zugriff auf das CO:RE Reference Data GUI:

- Desk Administrator
- Trading User

Benutzer Rolle	Beschreibung	Erstellt durch
Desk Administrator	Ermöglicht die Administration und Neuerfassung von Desk Administratoren und Trading User.	Desk Administrator Wichtig: Der initiale Desk Administrator wird immer durch SIX Repo AG erfasst.
Trading User	Erlaubt die Erstellung und die Verwaltung von Distribution Lists und Counterparty Agreements	Desk Administrator

Hinweis: Es gibt weitere Rollen mit eingeschränkten Berechtigungen, Details dazu sind in der Online-Hilfe des CO:RE Reference Data GUI ersichtlich.

Desk Administrator und Trading User haben unterschiedliche Logins, entsprechend unterschiedlich sieht der Startbildschirm aus.

3.2 CO:RE Reference Data GUI – Desk Administrator

Nach dem Login als Desk Administrator wird die folgende Startseite angezeigt:

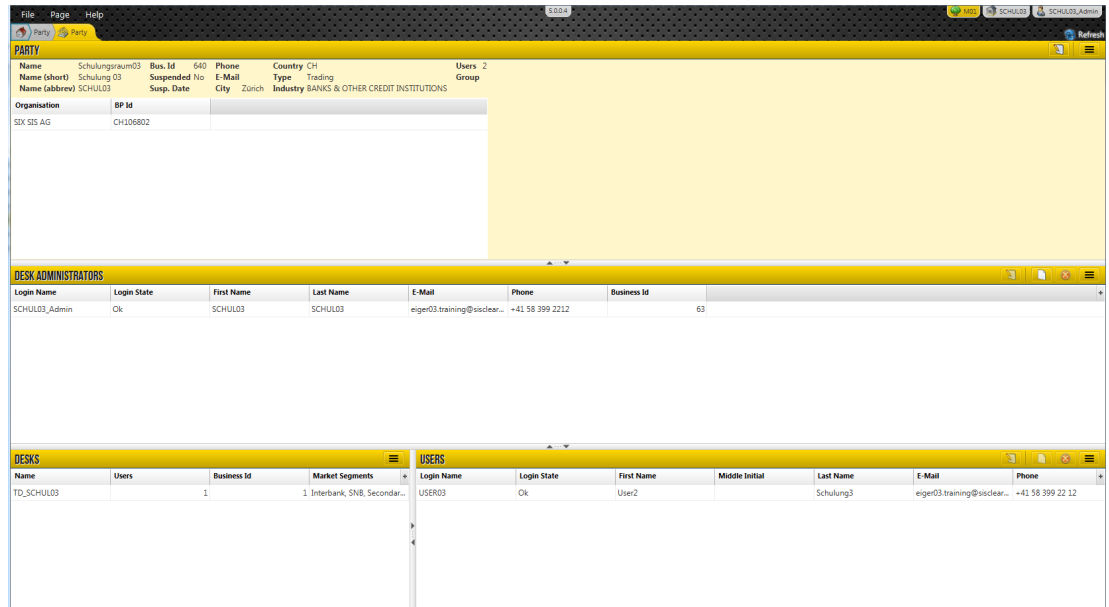


3.2.1 Party-Administration


Über den Menüpunkt *Party* wird das Hauptfenster zur Verwaltung der Desk Administrators und Trading Users aufgerufen.


- Party-Details ändern
- Administratoren hinzufügen, ändern und entfernen
- User (Trader) hinzufügen, ändern und entfernen
- User zu Desks zuordnen
- Desk-Berechtigungen aktualisieren
- Passwörter aller Administratoren und User zurücksetzen


SIX Repo AG CO:RE-Handelsplattform



The screenshot displays the CO:RE application interface. The top section is titled 'PARTY' and contains a form with fields for Name, Business ID, Phone, Country, Type, and Users. Below this is a table for 'DESK ADMINISTRATORS' with columns for Login Name, Login State, First Name, Last Name, E-Mail, Phone, and Business ID. The bottom section is titled 'DESKS' and contains a table with columns for Name, Users, Business ID, and Market Segments. To the right of the DESKS table is a 'USERS' section with a table containing columns for Login Name, Login State, First Name, Middle Initial, Last Name, E-Mail, and Phone.

Über die Schaltfläche  können neue Einträge erfasst werden (Desk Administrators und Users).

Über die Schaltfläche  können bestehende Einträge bearbeitet und angepasst werden (Party, Desk Administrators und Users).

Bestehende Einträge können über die Schaltfläche  gelöscht werden (Desk Administrators und Users).

Wichtig:

Neue Desks können nur von SIX Repo AG erfasst werden und nicht vom Desk Administrator selber.

3.3 CO:RE Reference Data GUI – Trading User

Nach dem Login als Trading User wird die folgende Startseite angezeigt:



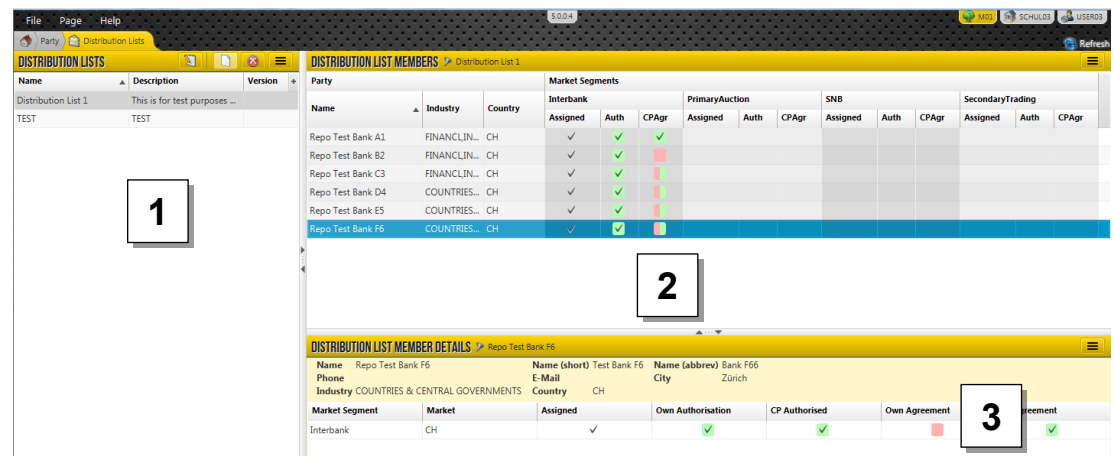
SIX Repo AG

CO:RE-Handelsplattform

3.3.1 Distribution Lists




Eine Distribution List bezeichnet eine Gruppe von Repo-Teilnehmern, welche im bilateralen Handel als mögliche Gegenpartei adressiert werden kann.

Über den Menüpunkt *Distribution Lists* wird das Hauptfenster aufgerufen, welches in drei Bereiche aufgeteilt ist:



1. Distribution Lists
2. Distribution List Members
3. Distribution List Member Details

Der Trading User kann im Bereich 1 der Distribution Lists:

- über die Schaltfläche  eine neue Distribution List erstellen.
- über die Schaltfläche  eine bestehende Distribution List aktualisieren und anpassen.
- eine Distribution List entfernen durch Klicken auf die Schaltfläche .

Wichtig:

Distribution Lists, welche im CO:RE Trading GUI zur Verfügung stehen sollen, müssen vorab im CO:RE Reference Data GUI konfiguriert werden. Eine Distribution List **kann nicht** direkt im CO:RE Trading GUI konfiguriert werden.

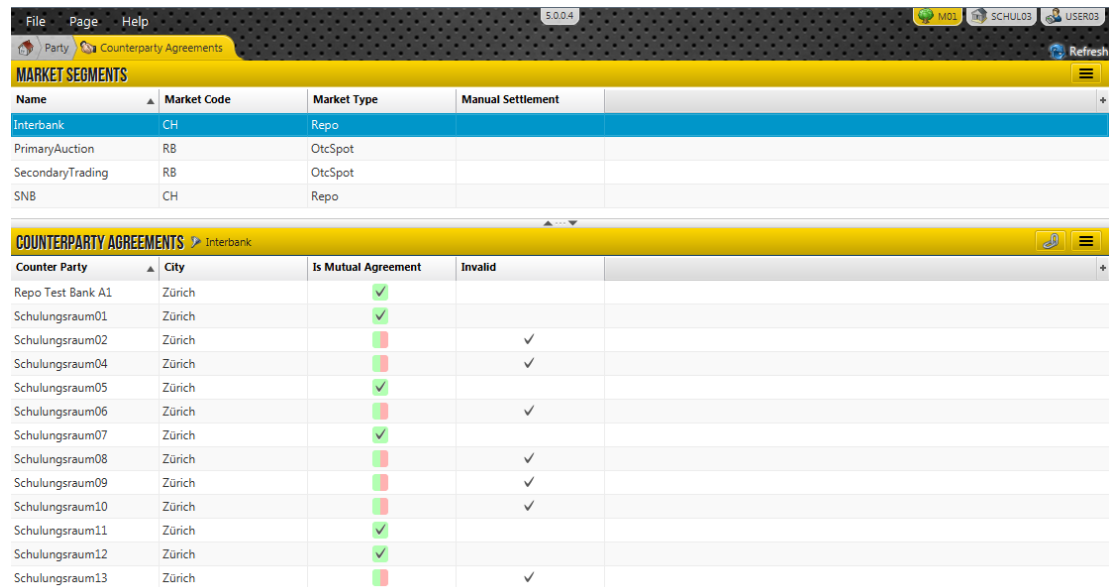
3.3.2 Counterparty Agreements

Die Counterparty Agreements definieren, mit welchen Parteien im CO:RE Trading GUI Handelsabschlüsse getätigt werden können.

SIX Repo AG

CO:RE-Handelsplattform


Über den Menüpunkt *Counterparty Agreements* wird das Hauptfenster aufgerufen:




Name	Market Code	Market Type	Manual Settlement
Interbank	CH	Repo	
PrimaryAuction	RB	OtcSpot	
SecondaryTrading	RB	OtcSpot	
SNB	CH	Repo	

Counter Party	City	Is Mutual Agreement	Invalid
Repo Test Bank A1	Zürich	✓	
Schulungsraum01	Zürich	✓	
Schulungsraum02	Zürich	✗	✓
Schulungsraum04	Zürich	✗	✓
Schulungsraum05	Zürich	✓	
Schulungsraum06	Zürich	✗	✓
Schulungsraum07	Zürich	✓	
Schulungsraum08	Zürich	✗	✓
Schulungsraum09	Zürich	✗	✓
Schulungsraum10	Zürich	✗	✓
Schulungsraum11	Zürich	✓	
Schulungsraum12	Zürich	✓	
Schulungsraum13	Zürich	✗	✓

Es können pro Marktsegment unterschiedliche Counterparty Agreements festgelegt werden. Diese gelten für den Teilnehmer generell und müssen nicht von jedem Trading User separat erfasst werden.

Der Trading User kann nach Anwählen des Marktsegments mit der Schaltfläche  die Counterparty Agreements erfassen und bearbeiten.



Create/Remove Counterparty Agreement

Market Segment: Interbank

Name	Short Name	City
Citibank NA London	Citibank NA London	London
Valiant Bank	Valiant Bank	Bern
Comer Banca SA	Comer Banca SA	Lugano
Habib Bank AG Zürich	Habib Bank AG Zürich	Zürich
ING Bank N.V.	ING Bank	Amsterdam
LGT Bank (Schweiz) AG	LGT Bank (Schweiz)	Basel
AEK Bank 1826 Genossen...	AEK Bank	Thun

Name	Short Name	City
Schulungsraum10	Schulung 10	Zürich
Schulungsraum11	Schulung 11	Zürich
Schulungsraum06	Schulung 06	Zürich
Schulungsraum02	Schulung 02	Zürich
Schulungsraum07	Schulung 07	Zürich
Schulungsraum12	Schulung 12	Zürich
Schulungsraum09	Schulung 09	Zürich

Counterparty auswählen

Counterparty entfernen

Alle auswählen

Alle entfernen

Counterparty Agreements müssen bilateral konfiguriert werden. In der Spalte *Is Mutual Agreement* ist ersichtlich, wenn die Gegenseite ebenfalls ein Counterparty Agreement erfasst hat.

Wichtig:

Die im CO:RE Reference Data GUI vorgenommenen Änderungen werden im CO:RE Trading GUI verwendet.

SIX Repo AG

CO:RE-Handelsplattform

Counterparty Agreements, welche im CO:RE Trading GUI zur Verfügung stehen sollen, müssen vorab im CO:RE Reference Data GUI konfiguriert werden. Counterparty Agreements können nicht direkt im CO:RE Trading GUI konfiguriert werden.

4.0 CO:RE Trading GUI

Über das CO:RE Trading GUI haben die Teilnehmer Zugang zum CH-Repo-Markt und OTC-Spot-Markt von SIX Repo AG. Diese beinhalten auch den Zugang zu den Offenmarktoperationen und stehenden Fazilitäten der Schweizerischen Nationalbank (SNB).

4.1 CO:RE Trading GUI einrichten

4.1.1 Generelle Einstellungen

Über den Menüpunkt *Reference* können:



1. Detail-Informationen zu den im CO:RE Trading GUI verfügbaren Kontrakten und Wertschriften abgerufen werden.
2. Distribution Lists und Counterparty Agreements abgefragt werden, welche im CO:RE Reference Data GUI definiert wurden.



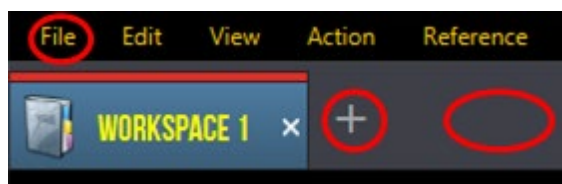
1. Wechsel zwischen den Farbschemas «Light Color Theme» und «Dark Hi-Contrast Theme»
2. Aufrufen des *Preferences* Menüs, wo weitere Einstellungen möglich sind, z.B. Farben oder Signaltöne. Details zu diesen Funktionen können der Online-Hilfe entnommen werden (siehe Unterkapitel 4.7 *Online-Hilfe*)

4.1.2 Workspace erstellen

Jeder Trading User kann seinen CO:RE Trading GUI mit Workspaces selber gestalten. Die getätigten Anpassungen werden auf dem Profil gespeichert und bleiben erhalten. Dabei können beliebig viele Workspaces verwendet werden.

Ein neuer Workspace kann wie folgt erstellt werden:

- über den Menüpunkt File > New Workspace
- mittels rechter Maustaste im Bereich der Registerkarten
- mit Klick auf das + im Bereich der Registerkarten



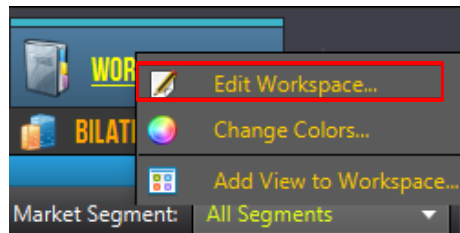
Im darauf erscheinenden Fenster kann der Workspace erstellt und nach den eigenen Wünschen definiert werden.



1. Name wählen
2. Farbe der Registerkarte
3. Symbol für Registerkarte
4. Raster Layout für Workspace

4.1.3 Workspace bearbeiten

Ein bestehender Workspace kann durch Klick mit der rechten Maustaste auf die Registerkarte bearbeitet werden.



Folgende Elemente können bearbeitet werden:

- Name des Workspace
- Farbe der Registerkarte
- Registerkartensymbol
- Das Workspace-Raster kann nicht bearbeitet werden.

















4.1.4 View dem Workspace hinzufügen

Dem neu erstellten Workspace können je nach Layout eine oder mehrere Views durch Klick mit der rechten Maustaste hinzugefügt werden.

Die folgenden Views stehen zur Auswahl:

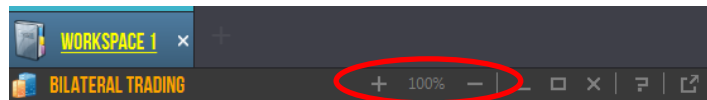
SIX Repo AG

CO:RE-Handelsplattform

	Activity: Post-Trading	→ Zeigt tägliche Post-Trading-Aktivität an
	Activity: Pre-Trading	→ Zeigt tägliche Trading-Aktivität an
	Auctions Allocations	→ Wird von Auktionatoren für Auktionen verwendet
	Auctions Overview	→ Ermöglicht Teilnehmern die Teilnahme an Auktionen
	Bilateral Trading	→ Wird von Teilnehmern für die Teilnahme am bilateralen Handel verwendet
	Contract Inventory	→ Wird für Settlement-Status und Post-Trading-Aktivitäten verwendet
	Events	→ Zeigt Trade-Event-Meldungen für den laufenden Tag an
	Executions View	→ Zeigt Ausführungen für verschiedene Trading-Modelle an
	FOREX	→ Zeigt Wechselkurse von SIX SIS an
	Linked Repo	→ Zeigt verfügbares Collateral und Transaktionen bezüglich LSFF an
	Log View	→ Zeigt Quote-Limiten an
	Public Trades	→ Zeigt Log-Meldungen an
	Quoting: OTC	→ Detaillierte Positionsübersicht des Collaterals nach Basket und Währung
	Quoting: REPO Standard	→ Zusammenfassung der Positionsübersicht nach Währung
	RSS Feeds	→ Zeigt öffentliche Geschäfte an
	Trading View	→ Ermöglicht Quoting im angegebenen Bereich
	Add View to Workspace...	→ Ermöglicht Quoting im angegebenen Bereich
		→ Zeigt definierte RSS-Feeds an
		→ Öffnet integrierten Webbrowser

4.1.5 Grösse der Views ändern

Die Views eines Workspace können einzeln mittels der Zoom-Einstellungen in der Titelleiste der einzelnen View angepasst werden.



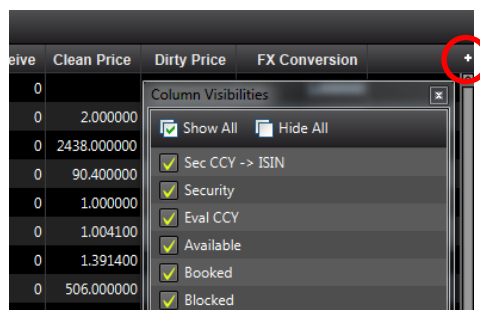
Zur gleichzeitigen Anpassung aller Views eines Workspace kann der Schieberegler am unteren Fensterrand verwendet werden.



4.1.6 Spalten anordnen und filtern

4.1.6.1 Spalten anzeigen

Über das kleine + in der Kopfzeile der Tabellenspalten können einzelne Spalten ausgeblendet oder zusätzliche Spalten eingeblendet werden.



4.1.6.2 Spalten anordnen und sortieren

In allen Ansichten kann die Reihenfolge der Spalten individuell durch Drag & Drop mit der Maus angepasst werden.

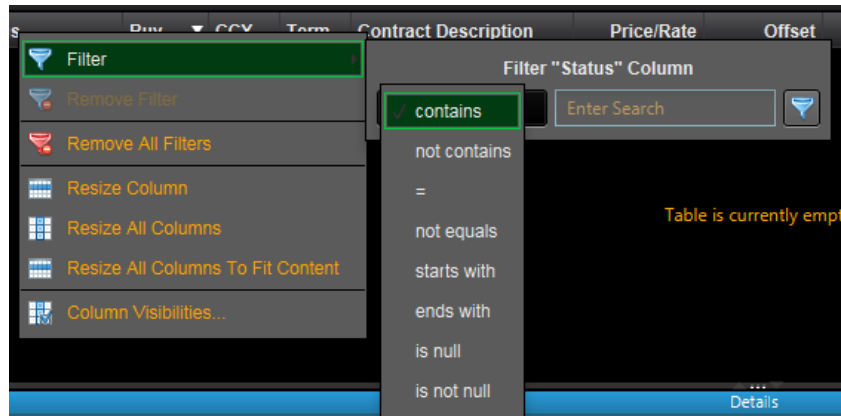
Durch Klicken auf die Überschrift wird diese Spalte sortiert. Ein kleiner Pfeil zeigt an, ob die Sortierung aufsteigend oder absteigend erfolgt.

4.1.6.3 Spalten Filtern

Für jede Spalte können durch Klicken mit der rechten Maustaste auf die Überschrift verschiedene Filteroptionen ausgewählt werden.

SIX Repo AG

CO:RE-Handelsplattform



4.1.7 Master Filter

Der Master Filter definiert Einstellungen, welche über alle Workspaces Gültigkeit haben. Die Konfiguration erfolgt über den Menüpunkt *View > Configure Master Filter*.


Als Standardeinstellung sind alle Währungen, Laufzeiten (Terms) und Baskets für die Anzeige im Workspace markiert.



Einträge können einzeln mittels Häkchen ergänzt oder entfernt werden.

Die Schaltfläche  entfernt alle Einträge.

Die Schaltfläche  ergänzt alle Einträge.

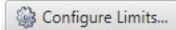
Standardmässig ist der Master Filter aktiviert, was erkennbar ist am umrahmten Symbol  im Workspace.

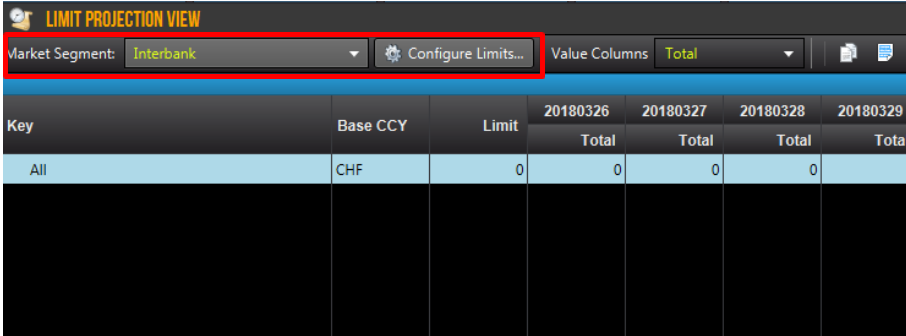
Durch Klicken auf das Symbol wird der Master Filter für den jeweiligen Workspace deaktiviert bzw. wieder aktiviert.

4.1.8 Limit Projection View

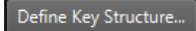
Die Limit Projection View erlaubt es, auf der Basis von Party, Currency, Term, Amount und Buy/Sell-Indikator Quoting Limits für die Handelsparteien zu konfigurieren. Es wird empfohlen, die Limiten nur auf Ebene Party zu setzen.

Limits sind ausschliesslich auf Quotes anwendbar und ermöglichen die automatische Trade-Erstellung innerhalb der Limits. Die Konfiguration der Limits erfolgt über einen Workspace mit dem View «Limit Projection View».

Nach Anwählen des Marktsegments können die Limiten über die Schaltfläche  erfasst bzw. angepasst werden.

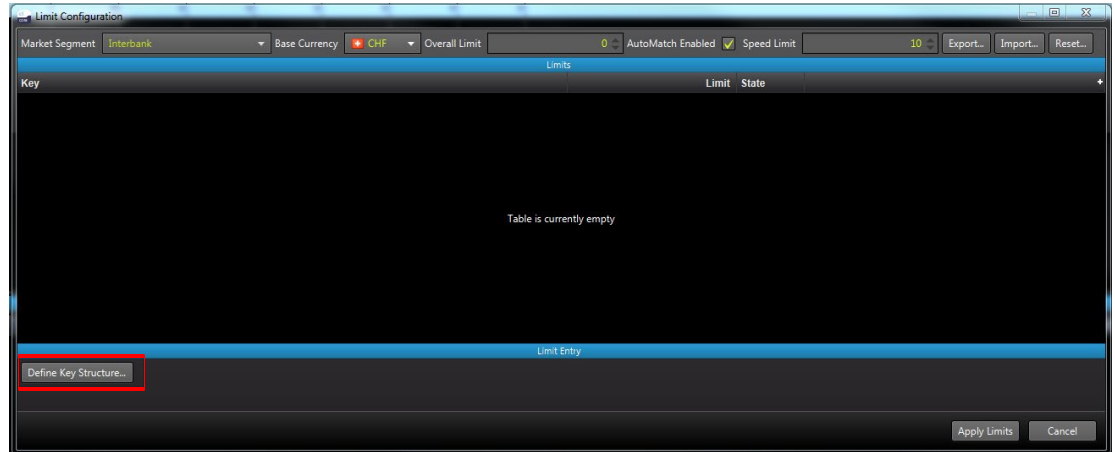


LIMIT PROJECTION VIEW						
Market Segment: Interbank		Configure Limits...	Value Columns: Total			
Key	Base CCY	Limit	20180326	20180327	20180328	20180329
			Total	Total	Total	Total
All	CHF	0	0	0	0	0

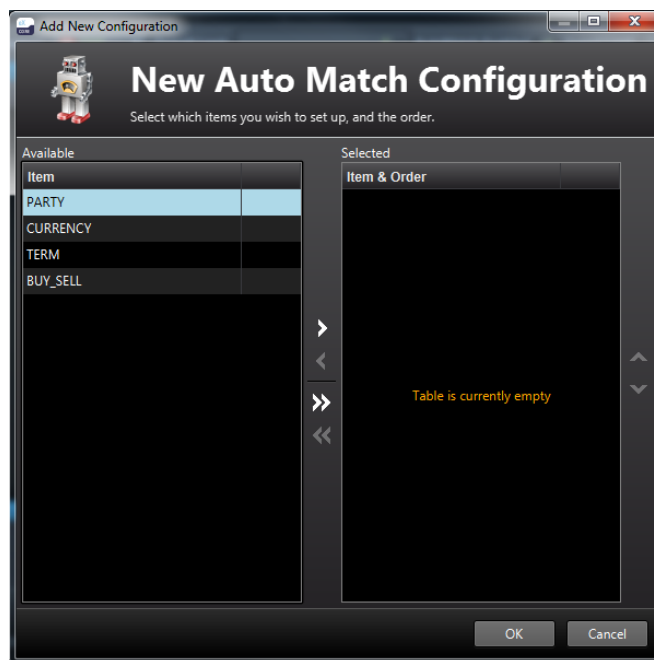
Bei der erstmaligen Konfiguration muss die Struktur definiert werden, bis auf welche Ebene die Limiten angezeigt werden sollen. Über die Schaltfläche  wird der Dialog gestartet.





SIX Repo AG

CO:RE-Handelsplattform



Im nachfolgenden Fenster können die Attribute ausgewählt werden.



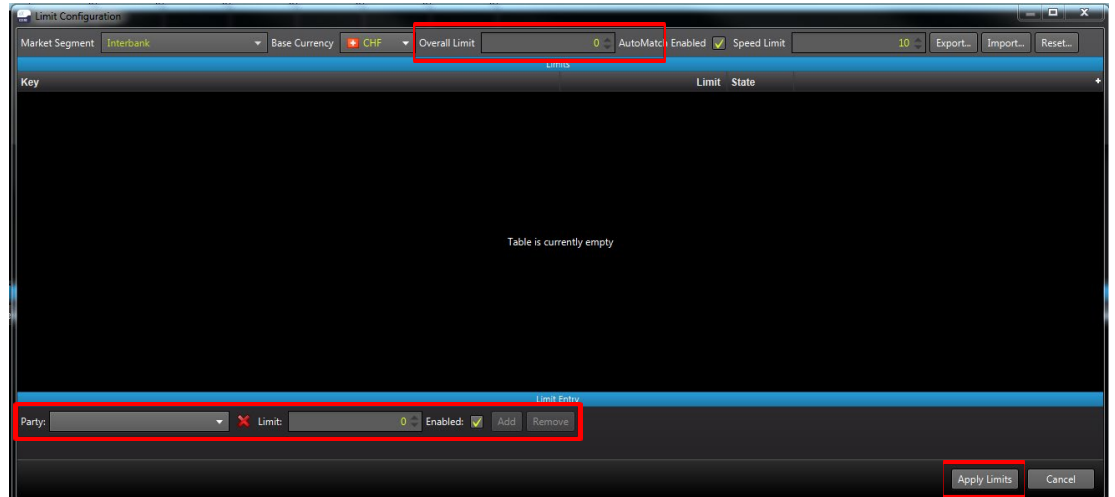
-  Item auswählen
-  Item entfernen
-  Alle auswählen
-  Alle entfernen

Es wird empfohlen, die Limiten nur auf Ebene Party zu setzen und entsprechend nur diesen Punkt auszuwählen.

Nach Abschluss der Konfiguration stehen die Felder zur Definition der Limite zur Verfügung.

SIX Repo AG

CO:RE-Handelsplattform



Limit Configuration

Market Segment: Interbank Base Currency: CHF Overall Limit: 0 AutoMatch: Enabled Speed Limit: 10 Export... Import... Reset...

Key Limit State

Table is currently empty

Limit Entry

Party: Limit: 0 Enabled: Add Remove

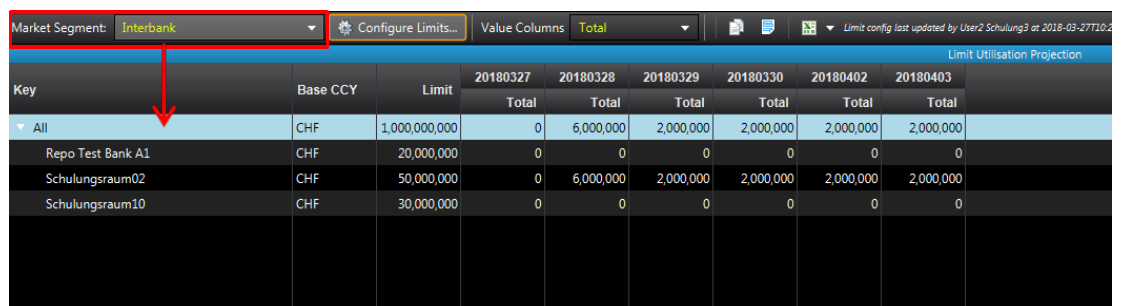
Apply Limits Cancel

Es können die Party und die jeweilige Limit erfasst werden. Die Eingabe muss mit Add bestätigt werden.

Wichtig: die *Overall Limit* muss auch erfasst werden, diese muss mindestens dem Total aller Limits entsprechen.

Wenn alle Limits erfasst sind, wird der Vorgang durch Klicken auf Apply Limits abgeschlossen.

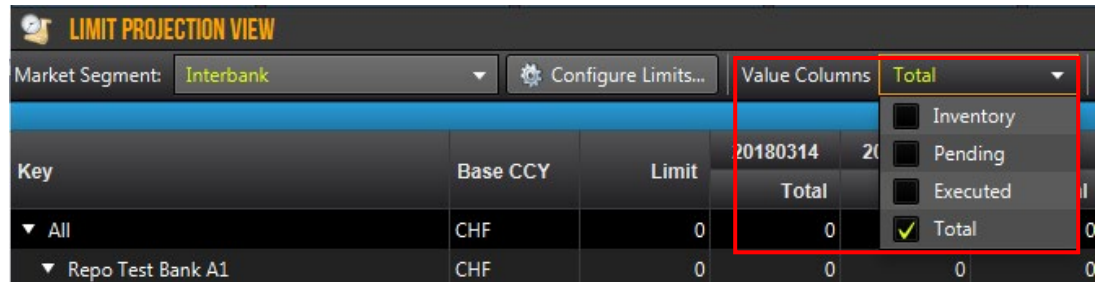
In der Limit Projection View werden alle konfigurierten Limits des angewählten Marktsegments angezeigt.



Market Segment: Interbank Configure Limits... Value Columns: Total Limit config last updated by User2 Schulung3 at 2018-03-27T10:2

Key	Base CCY	Limit	Limit Utilisation Projection					
			20180327	20180328	20180329	20180330	20180402	20180403
			Total	Total	Total	Total	Total	Total
▼ All	CHF	1,000,000,000	0	6,000,000	2,000,000	2,000,000	2,000,000	2,000,000
Repo Test Bank A1	CHF	20,000,000	0	0	0	0	0	0
Schulungsraum02	CHF	50,000,000	0	6,000,000	2,000,000	2,000,000	2,000,000	2,000,000
Schulungsraum10	CHF	30,000,000	0	0	0	0	0	0

Die Limit Projection View zeigt die verfügbaren Auto-match Limits und die Benutzung der Limits über eine Periode von 5 Tagen. Standardmässig wird nur die Spalte Total angezeigt. Über den Menüpunkt *Value Columns* können weitere Spalten eingeblendet werden.



Key	Base CCY	Limit	Value Columns
▼ All	CHF	0	20180314 20
▼ Repo Test Bank A1	CHF	0	0 0 0 0

Die einzelnen Spalten zeigen dabei folgende Werte an:

Pending

Quoting-Transaktionen, die Ihre Quoting-Limits mit einer bestimmten Gegenpartei verletzt haben und manuell akzeptiert werden müssen

Executed

Heute abgewickelte Quoting-Transaktionen (inklusive Transaktionen, die anhand der von Ihnen festgelegten Limits abgeglichen wurden)

Inventory

Transaktionen, die via SECOM abgewickelt wurden (ohne heutige Transaktionen)

Total

Insgesamt ausstehendes Volumen (Executed und Inventory)


4.2 Quoting

Ein Quote ist eine generelle, unverbindliche Offerte zum Kauf oder Verkauf von Collateral zu einem angebotenen Preis.

4.2.1 Workspace einrichten

Es muss ein Workspace mit einer der gewünschten Quoting Views erstellt werden.



In der View müssen anschliessend im Bereich *Market Overview* durch Klicken auf das Symbol  die gewünschten Contracts hinzugefügt werden.

SIX Repo AG

CO:RE-Handelsplattform

Available REPO Contracts

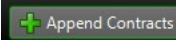
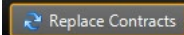

REPO Contracts
Please select contracts to import into the Quoting pane

Book ID	Repo Contract Type	Description	CCY	Asset	Term	Indices	Market Segment
268438049	STANDARD	CAD 1 WEEK	CAD	BOND	1W		Interbank
268442145	STANDARD	CHF 2 MONTHS	CHF	BOND	2M		Interbank
268444449	STANDARD	CHF EQUITY 2 WEEKS	CHF	EQUITY	2W		Interbank
268483361	STANDARD	ON SNB SPECIAL RATE	CHF	SNBGC	ON		Interbank
268447777	STANDARD	CHF OVERNIGHT	CHF	BOND	ON		Interbank
268443681	STANDARD	CHF EQUITY 1 MONTH	CHF	EQUITY	1M		Interbank
268441889	STANDARD	CHF 12 MONTHS	CHF	BOND	12M		Interbank
268443425	STANDARD	CHF 9 MONTHS	CHF	BOND	9M		Interbank
268442913	STANDARD	CHF 3 WEEKS	CHF	BOND	3W		Interbank
268446753	STANDARD	CHF INTRADAY	CHF	BOND	1N		Interbank
268444961	STANDARD	CHF EQUITY 3 WEEKS	CHF	EQUITY	3W		Interbank
268441377	STANDARD	CHF 1 MONTH	CHF	BOND	1M		Interbank
268443169	STANDARD	CHF 6 MONTHS	CHF	BOND	6M		Interbank
268448289	STANDARD	CHF SPOT NEXT	CHF	BOND	SN		Interbank
268443937	STANDARD	CHF EQUITY 1 WEEK	CHF	EQUITY	1W		Interbank
268491297	STANDARD	TOM INTRADAY SNB	CHF	BOND	TIN		Interbank
268445895	STANDARD	CHF EQUITY SPOT NEXT	CHF	EQUITY	SN		Interbank

+ Add Contracts - Cancel

- Spalten können sortiert werden
- Mehrfach-Auswahl durch gedrückte „ctrl“ Taste
- Von/bis Auswahl mit gedrückter Umschalt Taste


Eine bestehende Auswahl kann auf die gleiche Weise angepasst werden. Die neu ausgewählten Contracts können:

- der bestehenden Auswahl hinzugefügt werden 
- die bestehende Auswahl ersetzen 
- Die ausgewählten Contracts werden in den Bereich *Market Overview* übernommen. Zur besseren Übersicht können mit der Schaltfläche  Contracts ohne Quotes ausgeblendet werden.


QUOTING: REPO STANDARD

Market Overview

Market Segment: **Interbank**



CCY	Asset	Buy Quantity	Best Buy	Term	Best Sell	Sell Quantity	Buy Quantity	Own Buy	Own Sell	Sell Quantity	Min Buy Qty	Min Sell Qty	Own Quotes
CHF	SNBGC	200,000,000	-0.735000	ON	-0.770000	100,000,000					1,000,000	1,000,000	
CHF	SNBGC	100,000,000	-0.720000	12M							1,000,000	1,000,000	

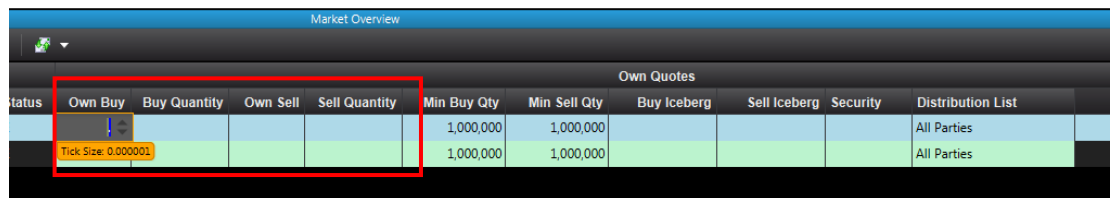


Die Spalten der Anzeige können durch Klicken auf das kleine + angepasst werden. Es können z.B. die Spalten *Own Buy Status/Own Sell Status* eingeblendet werden, um die eigenen Quotes am Markt mit denen der anderen Teilnehmer zu vergleichen.

Die Reihenfolge der Spalten kann per Drag & Drop angepasst werden.

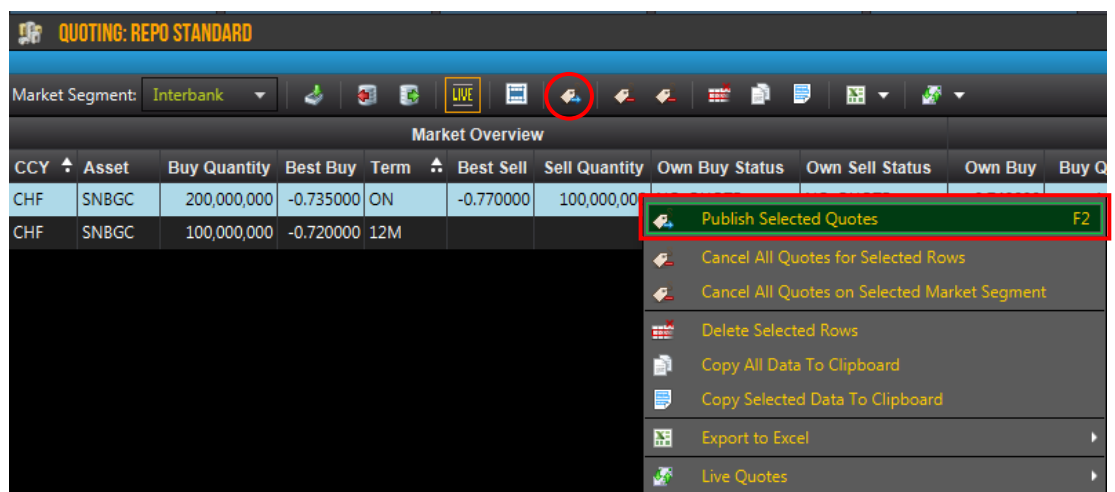
4.2.2 Quotes erfassen

Im Bereich *Own Quotes* unter *Market Overview* können durch Doppelklick auf die Felder *Own Buy* oder *Own Sell* sowie *Buy Quantity* oder *Sell Quantity* die Details für den eigenen Quote erfasst werden.



Status	Own Buy	Buy Quantity	Own Sell	Sell Quantity	Min Buy Qty	Min Sell Qty	Buy Iceberg	Sell Iceberg	Security	Distribution List
					1,000,000	1,000,000				All Parties
					1,000,000	1,000,000				All Parties

Die so erfassten Quotes müssen noch am Markt veröffentlicht werden. Dies erfolgt entweder durch Klicken der rechten Maustaste auf den Quote und dann mit *Publish Selected Quotes* oder durch Klicken auf das entsprechende Symbol in der Menüleiste.



CCY	Asset	Buy Quantity	Best Buy	Term	Best Sell	Sell Quantity	Own Buy Status	Own Sell Status	Own Buy	Buy Q
CHF	SNBGC	200,000,000	-0.735000	ON	-0.770000	100,000,000				
CHF	SNBGC	100,000,000	-0.720000	12M						

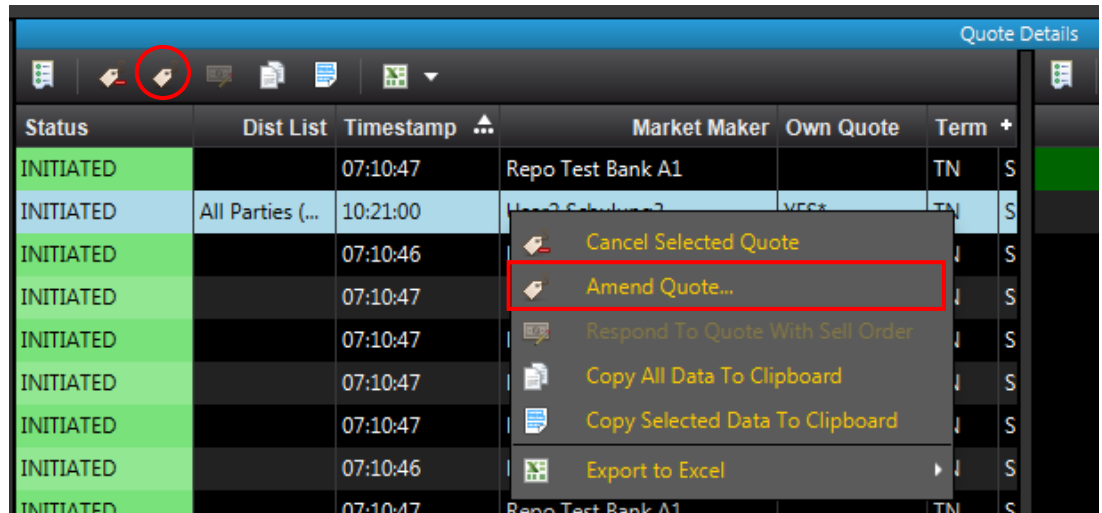
Nun kann der Quote von allen Parteien in der *Market Overview* eingesehen werden.


4.2.3 Quotes anpassen

Bestehende Quotes können angepasst werden. Dazu muss im Bereich Quote Details der betreffende Quote mit der rechten Maustaste angeklickt und dann der Menüpunkt *Amend Quote* ausgewählt werden.

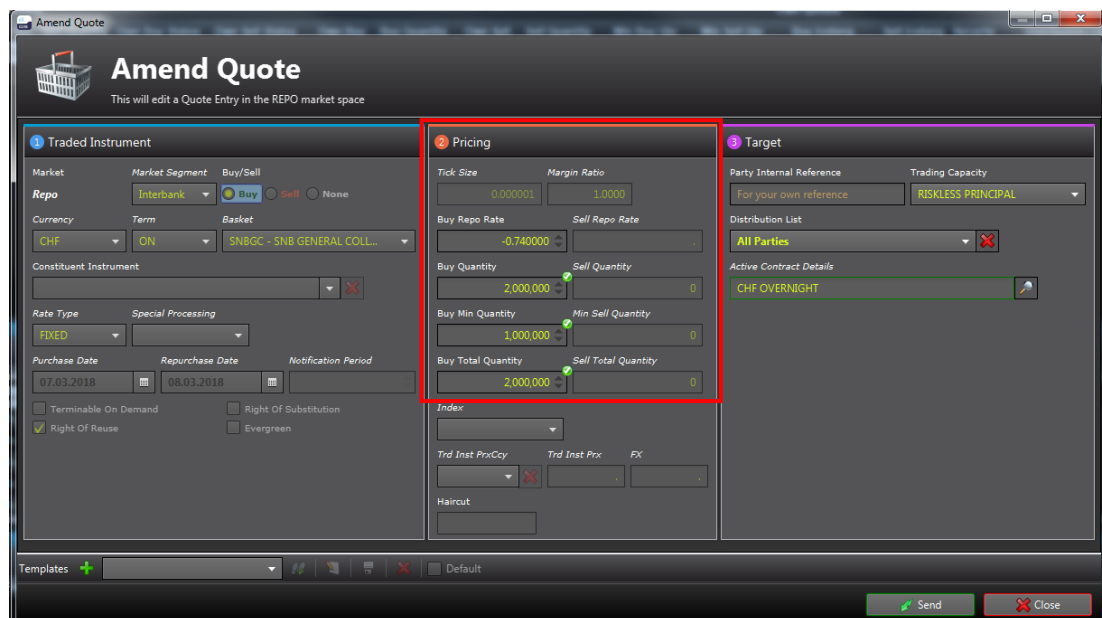
SIX Repo AG

CO:RE-Handelsplattform



Alternativ kann auch das Symbol  in der Menüleiste angewählt werden, wenn der Quote im Bereich Quote Details markiert ist.

In der daraufhin angezeigten Maske können die Änderungen vorgenommen und durch Klicken auf die Schaltfläche *Send* bestätigt werden.



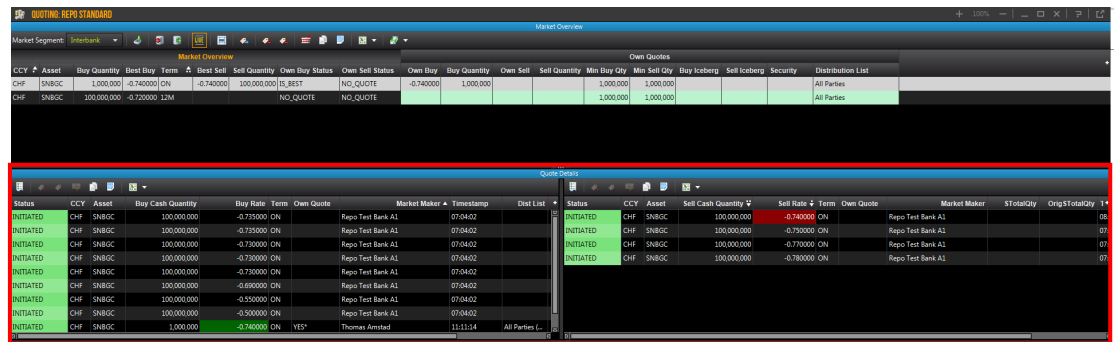
4.2.4 Quote beantworten

Quotes für die gleiche Währung (CCY), den gleichen Basket (Asset) und die gleiche Laufzeit (Term) werden in derselben Zeile in der *Market Overview* ausgewiesen.

SIX Repo AG

CO:RE-Handelsplattform

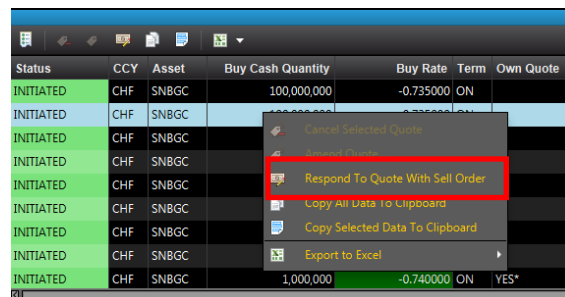
Die Markttiefe wird im Fenster *Quote Details* angezeigt. Hier sind die Details der einzelnen Quotes ersichtlich, und es kann ein Order auf einen Quote erfasst werden.




The screenshot shows the 'Market Overview' window at the top and the 'Quote Details' window below it. The 'Quote Details' window is divided into two panes: 'Buy' on the left and 'Sell' on the right. The 'Buy' pane shows a list of quotes with columns for Status, CCY, Asset, Buy Cash Quantity, Buy Rate, Term, Own Quote, Market Maker, and Timestamp. The 'Sell' pane shows a similar list of quotes. The 'Quote Details' window is highlighted with a red border.

Der Bereich *Quote Details* ist unterteilt in *Buy* (links) und *Sell* (rechts).

Um auf einen Quote eines anderen Teilnehmers zu reagieren, muss im Market Overview der gewünschte Term ausgewählt werden. Im Bereich Quote Details kann durch Klicken mit der rechten Maustaste auf den gewünschten Quote und Auswahl des Menüpunktes *Respond to Quote with Sell Order* bzw. *Buy Order* das entsprechende Fenster aufgerufen werden.

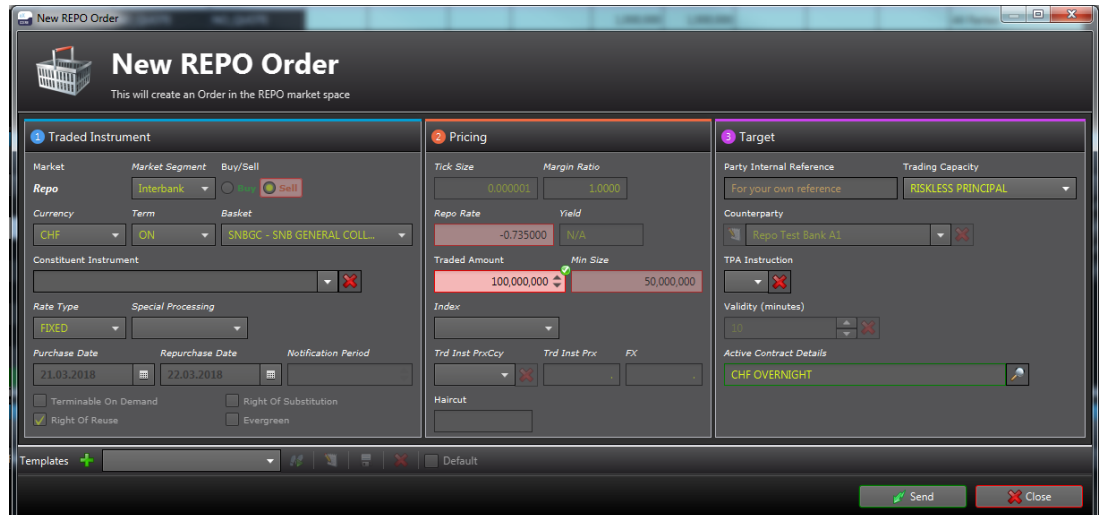


The screenshot shows the 'Quote Details' window with a context menu open over a quote. The menu options are: 'Cancel Selected Quote', 'Respond to Quote With Sell Order' (highlighted with a red box), 'Copy All Data to Clipboard', 'Copy Selected Data To Clipboard', and 'Export to Excel'.

Alternativ kann auch das Symbol  in der Menüleiste angewählt werden, wenn der Quote im Bereich Quote Details markiert ist.

SIX Repo AG

CO:RE-Handelsplattform



Durch die Erfassung von Repo Orders wird ein verbindliches Angebot zum Abschluss eines Geschäfts an die Gegenpartei übermittelt.

Die erfassten Orders werden im Bereich *Orders* in der Quoting View angezeigt.

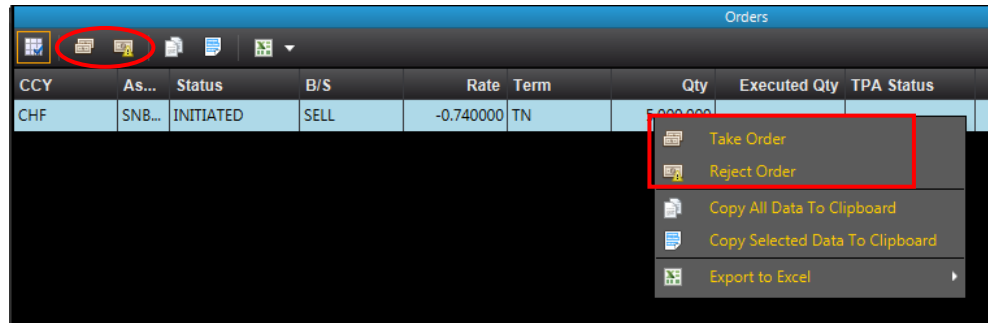
Orders							
CCY	Asset	Status	B/S	Rate	Term	Qty	Executed Qty
CHF	SNBGC	INITIATED	SELL	-0.730000	SN	100,000,000	

4.2.5 Antworten auf Orders zu eigenen Quotes

Wenn eine Gegenpartei einen Order auf einen eigenen Quote übermittelt, erscheint dieser ebenfalls im Bereich Orders.

Durch Klicken mit der rechten Maustaste öffnet sich das Kontextmenü mit folgenden Optionen:

- Take Order
- Reject Order



Alternativ kann auch das entsprechende Symbol in der Menüleiste angewählt werden, wenn der Order im Bereich *Orders* markiert ist.

4.2.5.1 Auto Match

Wenn für eine bestimmte Gegenpartei in der *Limit Projection View* (siehe Unterkapitel 4.1.8 *Limit Projection View*) eine Auto Match Limite konfiguriert wurde und ein Quote zu einem Abschluss führt, kommt das Limit Management zur Anwendung:

- Wird die Limite der Gegenpartei nicht verletzt, wird der Order automatisch abgeglichen.
- Wird die Limite verletzt (Limit Breach), muss der Order manuell akzeptiert werden, um einen Trade zu erstellen.

In der Spalte *Auto Match* im Bereich *Orders* ist ersichtlich, ob die Auto Match-Funktion zur Anwendung kam.

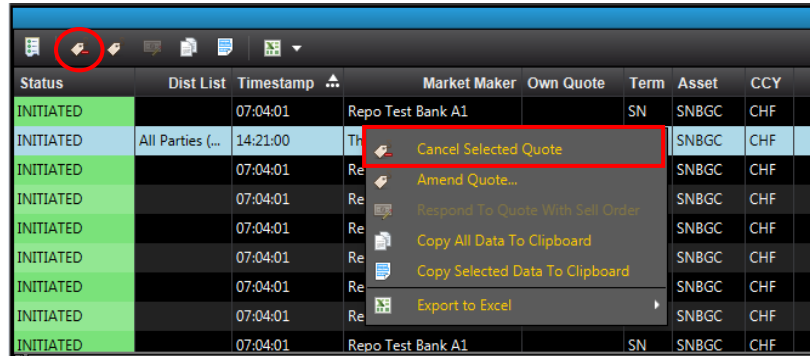
Orders										
CCY	As...	Status	B/S	Rate	Term	Qty	Executed Qty	Order ID	From/To	Auto Match
CHF	SNB...	INITIATED	SELL	-0.740000	TN	5,000,000				
CHF	SNB...	FULLY MATCHED	BUY	-0.700000	2W	2,000,000	2,000,000	170	Schulungsraum02	Limit Breach
CHF	SNB...	FULLY MATCHED	SELL	-0.750000	TN	6,000,000	6,000,000	174	Schulungsraum02	Success

4.2.6 Quotes löschen


Einzelne Quotes können im Bereich *Quote Details* durch Klicken mit der rechten Maustaste auf den betreffenden Quote und mit Auswahl des Punktes *Cancel Selected Quote* gelöscht werden.

SIX Repo AG

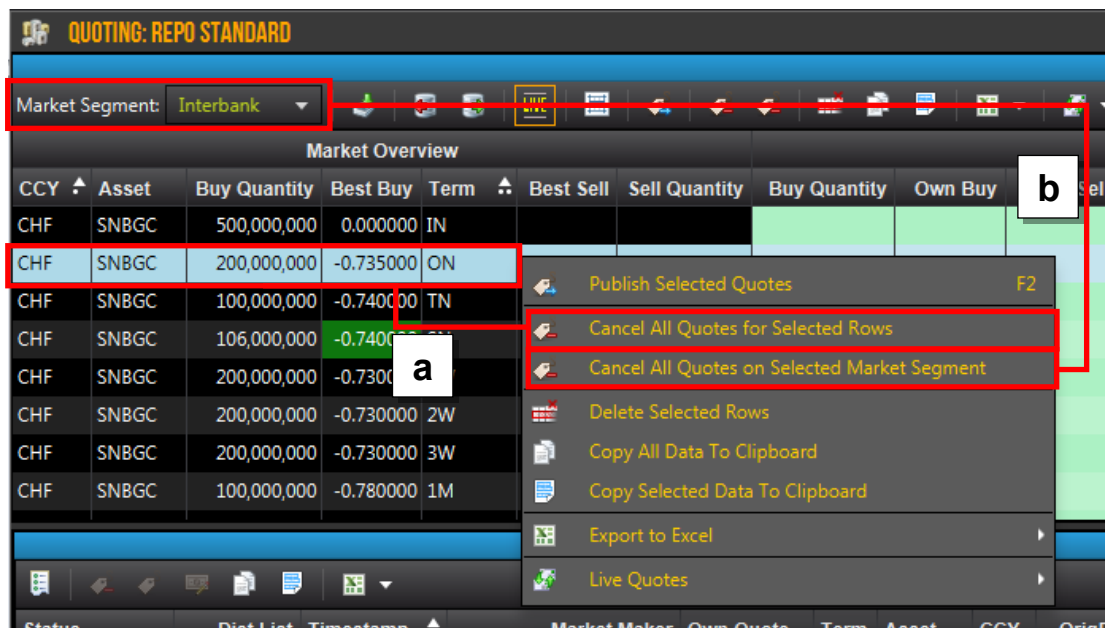
CO:RE-Handelsplattform



Status	Dist List	Timestamp	Market Maker	Own Quote	Term	Asset	CCY	Orig
INITIATED		07:04:01	Repo Test Bank A1		SN	SNBGC	CHF	
INITIATED	All Parties (...)	14:21:00	TH			SNBGC	CHF	
INITIATED		07:04:01	Re			SNBGC	CHF	
INITIATED		07:04:01	Re			SNBGC	CHF	
INITIATED		07:04:01	Re			SNBGC	CHF	
INITIATED		07:04:01	Re			SNBGC	CHF	
INITIATED		07:04:01	Re			SNBGC	CHF	
INITIATED		07:04:01	Re			SNBGC	CHF	
INITIATED		07:04:01	Repo Test Bank A1		SN	SNBGC	CHF	

Alternativ kann auch das Symbol  in der Menüleiste angewählt werden, wenn der Quote im Bereich Quote Details markiert ist.

Sollen mehrere Quotes gelöscht werden, stehen folgende Optionen zur Verfügung:



QUOTING: REPO STANDARD									
Market Segment: Interbank									
Market Overview									
CCY	Asset	Buy Quantity	Best Buy	Term	Best Sell	Sell Quantity	Buy Quantity	Own Buy	Sell
CHF	SNBGC	500,000,000	0.000000	IN					
CHF	SNBGC	200,000,000	-0.735000	ON					
CHF	SNBGC	100,000,000	-0.740000	TN					
CHF	SNBGC	106,000,000	-0.740000						
CHF	SNBGC	200,000,000	-0.730000						
CHF	SNBGC	200,000,000	-0.730000	2W					
CHF	SNBGC	200,000,000	-0.730000	3W					
CHF	SNBGC	100,000,000	-0.780000	1M					

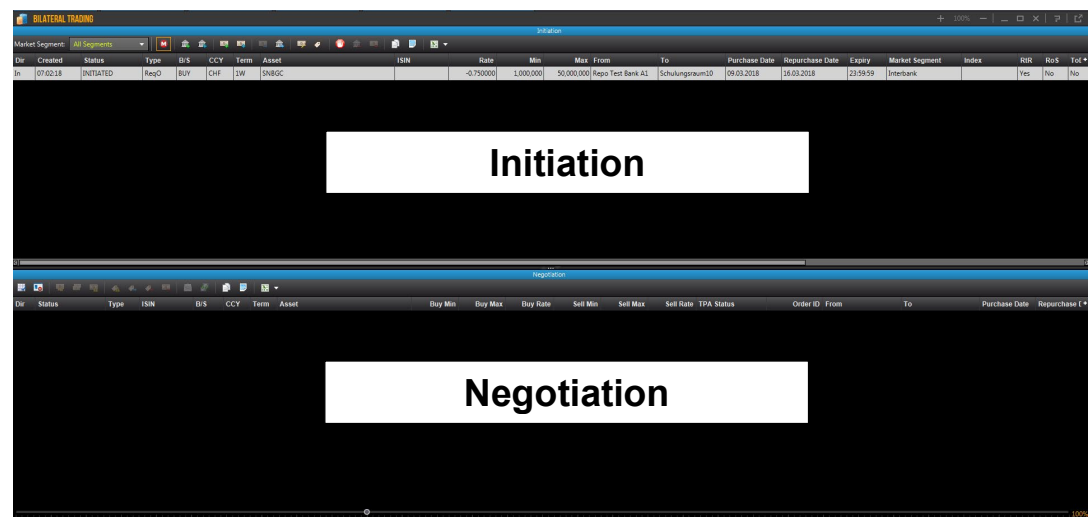
- Alle Quotes eines Terms löschen
Rechtsklick auf den betroffenen Term und den Menüpunkt *Cancel All Quotes for Selected Rows* auswählen.
- Alle Quotes eines Marktsegments löschen
Rechtsklick auf einem beliebigen Term des betroffenen Marktsegments und den Menüpunkt *Cancel All Quotes on Selected Market Segment* auswählen

4.3 Bilateral Trading

Das Bilateral Trading ermöglicht den Handel im Repo-Markt und im OTC Spot Markt mit bestimmten Gegenparteien.

4.3.1 Workspace einrichten

Es muss ein Workspace mit der Bilateral Trading View erstellt werden. Diese View ist unterteilt in die Bereiche *Initiation* und *Negotiation*. Es werden sowohl der OTC-Spot-Markt als auch der Repo-Markt angezeigt.



Im Bereich *Initiation* werden Orders und Offers gesendet. Zudem ist ersichtlich, welche Aufträge erteilt oder erhalten wurden und welchen Status sie jeweils haben.

Im Bereich *Negotiation* werden Orders und Offers ausgehandelt und abgeschlossen. Die Details im Bereich *Negotiation* beziehen sich auf Offers und Orders, die im Bereich *Initiation* gewählt wurden.

Wichtig:

Ein Trade ist nur mit einer Gegenpartei möglich, für die vorgängig ein Counterparty Agreement im CO:RE Reference Data GUI erfasst wurde.

4.3.2 Repo Request Offer

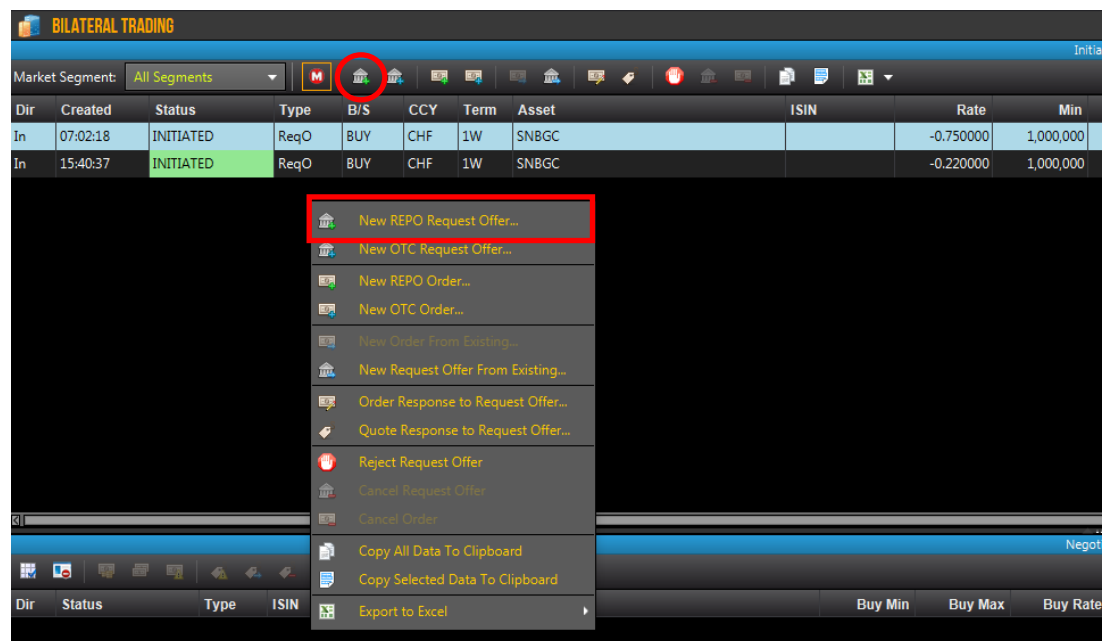
Ein Request Offer stellt eine Handelsaufforderung an eine qualifizierte Gruppe von Empfängern (definiert durch eine Distribution List) oder eine bestimmte Gegenpartei dar. Die Standardeinstellung ist *All Parties* und umfasst alle Gegenparteien, mit denen ein Counterparty Agreement besteht.

SIX Repo AG

CO:RE-Handelsplattform

4.3.2.1 Neuer Repo Request Offer erfassen

Das Fenster zur Erfassung eines neuen Repo Request Offer wird durch Klicken der rechten Maustaste im Bereich *Initiation* und dann mit *New Repo Request Offer* oder durch Klicken auf das entsprechende Symbol in der Menüleiste aufgerufen.

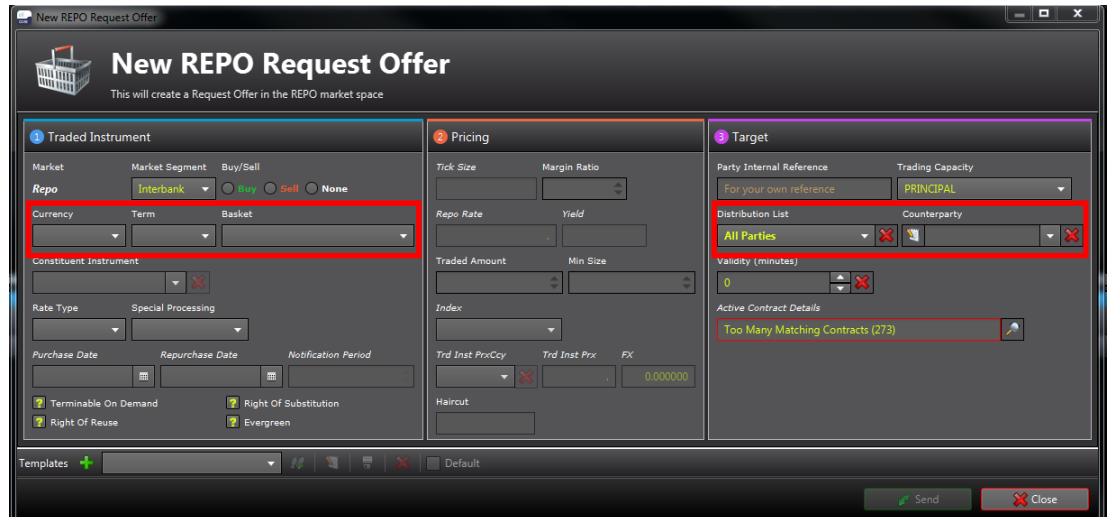


Im Fenster für die Erfassung des Repo Request Offer sind folgende Eingaben zwingend erforderlich:

- Currency
- Term
- Basket
- Distribution List oder Counterparty

SIX Repo AG

CO:RE-Handelsplattform



Die restlichen Felder sind optional und können zur weiteren Parametrisierung des Geschäftes verwendet werden. Gewisse Werte werden jedoch automatisch vom System abgefüllt, abhängig vom gehandelten Instrument (Traded Instrument).

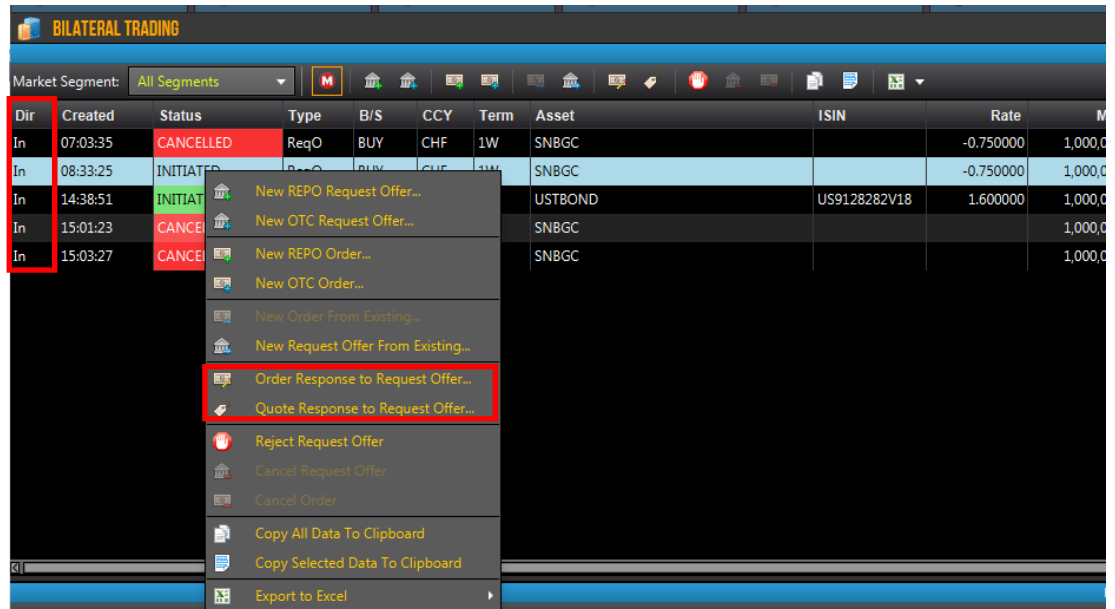
4.3.2.2 Repo Request Offer aushandeln

Eingehende Repo Request Offers von anderen Parteien werden im Bereich *Initiation* der *Bilateral Trading View* angezeigt.

Um einen Request Offer zu beantworten, wird durch Klicken mit der rechten Maustaste auf den betreffenden Eintrag das entsprechende Kontextmenü geöffnet.

SIX Repo AG

CO:RE-Handelsplattform



Es gibt folgende Möglichkeiten:

a. Order Response to Request Offer

Die Request Offer wird mit einem Order an die Gegenpartei beantwortet, d.h. es erfolgt eine verbindliche Addressed Offer.

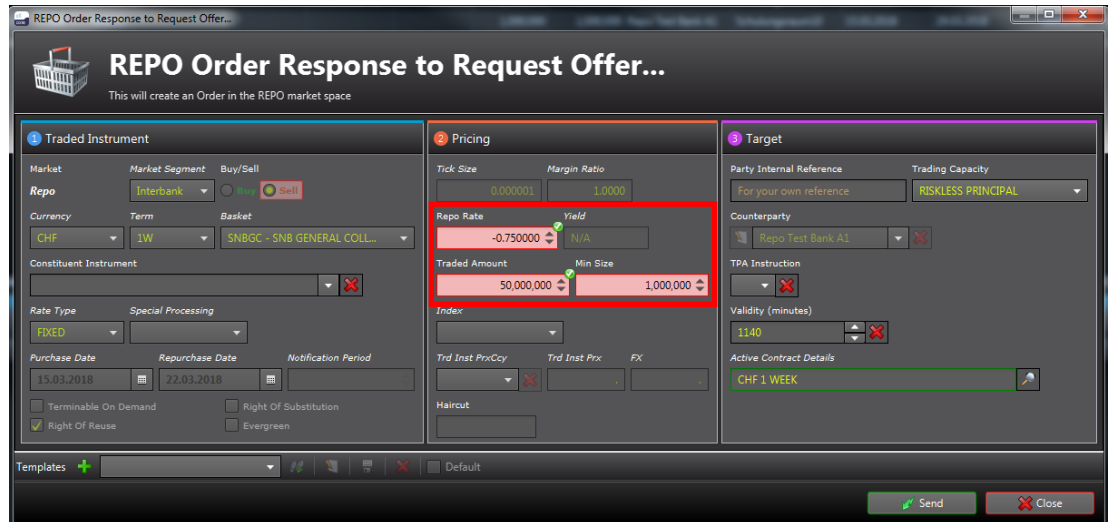
Alternativ kann auch das Symbol  in der Menüleiste angewählt werden.

Im Fenster *Repo Order Response to Request Offer* können die Attribute, welche von der Gegenpartei nicht erfasst wurden, ergänzt und die folgenden Werte noch angepasst werden, bevor der Order übermittelt wird:

- Repo Rate
- Cash Amount
- Minimal Size

SIX Repo AG

CO:RE-Handelsplattform



b. Quote Response to Request Offer

Die Request Offer wird mit einem Quote an die Gegenpartei beantwortet, d.h. es wird eine angepasster Quote an die Gegenpartei retourniert.

Alternativ kann auch das Symbol  in der Menüleiste angewählt werden.

Im Fenster *Repo Quote Response to Request Offer* können die folgenden Attribute noch angepasst werden, bevor der Quote übermittelt wird:

- Repo Rate
- Quantity
- Minimal Size

SIX Repo AG
CO:RE-Handelsplattform

REPO Quote Response to Request Offer...

This will edit a Quote in the REPO market space

1 Traded Instrument

Market: **Repo**

Market Segment: **Interbank**

Buy/Sell: **Buy** **Sell** **None**

Currency: **CHF**

Term: **1W**

Basket: **SINBGC - SINB GEN COLL...**

Constituent Instrument:

Rate Type: **FIXED**

Special Processing:

Purchase Date: **15.03.2018**

Repurchase Date: **22.03.2018**

Notification Period:

☐ Terminable On Demand

☒ Right Of Reuse

☐ Right Of Substitution

☐ Evergreen

2 Pricing

Tick Size: **0.000001**

Margin Ratio: **1.0000**

Buy Repo Rate:

Sell Repo Rate: **-0.750000**

Buy Quantity: **1 K, M, G for quick values**

Sell Quantity: **50,000,000**

Buy Min Quantity: **1 K, M, G for quick values**

Min Sell Quantity: **1,000,000**

Index:

Trd Inst PrxCcy:

Trd Inst Prx:

FX:

Haircut:

3 Target

Party Internal Reference: **For your own reference**

Trading Capacity: **RISKLESS PRINCIPAL**

Counterparty: **Repo Test Bank A1**

Validity (minutes): **1140**

Active Contract Details: **CHF 1 WEEK**

Templates **+**

Default

Send **Close**

Nach der Beantwortung der Request Offer wechselt der Status im Bereich *Initiation* der Bilateral Trading View auf Replied (Order Response) bzw. Countered (Quote Response). Die Details sind im Bereich *Negotiation* ersichtlich. Dazu muss der betreffende Offer im Bereich *Initiation* angewählt sein.

The screenshot shows the Bloomberg terminal interface. The top section is the 'Initiation' screen, which displays a table of market segments. The bottom section is the 'Negotiation' screen, which shows a single quote for the same asset (ROSF TSE).

Dir	Created	Status	Type	B/S	CCY	Term	Asset	ISIN	Rate	Min	Max
In	07:03:35	CANCELLED	ReqO	BUY	CHF	1W	SNBGC		-0.750000	1,000,000	50,000,000
In	08:33:25	REPLIED	ReqO	BUY	CHF	1W	SNBGC		-0.750000	1,000,000	50,000,000
In	14:38:51	INITIATED	ReqO	SELL	USD	1W	USTBOND	US9128282V18	1.600000	1,000,000	1,000,000
In	15:01:23	CANCELLED	ReqO		CHF	2W	SNBGC			1,000,000	1,000,000
In	15:03:27	CANCELLED	ReqO		EUR	1W	SNBGC			1,000,000	0
In	15:23:22	CANCELLED	ReqO		EUR	1M	SNBGC			1,000,000	0
In	15:34:03	CANCELLED	ReqO		GBP	2M	ROSF TSE			1,000,000	0
In	15:42:54	COUNTERED	ReqO		GBP	3M	ROSF TSE			1,000,000	0

Dir	Status	Type	ISIN	B/S	CCY	Term	Asset	Buy Min	Buy Max	Buy Rate	Sell M
Out	INITIATED	Quote			GBP	3M	ROSF TSE	0	11,000,000	0.760000	

Ein Order Response muss von der Gegenpartei noch mittels Take Order akzeptiert werden, damit der Trade zustande kommt. Sie kann diesen aber auch ablehnen.

SIX Repo AG

CO:RE-Handelsplattform

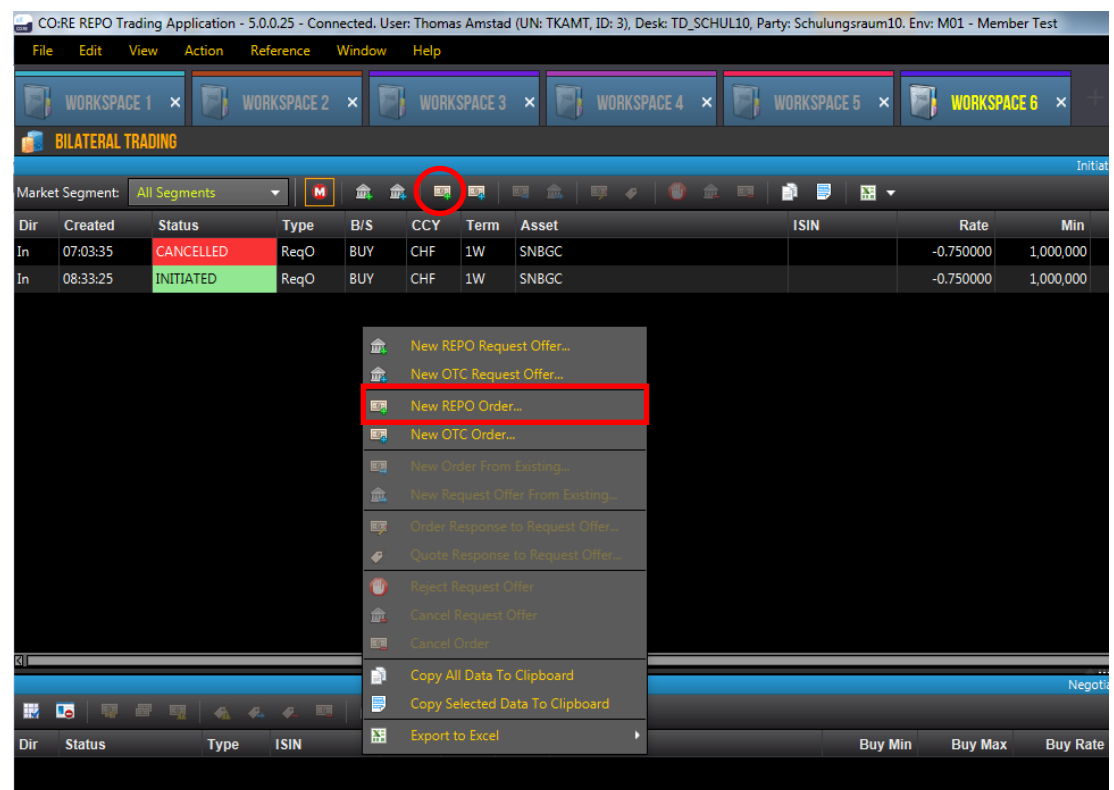
Eine Quote Response muss von der Gegenpartei wiederum mit einer Order Response beantwortet werden.

4.3.3 Repo Order

Ein Repo Order ist eine Addressed Offer, ein verbindliches Angebot zum Abschluss eines Geschäfts an eine einzelne ausgewählte Gegenpartei. Es kommt keine Distribution List zur Anwendung.

4.3.3.1 Neuer Repo Order erfassen

Das Fenster zur Erfassung eines neuen Repo Order wird durch Klicken der rechten Maustaste im Bereich *Initiation* und dann mit *New Repo Order* oder durch Klicken auf das entsprechende Symbol in der Menüleiste aufgerufen.

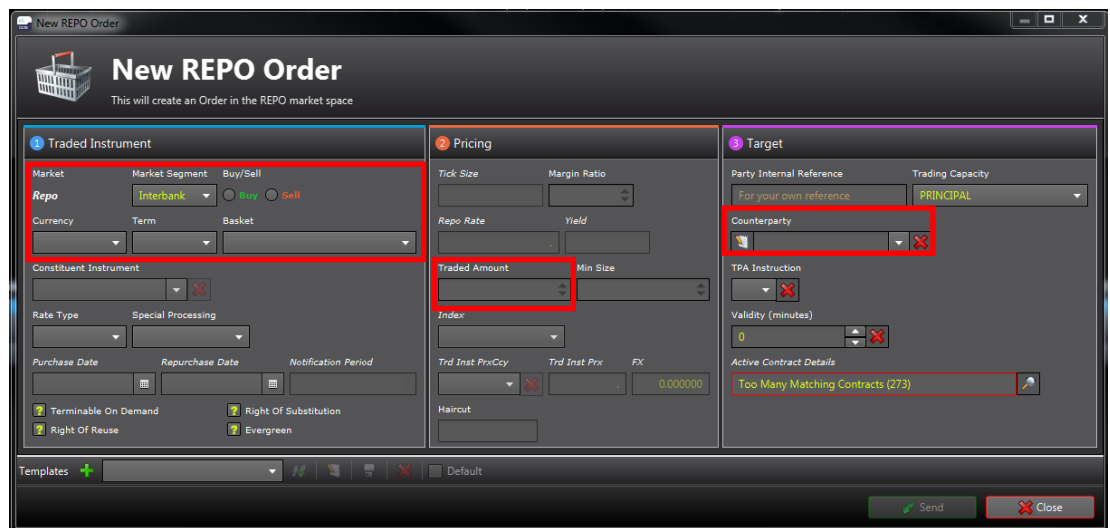


Im Fenster für die Erfassung des Repo Order sind folgende Eingaben zwingend erforderlich:

- Market Segment
- Buy/Sell

SIX Repo AG CO:RE-Handelsplattform

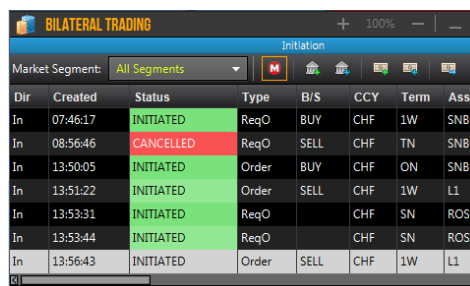
- Currency
- Term
- Basket
- Traded Amount
- Counterparty



Die restlichen Felder sind optional und können zur weiteren Parametrisierung des Geschäftes verwendet werden.

4.3.3.2 Erhaltener Repo Order akzeptieren

Eingehende Repo Orders von anderen Parteien werden im Bereich *Initiation* der *Bilateral Trading View* angezeigt. Wenn ein Repo Order angewählt wird, sind die Detail im Bereich *Negotiation* ersichtliche.



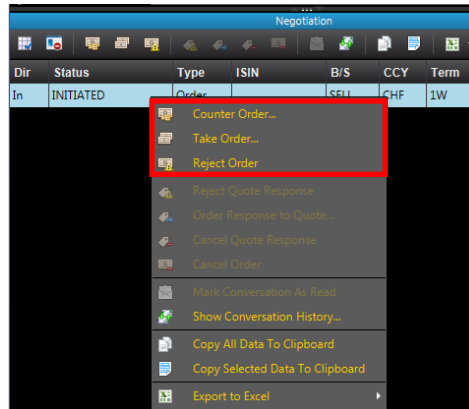
Dir	Created	Status	Type	B/S	CCY	Term	Asse
In	07:46:17	INITIATED	ReqO	BUY	CHF	1W	SNBG
In	08:56:46	CANCELLED	ReqO	SELL	CHF	TN	SNBG
In	13:50:05	INITIATED	Order	BUY	CHF	ON	SNBG
In	13:51:22	INITIATED	Order	SELL	CHF	1W	L1
In	13:53:31	INITIATED	ReqO	CHF	SN	ROSD	
In	13:53:44	INITIATED	ReqO	CHF	SN	ROSD	
In	13:56:43	INITIATED	Order	SELL	CHF	1W	L1

Um einen Repo Order zu beantworten, wird durch Klicken mit der rechten Maustaste auf den betreffenden Eintrag im Bereich *Negotiation* das entsprechende Kontextmenü geöffnet.

SIX Repo AG

CO:RE-Handelsplattform

Für einen erhaltenen Repo Order stehen folgende Optionen zur Verfügung:



Counter Order

Der Order wird mit Anpassungen akzeptiert

Take Order

Order wird akzeptiert

Reject Order

Der Order wird abgelehnt

Die Optionen können alternativ auch über das jeweilige Symbol in der Menüleiste ausgewählt werden, wenn der Auftrag markiert ist.

Wenn ein Repo Order mit einem Counter Order beantwortet wird, muss die Gegenpartei diesen wiederum mit einer Take-Order-Meldung beantworten.

Repo Orders, welche von einer Seite mittels Take Order akzeptiert wurden, erscheinen umgehend mit dem Status ENDED im Bereich *Initiation* bzw. FULLY MATCHED im Bereich *Negotiation*.


BILATERAL TRADING									
Market Segment: All Segments									
Dir	Created	Status	Type	B/S	CCY	Term	Asset	ISIN	
In	07:46:17	INITIATED	ReqO	BUY	CHF	1W	SNBGC		
In	08:56:46	CANCELLED	ReqO	SELL	CHF	TN	SNBGC		
In	13:50:05	ENDED	Order	BUY	CHF	ON	SNBGC		
In	13:51:22	INITIATED	Order	SELL	CHF	1W	L1		
In	13:53:31	INITIATED	ReqO		CHF	SN	ROSDAX		
In	13:53:44	INITIATED	ReqO		CHF	SN	ROSDAX		
In	13:56:43	ENDED	Order	SELL	CHF	1W	L1		

Dir	Status	Type	ISIN	B/S	CCY	Term	Asset	Buy Min
In	FULLY MATCHED	Execution		BUY	CHF	1W	L1	

4.3.4 Templates

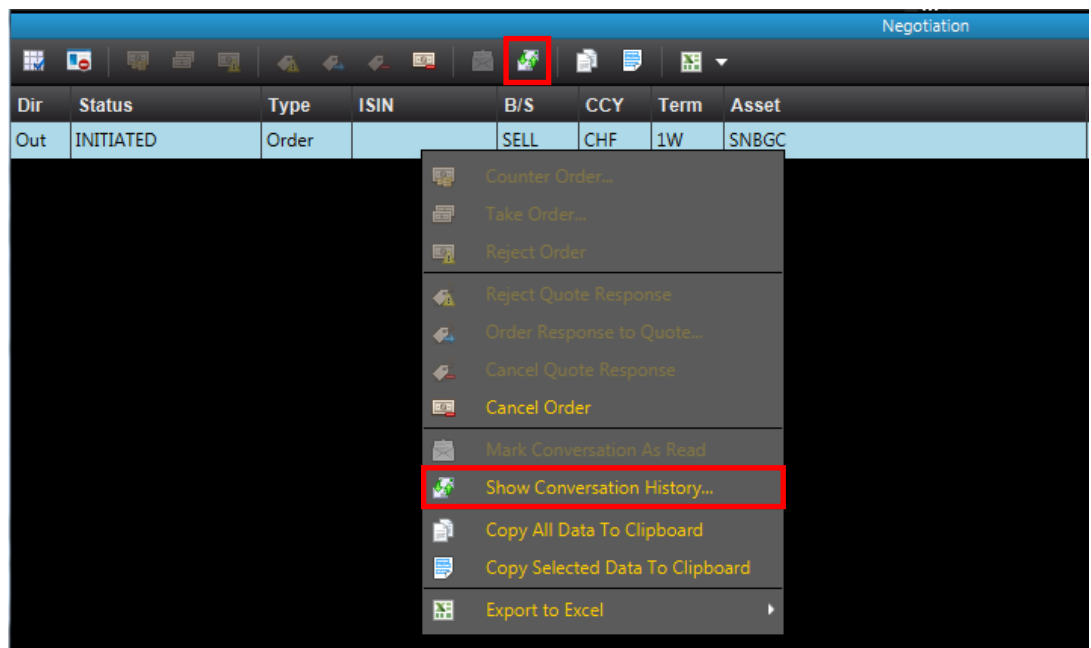
Zur Vereinfachung der Eingabe einer Offer oder eines Order können Templates erstellt werden. Dazu kann nach Eingabe der relevanten Felder im jeweiligen Erfassungsfenster auf das grüne + am unteren Rand geklickt werden.




Nach Eingabe eines Namens und einer Tastenkombination wird das Template erstellt. Dieses kann bei der Erfassung einer neuen Offer bzw. eines neuen Orders entweder mit der Tastenkombination oder durch Auswahl im Dropdown-Menü und klicken der Schaltfläche  abgerufen werden.

4.3.5 Conversation History

Um alle ein- und ausgehenden Meldungen eines bilateralen Handels anzuzeigen, kann mit der rechten Maustaste der jeweiligen Auftrag im Bereich *Negotiation* angeklickt und im Kontext Menu das Symbol für *Show Conversation History* angewählt werden.



Alternativ kann das Symbol  in der Menu Leiste angeklickt werden, wenn der betreffende Auftrag im *Negotiation* Bereich markiert ist.

SIX Repo AG

CO:RE-Handelsplattform

4.4 Executions View

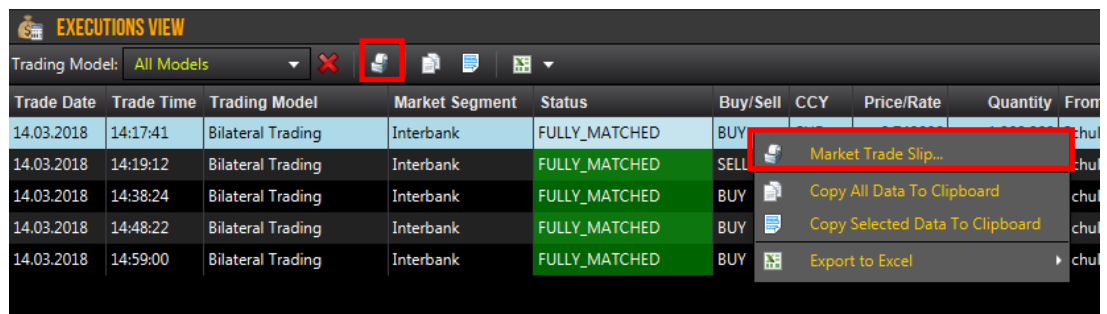
Alle eigenen Geschäfte, welche am aktuellen Tag abgeschlossen wurden, sind in der *Executions View* ersichtlich.




Trade Date	Trade Time	Trading Model	Market Segment	Status	Buy/Sell	CCY	Price/Rate	Quantity	From	To
14.03.2018	14:17:41	Bilateral Trading	Interbank	FULLY_MATCHED	BUY	CHF	-0.740000	1,000,000	Schulungsraum03	Schulungsraum02
14.03.2018	14:19:12	Bilateral Trading	Interbank	FULLY_MATCHED	SELL	CHF	1.000000	5,000,000	Schulungsraum03	Schulungsraum02
14.03.2018	14:38:24	Bilateral Trading	Interbank	FULLY_MATCHED	BUY	CHF	1.100000	10,000,000	Schulungsraum03	Schulungsraum02
14.03.2018	14:48:22	Bilateral Trading	Interbank	FULLY_MATCHED	BUY	CHF	1.000000	1,000,000	Schulungsraum03	Schulungsraum02
14.03.2018	14:59:00	Bilateral Trading	Interbank	FULLY_MATCHED	BUY	CHF	1.000000	3,000,000	Schulungsraum03	Schulungsraum02

4.4.1 Trade Slip anzeigen

Um den Trade Slip eines Geschäfts anzuzeigen, kann mit der rechten Maustaste der jeweiligen Auftrag angeklickt und im Kontext Menu das Symbol für *Market Trade Slip* ausgewählt werden.



Trade Date	Trade Time	Trading Model	Market Segment	Status	Buy/Sell	CCY	Price/Rate	Quantity	From
14.03.2018	14:17:41	Bilateral Trading	Interbank	FULLY_MATCHED	BUY	CHF	-0.740000	1,000,000	Schulungsraum03
14.03.2018	14:19:12	Bilateral Trading	Interbank	FULLY_MATCHED	SELL	CHF	1.000000	5,000,000	Schulungsraum03
14.03.2018	14:38:24	Bilateral Trading	Interbank	FULLY_MATCHED	BUY	CHF	1.100000	10,000,000	Schulungsraum03
14.03.2018	14:48:22	Bilateral Trading	Interbank	FULLY_MATCHED	BUY	CHF	1.000000	1,000,000	Schulungsraum03
14.03.2018	14:59:00	Bilateral Trading	Interbank	FULLY_MATCHED	BUY	CHF	1.000000	3,000,000	Schulungsraum03

Alternativ kann das Symbol  in der Menu Leiste angeklickt werden, wenn der betreffende Auftrag markiert ist.


4.5 Auctions Overview

Die *Auctions Overview* zeigt alle Auktionen an, an welchen der Teilnehmer teilnehmen kann.

AUCTIONS OVERVIEW										
Auctions										
Status	B/S	CCY	Term	Asset	ISIN	Price/Rate	Min Size	Max Size	Announced	Close
ANNOUNCED	SELL	CHF		0 EIDG17 3.8231GMBF	CH0036182316		0	0	15:45:00	

Own Orders										
Auction ID	Timestamp	Status	B/S	CCY	Term	Price/Rate	Quantity	Min	Purchase D...	Repurchase ...

4.5.1 Teilnahme an einer Auktion

Um an einer Auktion teilzunehmen, kann durch klicken mit der rechten Maustasche auf die Auktion der Punkt *Send Auction Order* ausgewählt werden. Optional kann auch in der Menu Zeile das Symbol  ausgewählt werden.

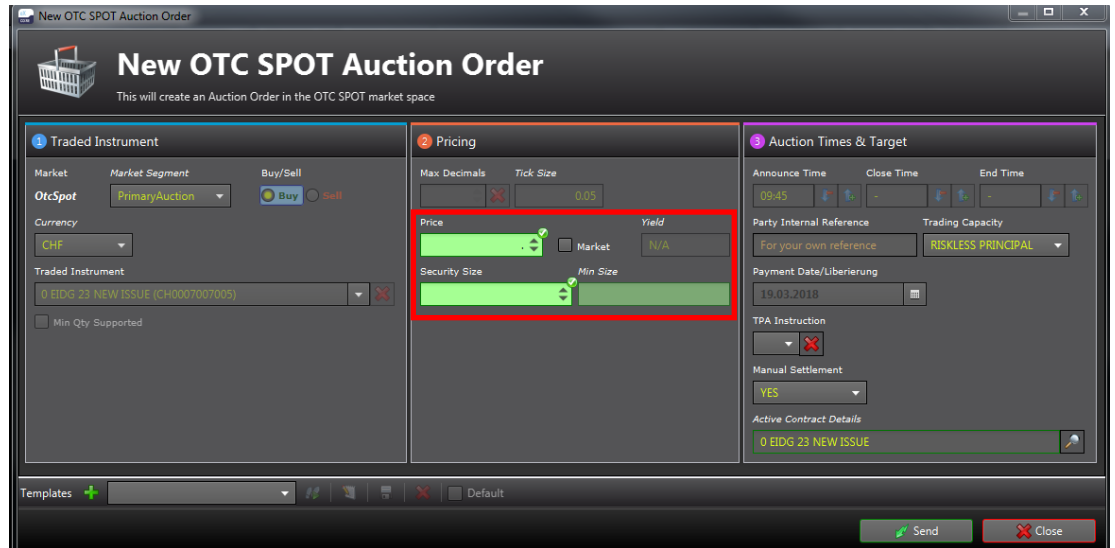
AUCTIONS OVERVIEW										
Auctions										
Status	B/S	CCY	Term	Asset	ISIN	Price/Rate	Min Size	Max Size	Announced	Close
ANNOUNCED	SELL	CHF		0 EIDG17 3.8231GMBF	CH0036182316		0	0	15:45:00	

Auction ID	Timestamp	Status	B/S	CCY	Term	Price/Rate	Quantity	Min	Purchase D...	Repurchase ...
------------	-----------	--------	-----	-----	------	------------	----------	-----	---------------	----------------

Im Fenster New OTC SPOT Auction Order muss der Teilnehmer den Preis und die Anzahl (Security Size) eingeben (wenn der Auktionator keinen Wert eingegeben hat) oder nur die Anzahl, wenn der Auktionator den Preis vorgegeben hat.

SIX Repo AG

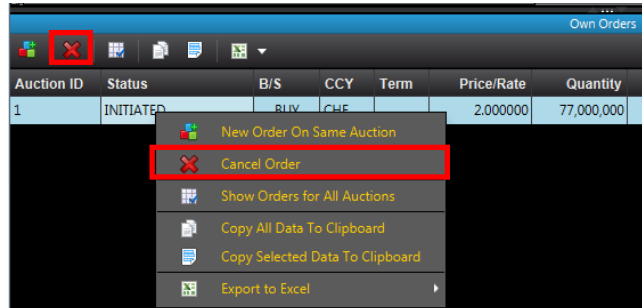
CO:RE-Handelsplattform



Die vom Teilnehmer erfassten Auction Orders werden in der *Auction Overview View* unter *Own Orders* angezeigt.

4.5.2 Auction Order löschen

Der Teilnehmer kann Orders löschen, solange diese den Status «Initiated» haben. Die Löschung erfolgt durch klicken mit der rechten Maustaste auf den Order und dann auf die Option *Cancel Order*.



Alternativ kann das entsprechende Symbol in der Menu Leiste im Bereich *Own Orders* angewählt werden, wenn der Order markiert ist.

4.6 Contract Inventory

Die Ansicht *Contract Inventory* zeigt den aktuellen Status der abgeschlossenen Repo Trades. Es können auch Geschäfte modifiziert oder annulliert werden.

Repo Trades, welche nach erfolgtem Rückkauf den Status «Closed» erreichen, werden in der Ansicht *Contract Inventory* nicht mehr angezeigt. Es ist keine Trade History verfügbar, diese kann via Reports bei SIX Repo AG aufgesetzt und bezogen werden.

4.7 Online Hilfe

Im Rahmen dieses Dokuments werden nur die wichtigsten Views und Funktionen beschrieben. Für weitere Informationen steht die Online Hilfe zur Verfügung. Diese kann in jeder Ansicht über das Hilfe Symbol aufgerufen werden.



Alternativ ist die Online Hilfe auch über den Menu Punkt Help > Online Help erreichbar.

SIX Repo AG
Pfingstweidstrasse 110
CH-8005 Zürich

Postanschrift:
Postfach
CH-8021 Zürich

T +41 58 399 2190
F +41 58 499 2488
www.six-group.com

