

Programme de révision pour les années impaires (points à contrôler annuellement et principaux axes règles de négoce):

Point de contrôle	Référence au guide	Description	Type de rapport
Admission des traders	Ch. 3.3.1.4	<ul style="list-style-type: none"> Il s'agit de vérifier que la reconstitution de la suppléance soit assurée et le cas échéant comment elle est assurée ? 	Oui / Non
Systèmes techniques	Ch. 3.3.2.1	<ul style="list-style-type: none"> Il s'agit de vérifier si chaque système technique peut être attribué à un numéro d'identification d'un trader enregistré. 	Descriptif
Clients avec accès direct au marché (Direct Electronic Access; DEA)	Ch. 3.3.4.1	<ul style="list-style-type: none"> Il s'agit de vérifier que le participant possède les systèmes appropriés lui permettant de surveiller et de filtrer les ordres émanant de « clients DEA », et dans l'affirmative de déterminer les critères qui seront appliqués. 	Descriptif
	Ch. 3.3.4.2	<ul style="list-style-type: none"> Il s'agit de vérifier que le participant a la possibilité technique d'arrêter les ordres des clients DEA. 	Descriptif
Transmission des informations du marché	Ch. 3.3.5	<ul style="list-style-type: none"> Il s'agit de vérifier si, Il s'agit de vérifier dans le cadre de la révision si, et le cas échéant, dans quelle mesure des informations du marché sont diffusées à des tiers extérieurs à l'établissement, et si cette transmission s'effectue en conformité avec les dispositions de SIX Swiss Exchange / Scoach Suisse et de la société affiliée, SIX Exfeed. Il s'agit en outre de vérifier que le nombre d'utilisateurs «real time» et d'autres services assujettis au versement d'une redevance nécessaire au calcul des taxes sur les cours boursiers (exchange fees) soient déclarés correctement, conformément aux tarifs SIX Exfeed en vigueur. 	Descriptif
Transactions fictives	Ch. 3.3.7	<ul style="list-style-type: none"> Il s'agit de contrôler la façon dont le participant veille à prévenir toute transaction fictive ou ordre fictive. Il convient notamment de vérifier les mesures prises par le participant pour empêcher les ordres réciproques passés pour compte propre (nostro) par le participant ou les ordres réciproques passés pour le compte du même client (notamment pour les «clients DEA»). Si des infractions ont été constatées durant l'exercice, il convient de détailler les mesures prises et leurs motifs. 	Descriptif
Obligation de traiter en bourse	Ch. 3.3.8.1	<ul style="list-style-type: none"> D'une part, il s'agit de vérifier si, concernant les transactions hors bourse en deçà des limites prescrites, le moment de conclusion effective de la transaction correspond à celui annoncé à la SIX Swiss Exchange / Scoach Suisse. D'autre part, il convient de contrôler si les transactions hors bourse en deçà des limites prescrites ont bien été effectuées après la clôture du négoce. 	Descriptif

Point de contrôle	Référence au guide	Description	Type de rapport
	Ch. 3.3.8.2	<ul style="list-style-type: none"> Il s'agit de vérifier que lors de la saisie d'ordres groupés et de «Portfolio Trades», ceux-ci se présentent effectivement à la définition donnée par le cadre réglementaire en vigueur et s'ils ont marqués avec le Trade Type Code « D » si le prix diverge du prix de marché au moment de l'annonce. 	Descriptif
Obligation d'annoncer les transactions	Ch. 3.3.10.1	<ul style="list-style-type: none"> Il s'agit de vérifier que les transactions soumises à l'obligation de déclarer soient déclarées correctement et entièrement à la bourse ou à l'instance pour les déclarations. 	Descriptif
	Ch. 3.3.10.2	<ul style="list-style-type: none"> Il s'agit de vérifier que le délai de déclaration prescrit à compter de la conclusion d'une transaction soit respecté, eu égard aux transactions boursières hors carnet d'ordres. 	Descriptif
	Ch. 3.3.10.3	<ul style="list-style-type: none"> Il s'agit de vérifier que les transactions boursières dans le carnet d'ordres et hors carnet d'ordres soient correctement identifiées (Agent, Nostro, D, DR). 	Descriptif
	Ch. 3.3.10.4	<ul style="list-style-type: none"> Il s'agit de vérifier dans le cadre de la révision que la fonctionnalité utilisée lors de l'annonce de transactions boursières hors carnet d'ordres soit correcte. 	Descriptif
	Ch. 3.3.10.5	<ul style="list-style-type: none"> Il s'agit de vérifier la correspondance entre les saisies dans le journal et les annonces faites par le participant à la SIX Swiss Exchange / Scoach Suisse. 	Descriptif

Les points de contrôle qui ont donné lieu à des observations l'année précédente doivent être une nouvelle vérifiés un à un l'année suivante chez le participant concerné. Veuillez consigner les résultats y relatifs dans le rapport de révision.