

Αθήνα, 19.06.2013

Αρ. Πρωτ.: 11792

Προς: Μέλη του ΧΑ και της ΕΤΕΚ
Χειριστές ΣΑΤ
System Vendors
Data Vendors

Κοιν: Χρηματιστήριο Αξιών Κύπρου (ΧΑΚ)
Σύνδεσμος Μελών Χρηματιστηρίου Αθηνών (ΣΜΕΧΑ)
Ελληνική Ένωση Τραπεζών (ΕΕΤ)
Κυπριακός Σύνδεσμος Επιχειρήσεων Παροχής Επενδυτικών Υπηρεσιών
(ΚΣΕΠΕΥ)

ΝΕΕΣ ΕΚΔΟΣΕΙΣ ΣΥΣΤΗΜΑΤΩΝ ΓΙΑ ΤΗΝ ΥΠΟΣΤΗΡΙΞΗ ΤΟΥ ΕΡΓΟΥ «ΑΝΑΔΙΑΡΘΡΩΣΗ ΤΗΣ ΑΓΟΡΑΣ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ»

1. ΕΙΣΑΓΩΓΗ

Με την παρούσα επιστολή, θα θέλαμε να σας ενημερώσουμε σχετικά με την διαθεσιμότητα νέων εκδόσεων λογισμικού διασύνδεσης (API) και τον προγραμματισμό επόμενων εκδόσεων επί αυτών, μέχρι το τέλος του έτους.

Η ενημέρωση γίνεται για τον κατάλληλο προγραμματισμό των μελών και των εταιριών που τους υποστηρίζουν μηχανογραφικά, ώστε να είναι σε θέση να αξιοποιήσουν αποτελεσματικά τις νέες υποδομές που αναπτύσσει η ΕΧΑΕ, σχετικά με το έργο της Αναδιάρθρωσης της Αγοράς Παραγώγων, στα πλαίσια προσαρμογής στον νέο κανονισμό EMIR (European Market Infrastructure Regulation) της ΕΕ.

Πιο συγκεκριμένα:

1. Αναπτύχθηκε και είναι διαθέσιμο ένα νέο σύγχρονο πρωτόκολλο επικοινωνίας με το Σύστημα Αυλών Τίτλων (ΣΑΤ), βασισμένο σε XML, με χρήση μηνυμάτων ISO 15022, για την κάλυψη άμεσα τόσο της λειτουργικότητας του σημερινού API του ΣΑΤ, αλλά και για την κάλυψη των λειτουργιών εκκαθάρισης και διακανονισμού στην αμέσως επόμενη έκδοση. Το νέο πρωτόκολλο

ενσωματώθηκε στον ATHEX Gateway και στο σύστημα ODL (με την μορφή νέων μηνυμάτων) για διευκόλυνση της διαδικασίας προσαρμογής.

Συγκεκριμένα, είναι διαθέσιμη η νέα έκδοση του **ATHEX GW (1.2)**, που απαιτείται για να υποστηριχτεί η επικοινωνία των συστημάτων των μελών / χειριστών ΣΑΤ με το νέο **ΣΑΤ API (1.0)**.

2. Παράλληλα και προκειμένου να υποστηριχθούν όλες οι συστημικές αλλαγές που επιφέρει το έργο της Αναδιάρθρωσης της Αγοράς Παραγώγων και που συνοψίζονται στα κάτωθι:

- a. Κατάργηση των υπάρχοντων συστημάτων διαπραγμάτευσης της Αγοράς Παραγώγων και μεταφορά της διαπραγμάτευσης παραγώγων στο σύστημα διαπραγμάτευσης αξιών (ΟΑΣΗΣ/ETS)
- b. Κατάργηση των υπάρχοντων συστημάτων εκκαθάρισης/ διακανονισμού της Αγοράς Παραγώγων και μεταφορά των εργασιών αυτών στο σύστημα εκκαθάρισης/ διακανονισμού αξιών (ΣΑΤ)
- c. Δημιουργία κοινού API για τη διαπραγμάτευση όλων των προϊόντων του ΧΑ
- d. Δημιουργία κοινού Data Feed πρωτοκόλλου για τη λήψη δεδομένων για όλα τα προϊόντα του ΧΑ

ετοιμάζεται:

- a. νέα έκδοση του συστήματος **ΟΑΣΗΣ ETS (4.0)**
- b. νέα έκδοση του API, **ATHEX GW (2.0)** για εντολές και πράξεις σε παράγωγα προϊόντα
- c. νεώτερη έκδοση του **ΣΑΤ API (2.0)** για τις εργασίες εκκαθάρισης και
- d. νεώτερη έκδοση του Data Feed πρωτοκόλλου (IDS - Information Dissemination System, v4.0)

1.1 ΧΡΟΝΟΔΙΑΓΡΑΜΜΑ ΕΝΕΡΓΕΙΩΝ / ΠΑΡΑΔΟΤΕΩΝ

Παρακάτω παρουσιάζεται ένα συνοπτικό χρονοδιάγραμμα παράδοσης του σχετικού υλικού (κείμενα, παρουσιάσεις και λογισμικό), αλλά και των δοκιμαστικών περιβάλλοντων, για τα δύο παραπάνω έργα:

Μήνας	ΕΡΓΟ «ΝΕΟ ΣΑΤ ΑΡΙ»	ΕΡΓΟ «ΑΝΑΔΙΑΡΘΡΩΣΗ ΑΓΟΡΑΣ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ»
Ιούν. 2013	Παρουσίαση προς τους System Vendors και το IT προσωπικό των συμμετεχόντων της έκδοσης 1.2 του ATHEX GW και της έκδοσης 1.0 του νέου ΣΑΤ ΑΡΙ	Παρουσίαση προς τους System Vendors και το IT προσωπικό των συμμετεχόντων της έκδοσης 2.0 του ATHEX GW και της έκδοσης 4.0 του συστήματος διαπραγμάτευσης ΟΑΣΗΣ
Ιούλ. 2013	Διάθεση της έκδοσης λογισμικού 1.2 του ATHEX GW για την υποστήριξη του νέου ΣΑΤ ΑΡΙ Διάθεση δοκιμαστικού περιβάλλοντος για την έκδοση 1.0 του νέου ΣΑΤ ΑΡΙ	
Αύγ. 2013		Διάθεση του κειμένου ανάπτυξης (specs) της έκδοσης 2.0 του ΣΑΤ ΑΡΙ
Σεπτ. 2013	Διάθεση της έκδοσης λογισμικού 1.0 του ΣΑΤ ΑΡΙ στο περιβάλλον παραγωγής	
Σεπτ. 2013		Διάθεση της έκδοσης λογισμικού 2.0 του ATHEX GW Διάθεση δοκιμαστικού περιβάλλοντος για την έκδοση 2.0 του ATHEX GW και την έκδοση 4.0 του ΟΑΣΗΣ
Οκτ. 2013	Κατάργηση της τωρινής έκδοσης του ΣΑΤ ΑΡΙ (tuxedo)	Διάθεση δοκιμαστικού περιβάλλοντος για την έκδοση 2.0 του ΣΑΤ ΑΡΙ

2. ΕΡΓΟ «ΝΕΟ ΣΑΤ ΑΡΙ»

Όπως είναι γνωστό, το Σύστημα Άυλων Τίτλων (ΣΑΤ) διαθέτει ως βασικό κανάλι πρόσβασης των χρηστών (Εκκαθαριστικών Μελών και Θεματοφυλάκων) τον τερματικό σταθμό.

Επιπλέον αυτού, σήμερα παρέχεται και ένα δεύτερο κανάλι πρόσβασης με την μορφή ΑΡΙ που επιτρέπει τη διασύνδεση των backoffice εφαρμογών με το ΣΑΤ, το οποίο είναι τεχνολογικά παρωχημένο και το κυριότερο, λειτουργικά περιορισμένο σε βαθμό που να μη μπορεί να καλύψει σε σημαντικό βαθμό τις ανάγκες των χρηστών του.

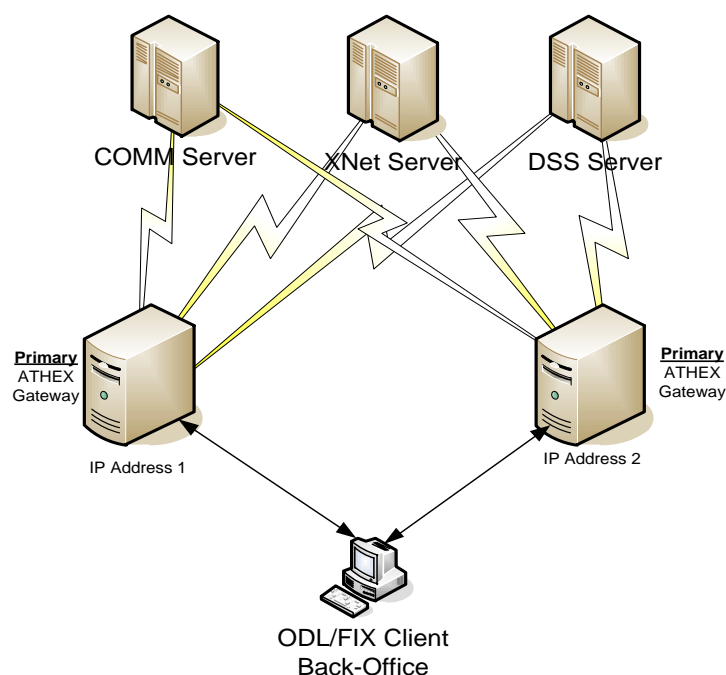
Η ανάπτυξη μιας νέας υπηρεσίας, προς τα Εκκαθαριστικά Μέλη της ΕΤΕΚ και τους Θεματοφύλακες της ΕΧΑΕ, που δίνει τη δυνατότητα αυτοματισμού των εργασιών Backoffice και Post Trading οι οποίες σήμερα πραγματοποιούνται μέσω των τερματικών σταθμών και μέσω αρχείων, θεωρείται ένα απαραίτητο βήμα προς την κατεύθυνση του Straight Through Processing (STP). Κεντρική ιδέα κατά τον σχεδιασμό της νέας υπηρεσίας είναι ο περιορισμός των δαπανών που θα ήταν αναγκασμένα να κάνουν τα Εκκαθαριστικά Μέλη και οι Θεματοφύλακες για την υποστήριξη της. Επίσης, βασικός στόχος, είναι η υλοποίηση να βασίζεται στη χρήση διεθνών standards για τις εργασίες post trading.

Για το λόγο αυτό, κρίθηκε ως πλέον κατάλληλη λύση η εκμετάλλευση της τεχνολογίας του ATHEX GW που χρησιμοποιείται κατά τη διαπραγμάτευση και αποτελεί το API του ΟΑΣΗΣ και του XOrder Server, επειδή είναι διαδομένη τόσο στα Μέλη του ΧΑ, όσο και στους προμηθευτές λογισμικού που δραστηριοποιούνται στην Ελληνική κεφαλαιαγορά. Οπότε, για την υλοποίηση της διεπαφής με το νέο ΣΑΤ API, το ΧΑ ανέπτυξε και διαθέτει στους συμμετέχοντες την έκδοση 1.2 του ATHEX GW. Η έκδοση αυτή υλοποιείται με την νέα έκδοση του λογισμικού ODL V3.2.

Αναλυτικότερα, αυτή τη στιγμή το ATHEX GW αποτελεί διεπαφή (Interface) - κανάλι πρόσβασης για τις εφαρμογές των συμμετεχόντων στην αγορά προς τα κεντρικά συστήματα της ΕΧΑΕ:

- ΟΑΣΗΣ/ETS για τη διαπραγμάτευση προϊόντων στην αγορά αξιών του ΧΑ (COMM Server) και
- XOrder Server (XNET Server) για την πρόσβαση στις αγορές του XNET

Πλέον, με τη νέα έκδοση του λογισμικού, δίνεται η δυνατότητα διεπαφής / πρόσβασης και στο Σύστημα Άυλων Τίτλων (ΣΑΤ – DSS Server), όπως δείχνει και η παρακάτω εικόνα:



Η έκδοση 1.2 του ATHEX GW θα υποστηρίζεται από το ΧΑ παράλληλα με την τρέχουσα έκδοση 1.1 και η εγκατάστασή της **είναι υποχρεωτική** για τα Μέλη / Θεματοφύλακες που χρησιμοποιούν το παλαιό ΣΑΤ API ή θα ήθελαν να χρησιμοποιήσουν το νέο. Σημειώνουμε ότι **το παλαιό ΣΑΤ API (tuxedo) θα καταργηθεί τον Οκτώβριο του τρέχοντος έτους.**

Πιο συγκεκριμένα, η έκδοση 1.2 του ATHEX GW χαρακτηρίζεται από επέκταση της λειτουργικότητας του λογισμικού με υλοποίηση των παρακάτω επιπλέον ODL μηνυμάτων που ενσωματώνουν μηνύματα του νέου πρωτοκόλλου ΣΑΤ API (v1.0):

1. MS (DSS Message)
2. TS (DSS Message Info)
3. TU (DSS Unsolicited Message) και
4. CS (DSS Broadcast message) για υποστήριξη της επικοινωνίας με το ΣΑΤ

Σημειώνεται δε ότι, για όσους Θεματοφύλακες δεν επιθυμούν να χρησιμοποιήσουν την υπηρεσία ATHEX GW για τη διόδευση μηνυμάτων προς το ΣΑΤ API, θα παρέχεται εναλλακτικός τρόπος επικοινωνίας με το ΣΑΤ μέσω μεταφοράς αρχείων με secure FTP. Αν και είναι φυσικά γνωστό, ότι η επικοινωνία με μεταφορές αρχείων μειώνει την ταχύτητα αλληλεπίδρασης με το σύστημα, η δυνατότητα παρέχεται για την κάλυψη οποιωνδήποτε ιδιαίτεροτήτων στις υποδομές του Θεματοφύλακα.

Και στις δύο περιπτώσεις, το περιεχόμενο των μηνυμάτων της επικοινωνίας με το ΣΑΤ θα είναι κοινό και θα υποστηρίζει το διεθνές standard ISO 15022.

Επισημαίνεται ότι κατά την αρχική διάθεση του νέου ΣΑΤ API οι προσφερόμενες υπηρεσίες του είναι οι παρακάτω:

- Άνοιγμα Μεριδας – Λογαριασμού
- Καταχώρηση Εξουσιοδότησης Χρήσης
- Απενεργοποίηση Εξουσιοδότησης Χρήσης
- Απ' ευθείας Μεταφορά
- Άρση από Χειριστή
- Λήψη από Χειριστή
- Ακύρωση εκκρεμούς μεταφοράς
- Άνοιγμα Μεριδας – Λογαριασμού Συγκυρίων & Κοινής Μεριδας
- Αναζήτηση Μελών/Συγκυρίων συνδικαιούχων μεριδας
- Μεταφορά από/προς Κοινή Επενδυτική Μεριδα

- Ερωτήματα
 - Αναζήτηση Στοιχείων Επενδυτή
 - Υπόλοιπα Επενδυτή
 - Μεριδές και Λογαριασμοί
 - Ημερολόγιο Κινήσεων
 - Αιτήσεις Μεταβολής Επενδυτών
- Διαχείριση OTC συναλλαγών μέσω ISO 15022 μηνυμάτων (MT 54X)

Παρατηρήστε ότι με το νέο ΣΑΤ API θα παρέχεται πλέον η δυνατότητα διαχείρισης OTC συναλλαγών μέσω μηνυμάτων ISO 15022 (MT 54X), υπηρεσία η οποία δεν προσφέρεται με την τρέχουσα έκδοση ΣΑΤ API.

Με τη χρήση του νέου ΣΑΤ API και της τεχνολογίας αυτού δίνεται πλέον η δυνατότητα σταδιακής αύξησης των προσφερόμενων υπηρεσιών.

3. ΕΡΓΟ «ΑΝΑΔΙΑΡΘΡΩΣΗ ΤΗΣ ΑΓΟΡΑΣ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ»

Σημειώνεται εδώ, ότι το έργο της Αναδιάρθρωσης της Αγοράς Παραγώγων, όσο αφορά τα συστήματα της ΕΧΑΕ θα υποστηριχτεί από τις κάτωθι εκδόσεις των συστημάτων:

- **ΟΑΣΗΣ V4.0** (κοινό σύστημα διαπραγμάτευσης αξιών, παραγώγων, δανεισμού)
- **ATHEX GW V2.0** (κοινό API μελών διαπραγμάτευσης για τη διαπραγμάτευση αξιών, παραγώγων, δανεισμού)
- **ΣΑΤ API V2.0** (κοινό API για τα εκκαθαριστικά μέλη / χειριστές για την εκκαθάριση παραγώγων, δανεισμού)
- **Information Dissemination System (IDS) V4.0** (κοινό πρωτόκολλο λήψης δεδομένων αγοράς για τις αγορές αξιών, παραγώγων, δανεισμού)

Η έκδοση 2.0 του ΣΑΤ API, κατά την έναρξη της διάθεσης της, θα προσφέρει τη δυνατότητα εκτέλεσης εργασιών εκκαθάρισης παραγώγων.

3.1 ΧΡΗΣΗ ΤΟΥ BLOOMBERG OPEN SYMBOLOGY

Στο πλαίσιο των προαναφερθέντων συστημικών αλλαγών για την υποστήριξη του έργου της Αναδιάρθρωσης της Αγοράς Παραγώγων, επισημαίνεται επίσης ότι από τις προαναφερθείσες εκδόσεις συστημάτων, ο κωδικός χρεογράφου που τα συστήματα του ΧΑ / ΕΤΕΚ / ΕΧΑΕ θα αναγνωρίζουν ως κωδικό ταυτοποίησης (unique key), δε

θα είναι πια το ISIN του χρεογράφου, όπως σήμερα, αλλά ο κωδικός **Bloomberg Global ID** (BBGID), που είναι ένας μοναδικός και σταθερός 12ψήφιος κωδικός για κάθε χρεογράφο που διαπραγματεύεται σε μία αγορά και νόμισμα.

Η ΕΧΑΕ μετά από διερεύνηση στο διεθνές περιβάλλον σχετικά με την ύπαρξη ενός μοναδικού κωδικού που να μην αλλάζει σε όλη τη διάρκεια ζωής ενός χρεογράφου, κατέληξε στην χρήση της μεθοδολογίας Bloomberg OPEN SYMBOLOGY ή οποία παρέχεται χωρίς καμία επιβάρυνση από την εταιρία. Είναι φανερό ότι η χρήση ενός τέτοιου μοναδικού κωδικού διευκολύνει σημαντικά την ροή εργασιών, την επικοινωνία της αγοράς σε ένα παγκοσμιοποιημένο περιβάλλον, τη μείωση κόστους λόγω ομογενοποίησης δεδομένων και απλοποίησης διαδικασιών και του κόστους διατήρησης ιστορικών δεδομένων τόσο στην ΕΧΑΕ όσο και στους συμμετέχοντες στην αγορά.

Στο σύνδεσμο <http://www.openbloomberg.com/open-symbology/> μπορείτε να δείτε περισσότερες πληροφορίες για την νέα κωδικοποίηση, ενώ μπορείτε να αναζητήσετε τους κωδικούς BBGID όλων των χρεογράφων στο: <http://bsym.bloomberg.com/sym/>.

4. ΑΜΕΣΑ ΠΑΡΑΔΟΤΕΑ ΚΕΙΜΕΝΑ

Σε σχέση με τα προαναφερθέντα, το ΧΑ έχει άμεσα διαθέσιμα προς τους ενδιαφερόμενους τόσο για την ανάπτυξη του νέου ΣΑΤ API, όσο και για το έργο Αναδιάρθρωσης της Αγοράς Παραγώγων, τα κάτωθι κείμενα ανάπτυξης:

κατεβάστε τα κείμενα κάνοντας click πάνω στον τίτλο τους

ΕΡΓΟ «ΝΕΟ ΣΑΤ API»	ΕΡΓΟ «ΑΝΑΔΙΑΡΘΡΩΣΗ ΑΓΟΡΑΣ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ»
Κείμενο ανάπτυξης (ATHEX Gateway Architecture And Development Guidelines) για την έκδοση 1.2 του ATHEX GW	Κείμενο ανάπτυξης (ATHEX Gateway Architecture And Development Guidelines) για την έκδοση 2.0 του ATHEX GW
Ελληνική έκδοση του κειμένου ανάπτυξης για την έκδοση 1.0 του νέου ΣΑΤ API	Κείμενο ανάπτυξης (OASIS IDS Market Data Feed Specification v4.0.0.0) για τους Data Vendors
	Κείμενο ανάπτυξης (OASIS IDS Interface Technical Specification (IOCP) v4.0.0.0) για τους Data Vendors

5. ΕΠΙΚΟΙΝΩΝΙΑ

Για περισσότερες λεπτομέρειες σχετικά με τα παραπάνω, μπορείτε να επικοινωνήσετε με:

Τμήμα Εξυπηρέτησης Μελών

Τηλ: 210-3366393

Τηλ: 210-3366385

Fax: 210-3366286

E-mail: members-support@helex.gr

Με εκτίμηση,

Δημήτρης Καραϊσκάκης

Επιτελικός Διευθυντής Λειτουργιών