



Règlement complémentaire de cotation des Exchange Traded Products

Règlement complémentaire Exchange Traded Products, RCETP
du 16 janvier 2024
Entrée en vigueur: 1^{er} avril 2024

Table des matières

I	But et champ d'application.....	4
Art. 1	Objet	4
Art. 2	Renvoi au RC	4
Art. 3	Champ d'application	4
II	Cotation	5
A	Conditions de cotation	5
1	Exigences relatives à l'émetteur	5
Art. 4	Durée, dotation en capital et comptes annuels	5
Art. 5	For juridique	5
2	Exigences relatives aux Exchange Traded Products.....	5
Art. 6	Droit applicable	5
Art. 6a	Besoin d'ETP sans échéance	5
Art. 7	Capitalisation minimale de l'émission.....	6
Art. 8	Sous-jacents	6
Art. 9	Droits de participation, emprunts et placements collectifs de capitaux en tant que sous-jacents ...	6
Art. 10	Instruments dérivés et futures en tant que sous-jacents.....	6
Art. 11	Indices en tant que sous-jacents	6
Art. 12	Devises, taux de référence, métaux précieux et matières premières en tant que sous-jacents.....	7
Art. 12a	Les crypto-actifs en tant que sous-jacents.....	7
Art. 13	Baskets en tant que sous-jacents	7
Art. 14	Garantie par nantissement.....	7
B	Devoirs en vue de la cotation	8
Art. 15	Prospectus selon la LSFIn.....	8
Art. 15a	Déclaration de conformité.....	8
Art. 16	Forme du prospectus de cotation (supprimé)	9
Art. 17	Possibilités d'intégrer des références («incorporation by reference») (supprimé).....	9
Art. 18	Satisfaction des conditions par le donneur de sûretés	9
Art. 19	Market making	9
III	Conditions pour le maintien de la cotation.....	9
Art. 20	Établissement de rapports périodiques	9
Art. 21	Autres devoirs d'information, faits soumis au devoir d'annonce	9
Art. 22	Forme des annonces	9
Art. 23	Publication selon conditions	10
Art. 24	Informations officielles	10
Art. 25	Publication et diffusion de l'annonce par SIX Exchange Regulation.....	10

Art. 26	Satisfaction des conditions par le donneur de sûretés	10
IV	Exceptions	11
Art. 27	Octroi des exceptions	11
V	Expiration de la cotation	11
Art. 28	Expiration de la cotation et suspension du négoce	11
VI	Tarifification	11
Art. 29	Renvoi au RC	11
VII	Dispositions finales	11
Art. 30	Modification du Règlement de cotation (supprimé)	11
Art. 31	Modification des Directives (supprimé)	11
Art. 32	Modification du Tarif relatif au Règlement de cotation (supprimé)	11
Art. 33	Entrée en vigueur	11
Art. 33a	Dispositions transitoire	12
Art. 34	Révision	12
Annexe – Devoirs d'annonce dans le cadre du maintien de la cotation des Exchange Traded Products		13

I But et champ d'application

Art. 1 Objet

¹ Le présent Règlement complémentaire détermine les informations à fournir pour permettre l'évaluation des caractéristiques des Exchange Traded Products (ETP) et de la qualité de leurs émetteurs.

² Il stipule par ailleurs les indications supplémentaires à fournir par les émetteurs pendant la durée de la cotation dans le cadre des devoirs liés au maintien de la cotation afin de permettre un négoce ordonné.

Art. 2 Renvoi au RC

¹ Le Règlement de cotation (RC) et ses décrets d'application s'appliquent à la cotation des ETP dans la mesure où les conditions spéciales ci-dessous n'y dérogent pas ou ne posent pas d'exigences supplémentaires.

² Les dispositions de: art. 13 RC (Organes de révision), art. 14 RC (Rapport de révision), art. 15 RC (Dotation en capital) et art. 19 RC (Contenu du prospectus de cotation) ne sont pas applicables.

Art. 3 Champ d'application

¹ Le présent Règlement complémentaire s'applique à tous les ETP émis par des émetteurs suisses et étrangers qui sont cotés auprès de SIX Swiss Exchange AG («SIX Swiss Exchange») conformément aux présentes dispositions.

² Sont considérés comme ETP au sens du présent Règlement complémentaire les droits de créance au porteur, garantis et non rémunérés (titres obligataires),

1. émis en tant que valeurs mobilières et
2. pouvant être vendus et rachetés en continu avec les mêmes structures et coupures et
3. reproduisant à l'identique ou avec un effet de levier l'évolution du cours d'une valeur sous-jacente (certificat tracker).

³ Ne font pas partie du champ d'application du présent Règlement complémentaire les Exchange Traded Funds (ETF) et les Exchange Traded Structured Funds (ETSF). Contrairement aux ETF et aux ETSF, les Exchange Traded Products **ne sont pas des placements collectifs de capitaux** au sens de la Loi fédérale du 23 juin 2006 sur les placements collectifs de capitaux (LPCC). Les ETP ne sont pas soumis à l'autorisation ni à la surveillance de l'Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers (FINMA).

⁴ Ne font pas partie du champ d'application du présent Règlement complémentaire les dérivés (certificats) garantis par des COSI® (Collateral Secured Instruments).

Voir également:

- Loi fédérale du 23 juin 2006 sur les placements collectifs de capitaux (Loi sur les placements collectifs, LPCC)

II Cotation

A Conditions de cotation

1 Exigences relatives à l'émetteur

Art. 4 Durée, dotation en capital et comptes annuels

¹ Le premier jour de négoce, le capital propre publié de l'émetteur devra être d'au moins 25 millions CHF, conformément au référentiel comptable appliqué.

² Si l'émetteur est la société faîtière d'un groupe, on se réfère au montant du capital propre consolidé.

³ L'art. 11 RC (Durée) et l'art. 4 al. 1 et 2 ne sont pas applicables lorsque le montant d'ETP en circulation est exclusivement garanti selon l'Art. 14, al. 1 ch. 1 ou ch. 1^{bis} ou lorsqu'un tiers satisfaisant aux conditions d'admission (donneur de sûretés) fournit, à la place de l'émetteur, un engagement de garantie pour les obligations liées aux ETP.

⁴ Dans la mesure où selon l'al. 1, l'art. 11 RC (Durée) n'est pas applicable, l'émetteur ne doit avoir présenté en conformité avec les normes comptables auxquelles il est assujéti que les comptes annuels disponibles.

Voir également:

- Directive Engagements de garantie (DEG)
- Directive Présentation des comptes (DPC)

Art. 5 For juridique

¹ Les investisseurs doivent avoir la faculté de faire valoir leurs droits contre les participants à la structure de l'ETP (par ex. l'émetteur, le dépositaire des sûretés) devant un tribunal étatique.

² Lors du choix du for, l'émetteur doit faire en sorte qu'il existe au moins en alternative un tribunal compétent dans l'État dont le droit est applicable aux conditions de l'émission respective.

2 Exigences relatives aux Exchange Traded Products

Art. 6 Droit applicable

¹ Peuvent être cotés auprès de SIX Swiss Exchange tous les ETP soumis au droit suisse.

² Les ETP dont les conditions sont soumises à un droit étranger ne peuvent être cotés auprès de SIX Swiss Exchange que si la législation étrangère applicable est reconnue par le Regulatory Board. Cette catégorie comprend les législations des États membres de l'OCDE.

³ Sur demande, le Regulatory Board peut reconnaître d'autres systèmes juridiques étrangers si le requérant établit qu'ils sont conformes aux standards internationaux reconnus en matière de protection des investisseurs et de transparence.

Art. 6a Besoin d'ETP sans échéance

Les conditions du produit doivent impérativement prévoir un droit de remboursement pour les détenteurs d'ETP sans échéance fixe, ainsi qu'un droit de résiliation pour l'émetteur. Le droit de résiliation de

l'émetteur doit notamment lui permettre de mettre fin à l'ETP si les conditions de cotation à respecter pendant toute la durée ne sont plus remplies.

Art. 7 Capitalisation minimale de l'émission

Au moment du dépôt de la requête d'admission, les ETP doivent présenter une capitalisation minimale de CHF 1 million.

Art. 8 Sous-jacents

¹ Ne sont admissibles à la cote que les ETP reposant sur un titre sous-jacent approuvé par le Regulatory Board aux sens des Art. 9–13, dont les prix ou les cours sont établis régulièrement et qui sont accessibles au public.

² Le Regulatory Board peut autoriser d'autres titres sous-jacents.

Art. 9 Droits de participation, emprunts et placements collectifs de capitaux en tant que sous-jacents

¹ Sont admissibles en tant que titres sous-jacents pour les ETP, les droits de participation cotés auprès de SIX Swiss Exchange ou d'une autre bourse de valeurs mobilières ou admis au négoce comme les actions, les bons de participation et les bons de jouissance. Sont également admissibles en tant que sous-jacents les emprunts et placements collectifs de capitaux cotés auprès de SIX Swiss Exchange ou d'une bourse de valeurs mobilières étrangère dotée d'une réglementation équivalente. Les placements collectifs de capitaux doivent cependant être conformes aux dispositions de la LPCC et à ses dispositions d'exécution.

² Sont reconnues comme bourses de valeurs mobilières étrangères à réglementation équivalente les bourses membres à part entière de la Federation of European Securities Exchanges (FESE) ou de la World Federation of Exchanges (WFE). D'autres bourses peuvent être reconnues comme possédant une réglementation équivalente. Le Regulatory Board peut exiger que l'émetteur apporte la preuve d'une réglementation équivalente.

Voir également:

- Loi fédérale du 23 juin 2006 sur les placements collectifs de capitaux (Loi sur les placements collectifs, LPCC)
- Site de la Federation of European Securities Exchanges
- Page d'accueil de la World Federation of Exchanges

Art. 10 Instruments dérivés et futures en tant que sous-jacents

¹ Sont admissibles en tant qu'ETP tous les instruments dérivés cotés auprès de SIX Swiss Exchange ou admis au négoce.

² Sont également admissibles les contrats d'options et à terme (futures) standardisés admis auprès d'une bourse dotée d'une réglementation équivalente. D'autres bourses peuvent obtenir la reconnaissance sur demande. Le Regulatory Board peut exiger que l'émetteur apporte la preuve d'une réglementation équivalente.

Art. 11 Indices en tant que sous-jacents

Les indices sont admissibles en tant que sous-jacents pour les ETP dans la mesure où l'émetteur assure le respect de toutes les exigences suivantes:

1. l'indice est composé de titres sous-jacents autorisés au sens du présent Règlement complémentaire;

2. le sponsor de l'indice dispose d'un règlement de l'indice accessible gratuitement sur Internet; l'émetteur doit remettre le règlement en question aux investisseurs intéressés sans frais, sur simple demande et sans qu'ils aient à prouver un intérêt particulier.
3. l'indice sera publié à intervalles réguliers, mais au moins une fois par mois, et sera accessible gratuitement sur Internet; l'émetteur devra indiquer aux investisseurs intéressés le niveau de l'indice le plus récemment publié, sans frais, sur simple demande et sans qu'ils aient à prouver un intérêt particulier.

Art. 12 Devises, taux de référence, métaux précieux et matières premières en tant que sous-jacents

Sont admissibles en tant que titres sous-jacents pour les ETP les taux de référence suivants:

1. les devises librement convertibles: il est possible de renoncer à l'exigence de la libre convertibilité lorsque le remboursement en devises non librement convertibles est exclu;
2. les taux d'intérêt et de swap habituels comme le SARON ou SONIA, exception faite des fixing officiels (accord entre deux parties, par exemple);
3. les métaux précieux, notamment l'or, l'argent, le platine et le palladium;
4. les matières premières négociées par une bourse reconnue par le Regulatory Board et dont les cours au comptant sont publiés.

Art. 12a Les crypto-actifs en tant que sous-jacents

¹ Les crypto-actifs sont autorisés en tant que sous-jacents pour les ETP.

² Les crypto-actifs sont des actifs (coins ou tokens) qui passent par une technologie des registres distribués (TRD).

³ Les crypto-actifs ne sont pas autorisés en tant que sous-jacents s'ils

- rendent possibles des transactions privées et anonymes dans la blockchain («privacy coins») ou
- peuvent être qualifiés de tokens d'investissement ou d'investissement hybride, tant qu'ils représentent, dans leur fonction économique, un droit de participation.

⁴ Les détails techniques ainsi que les autres exigences figurent dans la Directive concernant les crypto-assets en tant que sous-jacents.

Voir également:

- Directive Crypto-actifs en tant que sous-jacents (DCA)
- Guide pratique pour les questions d'assujettissement concernant les initial coin offerings (ICO) de l'Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers FINMA du 16 février 2018

Art. 13 Baskets en tant que sous-jacents

Les baskets mentionnés dans les Art. 9–12a sont admissibles en tant que sous-jacents pour les ETP.

Art. 14 Garantie par nantissement

¹ Les ETP sont garantis comme suit:

1. par le sous-jacent ou par le dépôt physique du sous-jacent servant de garantie, ou sous forme d'un contrat à terme; ou

¹^{bis}. avec des crypto-assets en tant que sous-jacents, en incorporant le droit à la restitution du sous-jacent; ou

2. par des actions, bons de participation, bons de jouissance, placements collectifs de capitaux, emprunts et matières premières cotés de façon liquide ou admis au négoce auprès de la SIX Swiss Exchange ou d'une bourse étrangère dotée d'une réglementation équivalente; ou
3. par des avoirs en liquide ou des métaux précieux.

² La garantie doit couvrir au minimum le montant en circulation des ETP.

³ Les actifs qui servent de garantie sont conservés par une tierce partie indépendante de l'émetteur, sur mandat de ce dernier.

⁴ Si les actifs servant de garantie sont des crypto-assets, les exigences suivantes doivent être respectées:

1. Le dépositaire doit tenir les actifs à la disposition de l'émetteur à tout moment, ceux-ci pouvant lui être attribués personnellement, ou à une communauté. La part des actifs de la communauté revenant à l'émetteur doit être clairement indiquée.
2. Sont admis comme dépositaires:
 - a) les dépositaires au sens de l'art. 4 al. 2 de la loi fédérale du 3 octobre 2008 sur les titres intermédiaires (LTI), ou une personne selon l'art. 1b LB;
 - b) les établissements étrangers soumis au contrôle d'une autorité équivalente.

⁵ Le Regulatory Board peut exiger la présentation des documents appropriés attestant du statut réglementaire du dépositaire de crypto-assets.

⁶ Si le dépositaire de crypto-assets ne satisfait pas aux exigences de l'al. 4, l'émetteur ou le donneur de sûretés qui fournit un engagement de garantie conformément à la directive relative aux engagements de garantie (DEG) doit être une banque au sens de la LB, une assurance au sens de la LSA, une maison de titres au sens de la LEFin, ou un établissement étranger soumis au contrôle prudentiel d'une autorité équivalente.

B Devoirs en vue de la cotation

Art. 15 Prospectus selon la LSFIn

¹ Dans la requête de cotation, l'émetteur doit en principe apporter la preuve qu'il dispose d'un prospectus qui a été approuvé par un organe de contrôle selon la LSFIn ou qui est réputé approuvé conformément à la LSFIn, et, surtout, qui présente la sécurité et les risques encourus. SIX Exchange Regulation peut dispenser l'émetteur de l'obligation de fournir cette preuve, à condition que cette information puisse être obtenue automatiquement et sous forme électronique auprès de l'organe de contrôle compétent.

² S'il est dispensé de l'obligation d'établir un prospectus conformément à LSFIn, cela doit être expliqué dans la requête de cotation.

Art. 15a Déclaration de conformité

¹ L'émetteur doit joindre à la requête de cotation une déclaration écrite par laquelle il garantit que:

1. lui-même ou le donneur de sûretés est une banque au sens de la LB, une assurance au sens de la LSA, une maison de titres au sens de la LEFin, ou un établissement étranger soumis au contrôle prudentiel d'une autorité équivalente, ou qu'une garantie par nantissement au sens de l'art. 70 al. 2 let. b LSFIn est assurée;
2. si applicable, que le dépositaire conserve les actifs servant de garantie au nom de l'émetteur, et qu'il est un dépositaire au sens de l'art. 14 al. 4; et,

3. si applicable, que le dépositaire tient les actifs servant de garantie à disposition à tout moment au sens de l'art. 14 al. 4, que ceux-ci peuvent être attribués à l'émetteur, ou à une communauté, et que la part des actifs de la communauté revenant à l'émetteur est clairement indiquée.

² Il appartient exclusivement à l'émetteur de déterminer si une garantie par nantissement au sens de l'art. 70 al. 2 let. b LSFIn est assurée.

Art. 16 Forme du prospectus de cotation (supprimé)

(supprimé)

Art. 17 Possibilités d'intégrer des références («incorporation by reference») (supprimé)

(supprimé)

Art. 18 Satisfaction des conditions par le donneur de sûretés

Tous les devoirs sont à remplir tant par l'émetteur que par le donneur de sûretés.

Art. 19 Market making

¹ L'émetteur est tenu de s'engager envers la Bourse à garantir un marché pour les ETP correspondants (market maker).

² La Bourse peut édicter des dispositions d'exécution concernant le market making.

III Conditions pour le maintien de la cotation

Art. 20 Établissement de rapports périodiques

¹ L'art. 50 RC (Rapports intermédiaires) ne s'applique pas aux cotations selon le présent Règlement complémentaire.

² Le total des taxes perçues pendant un exercice en pourcentage de la valeur intrinsèque (NAV) doit être annoncé au marché en même temps que la publication du rapport annuel sous la forme d'une «Information officielle». Le Regulatory Board peut édicter des prescriptions concernant le calcul de la valeur intrinsèque (NAV).

Art. 21 Autres devoirs d'information, faits soumis au devoir d'annonce

¹ L'art. 52 RC (Calendrier d'entreprise) ne s'applique pas aux cotations selon le présent Règlement complémentaire.

² Les émetteurs doivent s'acquitter de devoirs d'annonce réguliers dans le cadre des devoirs d'annonce. L'Annexe précise quelle est l'annonce à faire, à quel moment et sous quelle forme, quelles sont les exigences en matière de contenu et sous quelle forme SIX Exchange Regulation AG («SIX Exchange Regulation») doit, le cas échéant, publier une annonce.

Art. 22 Forme des annonces

¹ Pour certains types d'annonces, SIX Exchange Regulation propose des formulaires ou masques de saisie standardisés qui permettent aux émetteurs de remplir leurs devoirs d'annonce.

² Chaque annonce doit indiquer bien en évidence le nom de l'émetteur, le titre concerné ainsi que l'expéditeur de l'annonce (nom du responsable avec numéro de téléphone et adresse e-mail pour

d'éventuelles questions). Elle doit en outre spécifier la nature de l'événement à annoncer auquel elle se réfère (indication du chiffre correspondant selon l'Annexe).

Voir également:

- Formulaires Devoirs d'annonce

Art. 23 Publication selon conditions

Si l'événement à annoncer est soumis à la règle de «Publication selon conditions», il doit être publié conformément aux modalités figurant dans le prospectus selon la LSFIn.

Art. 24 Informations officielles

¹ Si l'événement à annoncer doit être diffusé au moyen d'une «Information officielle», l'émetteur est tenu de faire parvenir le texte de cette «Information officielle» à SIX Exchange Regulation par voie électronique dans les plus brefs délais, mais au plus tard - sauf disposition contraire - d'ici 11h00 heure d'Europe centrale (HEC) le jour de bourse précédant la date de parution désirée. Une «Information officielle» ne remplace pas la publication d'un communiqué événementiel, qui reste nécessaire.

² Dans les cas urgents, il est recommandé d'aviser préalablement SIX Exchange Regulation par téléphone. Il faut en outre lui communiquer la date de parution souhaitée.

³ SIX Swiss Exchange peut prévoir d'autres possibilités pour l'élaboration et l'envoi des «Informations officielles» (par ex. au moyen d'applications basées web).

⁴ Pour des raisons inhérentes aux moyens de publication de SIX Exchange Regulation, les «Informations officielles» doivent être soumises sous forme de textes non formatés (c'est-à-dire de documents «Note-pad» ou équivalents).

⁵ Lors de la diffusion des «Informations officielles», SIX Swiss Exchange n'effectue aucun changement au niveau du contenu. L'émetteur porte l'entière responsabilité du contenu de ces informations.

⁶ Les «Informations officielles» sont publiées:

- le «Newsboard» du système de négoce de SIX Swiss Exchange (à l'intention des opérateurs);
- par e-mail aux personnes intéressées;
- via Internet (www.six-group.com/en/products-services/the-swiss-stock-exchange.html et www.ser-ag.com/fr/home.html) sous forme d'«Informations officielles».

Art. 25 Publication et diffusion de l'annonce par SIX Exchange Regulation

¹ SIX Exchange Regulation peut aussi bien traiter les données transmises que les publier et les diffuser via Internet ou d'autres médias appropriés.

² Les informations qui, au moment de leur remise à SIX Exchange Regulation, requièrent encore un traitement confidentiel ou dont la publication doit être reportée, doivent comporter une mention claire en ce sens («Confidentiel»/«Publication soumise à accord préalable», etc.). Il est en outre impératif de préciser la date et l'heure à partir desquelles l'information peut être publiée. À défaut, SIX Exchange Regulation ne pourra en garantir la confidentialité.

Art. 26 Satisfaction des conditions par le donneur de sûretés

Les conditions du maintien de la cotation doivent être remplies aussi bien par l'émetteur que par le donneur de sûretés.

IV Exceptions

Art. 27 Octroi des exceptions

Le Regulatory Board peut accorder des dérogations aux dispositions du présent Règlement complémentaire ainsi qu'aux décrets d'exécution du Règlement de cotation et du Règlement complémentaire.

V Expiration de la cotation

Art. 28 Expiration de la cotation et suspension du négoce

¹ Lorsqu'un ETP arrive à échéance, sa cotation est supprimée sans publication préalable par la SIX Swiss Exchange.

² Le Regulatory Board peut, sur demande de l'émetteur ou de sa propre initiative, suspendre temporairement le négoce d'ETP si les conditions de cotation à respecter pendant toute la durée ne sont plus remplies, et ce, notamment quand le dépositaire perd l'autorisation requise en vertu de l'art. 14 al. 4.

³ Lorsque la suspension du négoce a été maintenue pendant trois mois et que les motifs à l'origine de cette mesure n'ont pas disparu, le Regulatory Board décote les ETP concernés.

VI Tarification

Art. 29 Renvoi au RC

La réglementation relative aux émoluments est régie par l'art. 63 RC.

Voir également:

- Tarif relatif au Règlement de cotation
- Tarif relatif OrgRég (TRO)

VII Dispositions finales

Art. 30 Modification du Règlement de cotation (supprimé)

(supprimé)

Art. 31 Modification des Directives (supprimé)

(supprimé)

Art. 32 Modification du Tarif relatif au Règlement de cotation (supprimé)

(supprimé)

Art. 33 Entrée en vigueur

Le présent Règlement complémentaire a été approuvé par l'Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers le 7 octobre 2010 et entre en vigueur le 15 octobre 2010.

Art. 33a Dispositions transitoire

¹ Les dispositions transitoires selon art. 116a et 116b RC sont applicables mutatis mutandis.

² Les ETP déjà cotés à la SIX Swiss Exchange demeurent cotés. Les émetteurs d'ETP cotés avant l'entrée en vigueur de la révision des art. 14, 15, 28, 33a et de l'annexe, et de l'acte législatif relatif aux art. 6a et 15a, doivent, dans un délai de transition de 6 mois, déposer une déclaration au sens de l'art. 15a, et, si applicable, satisfaire aux exigences de l'art. 14 al. 4 ou 6. Si ces exigences ne sont pas satisfaites et que la déclaration n'est pas déposée dans le délai de transition, la cotation de l'ETP concerné sera exceptionnellement supprimée.

Art. 34 Révision

¹ La révision des art. 2 et 4 promulguée par décision du Regulatory Board du 6 mai 2015 et approuvée le 9 juin 2015 par l'Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers FINMA entre en vigueur le 1^{er} août 2015.

² La révision de l'art. 21 et la promulgation du nouveau Titre VI promulguée par décision du Regulatory Board du 4 avril 2018 et approuvée le 30 avril 2018 par l'Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers FINMA entrent en vigueur le 1^{er} mai 2018.

³ La révision de l'art. 31.3 sur décision du Regulatory Board du 14 décembre 2018 et approuvée le 25 février 2019 par l'Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers FINMA entre en vigueur le 2 mai 2018.

⁴ La révision des arts. 2, 4, 15, 18 et 23 et l'annexe, la suppression des arts. 16, 17, 30 et 31 ainsi que la promulgation de l'art. 33a, promulguées par décision du Regulatory Board du 11 juillet 2019, approuvées le 14 novembre 2019 par l'Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers FINMA, entrent en vigueur le 2 janvier 2020.

⁵ La révision de l'annexe promulguée par décision du Regulatory Board du 9 mars 2020 et approuvée le 14 mai 2020 par l'Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers FINMA entre en vigueur le 22 juin 2020.

⁶ La révision des art. 4, 12-15, 28, 33a et de l'annexe ainsi que la promulgation des art. 6a, 12a et 15a, promulguées par décision du Regulatory Board du 16 janvier 2024 et approuvée le 26 octobre 2023 par l'Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers FINMA entrent en vigueur le 1^{er} avril 2024.

Annexe – Devoirs d'annonce dans le cadre du maintien de la cotation des Exchange Traded Products

Devoirs d'annonce dans le cadre du maintien de la cotation des Exchange Traded Products

Chiffre	Événement à annoncer	Délai d'annonce	Exigences	Type de communiqué à SIX Exchange Regulation	Type de publication par SIX Swiss Exchange
1	Informations générales sur l'émetteur et le donneur de sûretés				
1.01	Changement de raison sociale	Dans les cinq jours de bourse suivant l'inscription au registre du commerce ou l'entrée en vigueur du changement	<ul style="list-style-type: none"> – Ancien/nouveau nom; ancienne/nouvelle adresse Internet – Ancien/nouveau symbole ticker; n° de valeur/code ISIN – Date à laquelle le changement en bourse doit intervenir 	Information officielle par e-mail à: reporting-obligations@six-group.com	– Information officielle
1.02	Changement d'adresse du siège principal	Dans les cinq jours de bourse suivant l'inscription au registre du commerce ou l'entrée en vigueur du changement	<ul style="list-style-type: none"> – Nom; adresse; case postale; n° de tél. – Copie de l'extrait du registre du commerce 	Information officielle par e-mail à: reporting-obligations@six-group.com	-
1.03	Changement d'émetteur/de donneur de sûretés	Cinq jours de bourse avant l'entrée en vigueur du changement	<ul style="list-style-type: none"> – N° de valeur, code ISIN – Date du changement – Indications sur le nouvel émetteur (en joignant un rapport annuel) – Indications sur le maintien de la convention de garantie, si disponibles 	Information officielle par e-mail à: listing@six-group.com	<ul style="list-style-type: none"> – Information officielle – Publication selon conditions

Chiffre	Événement à annoncer	Délai d'annonce	Exigences	Type de communiqué à SIX Exchange Regulation	Type de publication par SIX Swiss Exchange
1.04	Changement de l'organe de révision	Dans les cinq jours suivant l'inscription au registre du commerce	<ul style="list-style-type: none"> - Nom/raison sociale; pays du domicile; numéro de registre de l'autorité de surveillance en matière de révision - Motif du changement de l'organe de révision (en précisant si la démission a été déclarée par l'organe de révision ou s'il existe d'éventuels désaccords qui n'ont pas été résolus entre l'émetteur et l'organe de révision) - Copie de l'extrait du registre du commerce 	Information officielle par e-mail à: reporting-obligations@six-group.com	- Information officielle
1.05	Changement de la norme comptable	Dans les cinq jours de bourse suivant la publication du rapport de gestion	- Conformément à: l'art. 7 Directive Présentation des comptes	Information officielle par e-mail à: reporting-obligations@six-group.com	- Information officielle
1.06	Changement de la norme d'audit	Dans les cinq jours de bourse suivant la publication du rapport de gestion		Information officielle par e-mail à: reporting-obligations@six-group.com	- Information officielle
1.07	Comptes annuels et taxes perçues	Au moment de la publication, ou au plus tard dans le délai stipulé dans les art. 10 Directive Présentation des comptes	- Comptes annuels sous forme de fichier pdf électronique	Par e-mail à: reporting-obligations@six-group.com	-
			- Lien vers les rapports annuels et intermédiaires publiés selon art. 13 Directive Présentation des comptes	Par e-mail à: reporting-obligations@six-group.com	-

Chiffre	Événement à annoncer	Délai d'annonce	Exigences	Type de communiqué à SIX Exchange Regulation	Type de publication par SIX Swiss Exchange
			– Indications sur les taxes perçues selon art. III Art. 202, al. 2	Information officielle par e-mail à: listing@six-group.com	– Information officielle
1.08	Changements d'interlocuteurs (Président du conseil d'administration, CEO, CFO, Head of Investor Relations) dans la mesure où l'émetteur est organisé corporativement	Au moment du changement	– Nom; prénom; adresse – Tél. (ligne directe) – Adresse e-mail (directe) – Adresse e-mail (team)	Formulaire: «Annonce Contacts»	-
1.09	Changements d'interlocuteurs pour la publicité événementielle, dans la mesure où la Directive concernant la publicité événementielle (DPE) s'applique à l'émetteur	Au moment du changement	– Nom; prénom; adresse – Tél. (ligne directe) – Adresse e-mail (directe) – Adresse e-mail (team)	Formulaire: «Annonce Contacts»	-
1.10	Changements d'interlocuteurs pour les devoirs d'annonce	Au moment du changement	– Nom; prénom; adresse – Tél. (ligne directe) – Adresse e-mail (directe) – Adresse e-mail (team)	Formulaire: «Annonce Contacts»	-
1.11	Changement du lien pour l'inscription à la liste de diffusion électronique (<i>Subscription</i>) selon art. 8 Directive Publicité événementielle (système push)	Au moment du changement	Nouveau lien	Par e-mail à: reporting-obligations@six-group.com	-
1.12	Changement du chemin permettant d'accéder au répertoire des annonces événementielles selon art. 9 Directive Publicité événementielle (système pull)	Au moment du changement	Nouveau lien	Par e-mail à: reporting-obligations@six-group.com	-

Chiffre	Événement à annoncer	Délai d'annonce	Exigences	Type de communiqué à SIX Exchange Regulation	Type de publication par SIX Swiss Exchange
2	Informations générales sur les participants de la structure				
2.01	Changement de raison sociale	Dans les cinq jours de bourse suivant l'inscription au registre du commerce ou l'entrée en vigueur du changement	<ul style="list-style-type: none"> - Ancien/nouveau nom; ancienne/nouvelle adresse Internet - Symbole ticker; n° de valeur, code ISIN 	Information officielle par e-mail à: listing@six-group.com	- Information officielle
2.02	Changement d'adresse du siège principal	Dans les cinq jours de bourse suivant l'inscription au registre du commerce ou l'entrée en vigueur du changement	<ul style="list-style-type: none"> - Nom; adresse; case postale; n° de tél. - Copie de l'extrait du registre du commerce 	Information officielle par e-mail à: listing@six-group.com	-
2.03	Annulation de l'autorisation obligatoire de l'autorité de surveillance en tant qu'intermédiaire financier et/ou en tant que dépositaire	Dès que la décision de l'autorité de surveillance est communiquée	<ul style="list-style-type: none"> - Copie de la décision de l'autorité de surveillance - Indications sur le maintien de la garantie par nantissement et des mesures prises ou prévues 	Information officielle par e-mail à: listing@six-group.com	<ul style="list-style-type: none"> - Information officielle - Publication selon conditions
2.04	Changement de l'un des participants à la structure	Cinq jours de bourse avant l'entrée en vigueur du changement	<ul style="list-style-type: none"> - N° de valeur, code ISIN - Indications sur le nouveau participant (en joignant un rapport annuel) - Indications sur le maintien de la garantie par nantissement (en cas de changement du dépositaire) 	Information officielle par e-mail à: listing@six-group.com	<ul style="list-style-type: none"> - Information officielle - Publication selon conditions
3	Indications relatives aux valeurs mobilières				
3.01	Révision des conditions relatives aux valeurs mobilières, par ex. en ce qui concerne les corporate actions dans le sous-jacent	Dès la survenance de l'événement	<ul style="list-style-type: none"> - N° de valeur, code ISIN - N° de valeur, code ISIN du titre sous-jacent; - Anciennes/nouvelles conditions (pondération, composition du basket, etc.) 	Information officielle par e-mail à: listing@six-group.com	<ul style="list-style-type: none"> - Information officielle - Publication selon conditions

Chiffre	Événement à annoncer	Délai d'annonce	Exigences	Type de communiqué à SIX Exchange Regulation	Type de publication par SIX Swiss Exchange
3.02	Augmentation ou réduction du nombre de titres	Chaque année	<ul style="list-style-type: none"> - N° de valeur, code ISIN - Ancien/nouveau nombre de titres - Copie du certificat global correspondant (si applicable) 	Information officielle par e-mail à: listing@six-group.com	<ul style="list-style-type: none"> - Information officielle - Publication selon conditions
3.03	Interruption provisoire ou permanente de la fixation régulière du prix du sous-jacent (suite à des suspensions du négoce, décotations ou événements similaires sur le titre sous-jacent)	Dès la survenance de l'événement	<ul style="list-style-type: none"> - N° de valeur, code ISIN - N° de valeur, code ISIN du titre sous-jacent; - Anciennes/nouvelles conditions 	Information officielle par e-mail à: listing@six-group.com	<ul style="list-style-type: none"> - Information officielle - Publication selon conditions
3.04	Dénonciation anticipée par l'émetteur (si prévu par les conditions)	Selon conditions	<ul style="list-style-type: none"> - N° de valeur, code ISIN - N° de valeur, code ISIN du titre sous-jacent; - Anciennes/nouvelles conditions 	Information officielle par e-mail à: listing@six-group.com	<ul style="list-style-type: none"> - Information officielle - Publication selon conditions
3.05	Changements qui concernent l'émetteur (ou l'un des participants à la structure) susceptibles d'influencer le cours ou l'évaluation de l'ETP (par ex. insolvabilité, faillite ou situation semblable.)	Dès la survenance de l'événement	<ul style="list-style-type: none"> - N° de valeur, code ISIN - N° de valeur, code ISIN du titre sous-jacent; - Description de l'événement - Date; - Conséquences 	Information officielle par e-mail à: listing@six-group.com	<ul style="list-style-type: none"> - Information officielle - Publication selon conditions
3.06	Changements concernant la garantie par nantissement (selon les conditions du produit)	Dès la survenance de l'événement	<ul style="list-style-type: none"> - N° de valeur, code ISIN - Description de l'événement - Date; - Conséquences 	Information officielle par e-mail à: listing@six-group.com	<ul style="list-style-type: none"> - Information officielle - Publication selon conditions