



ATHEXCLEAR
Εκκαθάριση Συναλλαγών

**ΕΤΑΙΡΕΙΑ ΕΚΚΑΘΑΡΙΣΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ
ΧΡΗΜΑΤΙΣΤΗΡΙΟΥ ΑΘΗΝΩΝ Α.Ε**

ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ Α
ΤΕΧΝΙΚΕΣ ΠΡΟΔΙΑΓΡΑΦΕΣ ΥΠΗΡΕΣΙΑΣ
EMIR TR

Έκδοση 1.18
Δεκέμβριος 2020



Περιεχόμενα

Ιστορικό Εκδόσεων	3
1. Εισαγωγή	5
2. Υποχρεώσεις αναφοράς με βάση τον Κανονισμό EMIR.....	5
2.1. Εύρος Εφαρμογής.....	5
2.2. Διαδικασία αναφοράς Χρηματιστηριακών Συναλλαγών	5
2.3. Αναφορά συναλλαγών και θέσεων	6
2.4. Υποχρέωση αναφοράς έκθεσης κινδύνου	7
2.5. Υποχρέωση αναφοράς παλαιών συναλλαγών	7
3. Υπηρεσία EMIR TR	7
3.1. Περιγραφή της υπηρεσίας.....	7
4. Περιγραφή των πεδίων που θα περιλαμβάνονται στα κοινά δεδομένα των αναφορών που εκκαθαρίζονται από την ΕΤΕΚ	9
4.1. Περιγραφή του κωδικού UTI	9
4.1.1. Περιγραφή του κωδικού UTI για αναφορά συναλλαγών	9
4.1.2. Περιγραφή του κωδικού UTI για αναφορά θέσης	10
4.2. Περιγραφή του κωδικού TRN.....	11
4.3. Περιγραφή του προϊόντος.....	11
4.4. Κωδικός LEI της ΕΤΕΚ	12
4.5. Περιγραφή Κοινών Πεδίων για τις αναφορές της ΕΤΕΚ	12
4.6. Περιγραφή πεδίων που αφορούν την αποτίμηση των θέσεων	14
4.7. Περιγραφή πεδίων που αφορούν τις απαιτούμενες ασφάλειες	14
5. Στοιχεία που απαιτούνται από τα Μέλη για την παροχή της υπηρεσίας EMIR-TR για συναλλαγές που εκκαθαρίζονται από την ΕΤΕΚ.....	18
5.1. Γραμμογράφηση στοιχείων πελατών για συναλλαγές που εκκαθαρίζονται από την ΕΤΕΚ.....	19
5.2. Γραμμογράφηση ασφαλειών ανά πελάτη (λογαριασμό θέσης) για συναλλαγές που εκκαθαρίζονται από την ΕΤΕΚ	22
6. Στοιχεία για την παροχή της υπηρεσίας EMIR-TR για συναλλαγές που δεν εκκαθαρίζονται από την ΕΤΕΚ.....	23
6.1. Γραμμογράφηση αρχείου αναφορών	23
6.2. Γραμμογράφηση αρχείου με LEI πελατών για συναλλαγές εκτός ΕΤΕΚ	23
7. Αίτηση για τη συμμετοχή Μέλους στην Υπηρεσία	23



Ιστορικό Εκδόσεων

Έκδοση	Ημερομηνία	Περιγραφή / Αλλαγές
1.1	23 Ιανουαρίου 2014	Αρχική Έκδοση
1.2	5 Φεβρουαρίου 2014	Προσθήκη πεδίων στον πίνακα στοιχείων πελατών (Παρ. 5.1)
1.3	7 Φεβρουαρίου 2014	Διόρθωση CFI προϊόντων (Παρ.4.3)
1.4	24 Ιουλίου 2014	Προσθήκη παραγράφων 4.6, 4.7 και 6.2 καθώς και μικρές αλλαγές (εμφανίζονται με κόκκινο)
1.5	18 Νοεμβρίου 2014	Αλλαγές λόγω μετάβασης στο νέο μοντέλο εκκαθάρισης παραγώγων
1.6	12 Φεβρουαρίου 2015	Διορθώσεις στο κείμενο με κόκκινο
1.7	16 Σεπτεμβρίου 2015 (με πρώτη εφαρμογή στις αναφορές που θα στάλθηκαν την 2-11-2015)	Αλλαγές λόγω εφαρμογής του Level II Validation
1.8	20 Σεπτεμβρίου 2016	Αλλαγές λόγω μετάβασης σε νέο Trade Repository
1.8.1	04 Οκτωβρίου 2016	Αλλαγές λόγω τροποποίησης του αρχείου πελατών (παρ.5.1)
1.9	6 Ιουνίου 2017	Αλλαγές λόγω: - τροποποίησης στην κωδικοποίηση του CFI (η τροποποίηση αυτή θα εφαρμοσθεί από τις αναφορές της 3/7 για τις συναλλαγές και θέσεις της 30/06/2017) - αφαίρεση στοιχείων για SIBEX - άλλες διευκρινίσεις
1.10	18 Ιουλίου 2017	Αλλαγές από 01-11-2017 λόγω: - Τροποποίησης στο αρχείο των ασφαλειών - Νέων προδιαγραφών της ESMA
1.11	22 Σεπτεμβρίου 2017	Αλλαγές από 22-09-2017 λόγω: - Ενεργοποίησης λειτουργικότητας που αφορά στην εισαγωγή αρχείου με LEI πελατών για συναλλαγές OTC



1.12	04 Οκτωβρίου 2017	Αλλαγές από 01-11-2017 λόγω εισαγωγής νέου πεδίου στο αρχείο των πελατών «Members Accounts CSV file»
1.13	10 Νοεμβρίου 2017	Αλλαγές στο πεδίο «Clearing Obligation»
1.14	21 Δεκεμβρίου 2017	Αντικατάσταση του κωδικού Aii με το ISIN του προϊόντος στα πεδία Product Identification Type & Product Identification
1.15	24 Ιανουαρίου 2020	Προσθήκη / τροποποίηση πεδίων λόγω ανάληψης εκκαθάρισης από την ΕΤ.ΕΚ. παράγωγων προϊόντων επί ηλεκτρικής ενέργειας
1.16	26 Φεβρουαρίου 2020	Πλέον τα ISIN των σειρών των παραγώγων προϊόντων θα είναι διαθέσιμα μόνο από τα αρχεία του Συστήματος Εκκαθάρισης
1.17	13 Μαρτίου 2020	Αλλαγές στα πεδία «Underlying Identification Type Obligation», «Underlying Identification»
1.18	14 Δεκεμβρίου 2020	Αλλαγή στο πεδίο «Compression»

1. Εισαγωγή

Ο Κανονισμός (ΕΕ) αριθ. 648/2012 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου της 4ης Ιουλίου 2012 για τα εξωχρηματιστηριακά παράγωγα, τους κεντρικούς αντισυμβαλλομένους και τα αρχεία καταγραφής συναλλαγών (EMIR) προβλέπει την υποχρέωση αναφοράς συναλλαγών, σύμφωνα με την οποία οι αντισυμβαλλόμενοι και οι κεντρικοί αντισυμβαλλόμενοι διασφαλίζουν ότι οι λεπτομερείς πληροφορίες για κάθε σύμβαση παραγώγων που έχουν συνάψει, καθώς και κάθε τροποποίηση ή λήξη της σύμβασης, αναφέρονται σε αρχείο καταγραφής συναλλαγών (Trade Repository).

Το κείμενο αυτό περιλαμβάνει πληροφορίες για το πώς η ΕΤΕΚ αναφέρει τις συναλλαγές της.

Επίσης περιγράφει την υπηρεσία που προσφέρει η ΕΤΕΚ στα Μέλη της αλλά και τους πελάτες τους που υπόκεινται στην υποχρέωση αναφοράς.

2. Υποχρεώσεις αναφοράς με βάση τον Κανονισμό EMIR

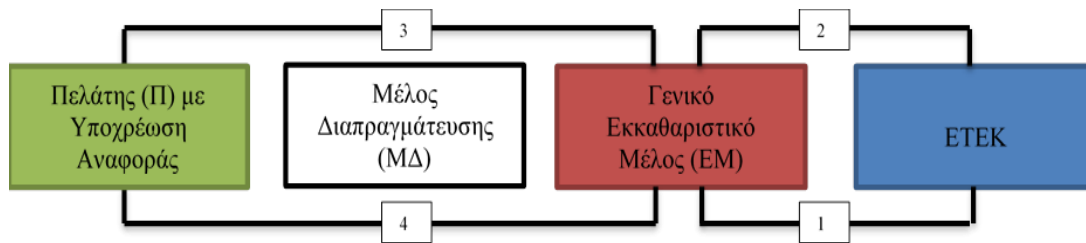
2.1. Εύρος Εφαρμογής

Η υποχρέωση αναφοράς αφορά την αγορά παραγώγων. Τα προϊόντα δανεισμού δεν περιλαμβάνονται στις υποχρεώσεις αναφοράς.

2.2. Διαδικασία αναφοράς Χρηματιστηριακών Συναλλαγών

Με βάση τον τρόπο λειτουργίας της αγοράς και το ρόλο της ΕΤΕΚ ως κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κάθε συναλλαγή που πραγματοποιείται έχει σαν αντισυμβαλλόμενους, για τις ανάγκες της αναφοράς συναλλαγών, τα Εκκαθαριστικά Μέλη, την ΕΤΕΚ και τους πελάτες.

Στο επόμενο σχήμα παρουσιάζεται η γενική περίπτωση συναλλαγής καθώς και οι τέσσερις αναφορές που θα πρέπει να καταχωρηθούν, όπως φαίνεται στο σχήμα και στον επόμενο πίνακα (με αριθμούς από 1 έως 4).



Report	UTI	Transaction reference Number	Counterparty ID	ID of the other Counterparty	Broker ID	Clearing Member ID	Beneficiary ID	Trading Capacity	Venue of execution	CCP ID
1	UTIO01	TRN1	EM	ΕΤΕΚ		EM	EM	P	XA	ΕΤΕΚ
2	UTIO01	TRN1	ΕΤΕΚ	EM		EM	ΕΤΕΚ	P	XA	ΕΤΕΚ
3	UTIO02	TRN1	Π	EM	ΜΔ	EM	Π	P	XA	ΕΤΕΚ
4	UTIO02	TRN1	EM	Π	ΜΔ	EM	EM	P	XA	ΕΤΕΚ

Στις παραπάνω αναφορές χρησιμοποιείται κοινό Unique Trade Identification (UTI) για τις συναλλαγές μεταξύ δύο αντισυμβαλλομένων ενώ προτείνεται η χρήση ενός κοινού Transaction Reference Number (TRN) για το σύνολο των αναφορών.

Στον πίνακα εμφανίζεται για λόγους κατανόησης ένα μικρό υποσύνολο των στοιχείων που θα πρέπει να αναφερθούν. Αναλυτικά στοιχεία για τα πεδία των αναφορών περιγράφονται στον Κανονισμό (ΕΕ) αριθ. 148/2013.

2.3. Αναφορά συναλλαγών και θέσεων

Προκειμένου να διευκολυνθεί η υποχρέωση αναφοράς της αποτίμησης και των σχετικών εγγυήσεων, θα ακολουθηθεί ένα μοντέλο όπου σε καθημερινή βάση και μετά το τέλος της συνεδρίασης:

1. Θα αναφέρονται οι συναλλαγές που πραγματοποιούνται κατά τη συνεδρίαση και έχουν οριστικοποιηθεί προς εκκαθάριση (περιλαμβάνονται οι συναλλαγές μετά τις πιθανές διαρθρώσεις και μεταθέσεις ενώ δεν θα περιλαμβάνονται συναλλαγές που ακυρώθηκαν).
2. Στη συνέχεια οι συναλλαγές αυτές θα ακυρώνονται λόγω ενσωμάτωσής τους σε μία συνολική θέση.
3. Για νέες θέσεις που προέκυψαν από συναλλαγές της ημέρας θα δημιουργούνται νέες αναφορές που θα αφορούν τις θέσεις αυτές.
4. Για θέσεις που έχουν δημιουργηθεί από συναλλαγές προηγούμενων ημερών θα ενημερώνεται με νέα αναφορά η θέση με το αποτέλεσμα των κινήσεων της ημέρας.
5. Ομοίως για θέσεις που έχουν τροποποιηθεί λόγω κάποιου εταιρικού γεγονότος ή κάποιας κίνησης επί της θέσης (π.χ. εξάσκηση) θα ενημερώνεται με νέα αναφορά η θέση με τις αλλαγές.

Κάθε συναλλαγή που πραγματοποιείται θα λαμβάνει ένα μοναδικό UTI (βλέπε παράγραφο 4.1.1). Όμοια κάθε νέα θέση θα λαμβάνει ένα μοναδικό UTI το οποίο θα διατηρείται σταθερό μέχρι τη λήξη του προϊόντος που αφορά.

Κατά τη λήξη θα ανακοινώνεται αυτόματα στο TR η λήξη του προϊόντος και το κλείσιμο της θέσης.

2.4. Υποχρέωση αναφοράς έκθεσης κινδύνου

Από τις 11/8/2014, οι αντισυμβαλλόμενοι οι οποίοι είναι Financial Companies, αλλά και Non-Financial Counterparties οι οποίοι έχουν ξεπεράσει ένα κατώφλι κινδύνου, είναι υποχρεωμένοι να ανακοινώνουν στοιχεία σχετικά με την έκθεση κινδύνου.

Η ΕΤΕΚ ανακοινώνει τα σχετικά στοιχεία σε ημερήσια βάση για την ίδια αλλά και το σύνολο των πελατών της υπηρεσίας (ακόμα και αν δεν έχουν ξεπεράσει το σχετικό κατώφλι) με την προϋπόθεση ότι θα της έχουν αναθέσει την αναφορά των συναλλαγών. Η αναφορά αυτή γίνεται σε επίπεδο θέσης και όχι συναλλαγής.

Λεπτομέρειες σχετικά με το περιεχόμενο των πεδίων που αφορούν την έκθεση σε κίνδυνο παρουσιάζονται στην παράγραφο 4.7.

2.5. Υποχρέωση αναφοράς παλαιών συναλλαγών

Για τις συναλλαγές που ήταν ακόμα ανοιχτές στις 16 Αυγούστου 2012 πρέπει να αναφερθούν εντός 90 ημερών από την ημερομηνία έναρξης της υποχρέωσης αναφοράς (12 Φεβ 2014) αν είναι ακόμα ανοιχτές κατά την ημερομηνία αυτή, και εντός τριών ετών αν όχι.

Ειδικά για τα προϊόντα που εκκαθαρίζει η ΕΤΕΚ (που έχουν μέγιστη διάρκεια ζωής δώδεκα μήνες) ισχύουν τα παρακάτω:

- Συναλλαγές που είχαν πραγματοποιηθεί πριν από τις 12 Φεβρουαρίου 2014 αλλά είχαν παραμείνει ανοιχτές οι σχετικές θέσεις στις 12 Φεβρουαρίου 2014, θα πρέπει να ανακοινωθούν έως τις 13 Μαΐου 2014.
- Σύμφωνα με τις διευκρινίσεις της ESMA (Q&A TR Answer 4a της 20 Δεκεμβρίου 2013) είναι δυνατή η αναφορά μόνο των ανοιχτών θέσεων που υπάρχουν την 11 Φεβ 2014. Αυτή θα είναι και η στρατηγική της ΕΤΕΚ για την κάλυψη της σχετικής υποχρέωσης.
- ~~Οι συναλλαγές που δεν οδηγούν σε ανοιχτή θέση στις 12 Φεβρουαρίου θα αναφερθούν εντός 3 ετών όπως απαιτεί ο κανονισμός και με βάση οδηγίες που θα δοθούν σε επόμενη φάση.~~

3. Υπηρεσία EMIR TR

3.1. Περιγραφή της υπηρεσίας

Σύμφωνα με τον κανονισμό οι αντισυμβαλλόμενοι δύνανται να αναθέσουν κατ' εξουσιοδότηση την αναφορά των στοιχείων των συναλλαγών τους σε τρίτο.

Η ΕΤΕΚ για τις συναλλαγές που εκκαθαρίζει, παρέχει προς τα Μέλη της την υπηρεσία EMIR-TR προκειμένου να διευκολύνει τα Μέλη και τους πελάτες τους να καλύψουν τις υποχρεώσεις αναφοράς με βάση τον Κανονισμό EMIR.

Με την υπηρεσία αυτή το Εκκαθαριστικό Μέλος δύναται να αναθέτει στην ΕΤΕΚ την Αναφορά Συναλλαγών επί παραγώγων προϊόντων σύμφωνα με το άρθρο 9 του Κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου (EMIR) για τις εξής περιπτώσεις:

1. Όλων των συναλλαγών που συνάπτει το Εκκαθαριστικό Μέλος στην Αγορά Παραγώγων της ΕΧΑΕ-ΧΑ με την ΕΤΕΚ και με τους πελάτες του, για τις οποίες υπόχρεο αναφοράς είναι το Εκκαθαριστικό Μέλος
2. Των συναλλαγών που συνάπτουν οι πελάτες του Εκκαθαριστικού Μέλους, με το Εκκαθαριστικό Μέλος στην Αγορά Παραγώγων της ΕΧΑΕ-ΧΑ, για τις οποίες υπόχρεο αναφοράς είναι οι πελάτες και έχουν εξουσιοδοτήσει σχετικά το Εκκαθαριστικό Μέλος.
3. Των συναλλαγών επί παραγώγων που συνάπτει εξωχρηματιστηριακά ή σε άλλες οργανωμένες/ρυθμιζόμενες αγορές, το Εκκαθαριστικό Μέλος ή οι πελάτες του για τις οποίες υπόχρεο αναφοράς είναι το Εκκαθαριστικό Μέλος ή οι πελάτες του που έχουν εξουσιοδοτήσει σχετικά το Εκκαθαριστικό Μέλος.

Οι παραπάνω δυνατότητες δίνονται ως επιλογή στα Μέλη και αφορούν την αναφορά συναλλαγών, την αναφορά θέσεων αλλά και την αναφορά παλαιών συναλλαγών. Σημειώνεται ότι δεν δίνεται η δυνατότητα στα Μέλη να επιλέξουν την αποστολή αναφορών που περιγράφεται στα (2) ή (3) παραπάνω χωρίς να έχουν επιλέξει την αποστολή αναφορών που περιγράφεται στο (1).

Η ΕΤΕΚ σε κάθε περίπτωση, ακόμα και εάν ένα Μέλος αποφασίσει να μην χρησιμοποιήσει την υπηρεσία για την αναφορά των συναλλαγών του, θα αναφέρει το σκέλος των συναλλαγών για το οποίο είναι υπόχρεο αναφοράς με τη διαδικασία και τα στοιχεία που περιγράφονται στις επόμενες παραγράφους.

Η υπηρεσία θα παρέχεται ως εξής:

- Θα συγκεντρώνονται τα στοιχεία συναλλαγών από το σύστημα εκκαθάρισης
- Θα εμπλουτίζονται με επιπλέον στοιχεία που απαιτούνται και δηλώνονται από τους συμμετέχοντες (βλέπε παράγραφο 5)
- Θα προωθούνται στο Trade Repository
- Θα διατίθενται προς τα Μέλη για αρχειοθέτηση

Σε περίπτωση λάθους κατά την καταχώριση θα πραγματοποιείται η απαιτούμενη διόρθωση από την ΕΤΕΚ ή σε συνεργασία με το Μέλος αν απαιτείται.

Η καθημερινή ροή των αρχείων τα οποία αποστέλλονται από την ΕΤ.ΕΚ στο συνεργαζόμενο Trade Repository και θα είναι διαθέσιμα στο EM – πελάτη της υπηρεσίας, μέσω της εφαρμογής του TRC, θα περιλαμβάνει:

- Αρχείο με τις συναλλαγές που πραγματοποιήθηκαν από πελάτες του Μέλους τη συγκεκριμένη ημερομηνία συναλλαγών και θα ενσωματωθούν σε θέσεις στους αντίστοιχους λογαριασμούς θέσης των πελατών στο Μέλος.
- Αρχείο με τις τελικές θέσεις των πελατών του Μέλους, όπως αυτές διαμορφώθηκαν μετά την ενσωμάτωση των συναλλαγών της συγκεκριμένης ημερομηνίας.



Στο αρχείο με τις τελικές θέσεις θα διακρίνεται η αποτίμηση της κάθε θέσης όπως διαμορφώθηκε με βάση τις τιμές εκκαθάρισης των προϊόντων την συγκεκριμένη ημερομηνία συναλλαγών (Valuation Update), αλλά και η αποτίμηση των παρεχόμενων ενεχύρων από τον πελάτη-Λογαριασμό Θέσης, όπως αυτή έχει διαμορφωθεί με βάση τις τιμές κλεισίματος αλλά και τις παραμέτρους που ισχύουν την συγκεκριμένη ημερομηνία συναλλαγών (Collateral Update).

Σημειώνεται ότι προκειμένου να είναι δυνατή η παροχή της υπηρεσίας αναφοράς θέσεων και συναλλαγών του εκκαθαριστικού μέλους και των πελατών του, ο αντισυμβαλλόμενος του Εκκαθαριστικού Μέλους πρέπει να είναι ο κάτοχος του λογαριασμού θέσης. Αν για κάποιο μέλος δεν ισχύει το παραπάνω, δεν είναι δυνατή από την ΕΤ.ΕΚ. η παρακολούθηση των θέσεων και των συναλλαγών (αφού δεν έχει τα συγκεκριμένα στοιχεία) και επομένως δεν μπορεί να προσφέρει στα μέλη την υπηρεσία δημιουργίας και αποστολής των αναφορών.

Για συναλλαγές που δεν εκκαθαρίζονται από την ΕΤΕΚ ή εμπίπτουν στην περίπτωση της παραπάνω παραγράφου, η υπηρεσία θα προσφέρεται στα μέλη με περιορισμένη λειτουργικότητα. Συγκεκριμένα θα δίνεται δυνατότητα στα μέλη καταχώρησης των αναφορών και η προώθηση από την ΕΤΕΚ των στοιχείων αυτών προς το TR. Η γραμμογράφηση των αρχείων που αφορά τις συναλλαγές που δεν εκκαθαρίζονται στην ΕΤΕΚ περιγράφεται στην Παράγραφο 6.

4. Περιγραφή των πεδίων που θα περιλαμβάνονται στα κοινά δεδομένα των αναφορών που εκκαθαρίζονται από την ΕΤΕΚ

Στην παράγραφο αυτή αναφερόμαστε μόνο στις συναλλαγές που εκκαθαρίζονται από την ΕΤΕΚ. Στόχος είναι να περιγραφεί ο τρόπος που η ΕΤΕΚ θα αναφέρει τις συναλλαγές της προκειμένου να ακολουθείται αντίστοιχη διαδικασία από τα αντισυμβαλλόμενα της ΕΤΕΚ εκκαθαριστικά Μέλη.

4.1. Περιγραφή του κωδικού UTI

Κάθε αναφορά συναλλαγής, ή θέσης που αποστέλλεται σε TR πρέπει να έχει ένα μοναδικό κωδικό ο οποίος χρησιμοποιείται για την ταυτοποίηση της αναφοράς με την αντίστοιχη αναφορά του αντισυμβαλλόμενου μέρους. Ο κωδικός αυτός ονομάζεται Unique Trade Identifier (UTI) και θα ορίζεται με βάση τους παρακάτω κανόνες.

4.1.1. Περιγραφή του κωδικού UTI για αναφορά συναλλαγών

Όταν πρόκειται για αναφορά συναλλαγής ο UTI θα σχηματίζεται σύμφωνα με τον παρακάτω πίνακα:

Συστατικό	Μήκος	Τιμή	Παρατηρήσεις
-----------	-------	------	--------------



MIC αγοράς	7	E01XADE,E01HEDE	Σταθερή τιμή. Είναι το MIC της αγοράς.
Τύπος Αναφοράς	1	T	Σταθερή τιμή για όλες τις αναφορές συναλλαγών
Ημερομηνία Συναλλαγής	8	Η ημερομηνία συναλλαγής σε μορφή YYYYMMDD	
Κωδικός προϊόντος	16	Ο κωδικός σειράς του προϊόντος	Συμπληρώνεται με κενά χαρακτήρες «_» (underscore) στα δεξιά ώστε το συνολικό μήκος να είναι 16. Αν ο κωδικός προϊόντος έχει μεγαλύτερος μήκος, χρησιμοποιούνται μόνο οι 16 πρώτοι χαρακτήρες.
Αριθμός Συναλλαγής Εκκαθάρισης στο ΣΑΤ	18	Ο αριθμός της συναλλαγής προς εκκαθάριση (πεδίο SN, δεκαψηφίο που είναι μοναδικό μέσα σε μία ημέρα).	Συμπληρώνεται με κενά χαρακτήρες «_» (underscore) ώστε το συνολικό μήκος να είναι 18.
Αγορά ή Πώληση	1	B: για Αγορά S: για Πώληση	Ορίζεται σύμφωνα με το αν η συναλλαγή μεταξύ EM και ETEK είναι αγορά ή πώληση για το EM.
Σκέλος Συναλλαγής	1	C: Συναλλαγή μεταξύ ETEK και EM M: Συναλλαγή μεταξύ EM και Πελάτη	

4.1.2. Περιγραφή του κωδικού UTI για αναφορά θέσης

Όταν πρόκειται για αναφορά θέσης ο UTI θα σχηματίζεται σύμφωνα με τον παρακάτω πίνακα:

Συστατικό	Μήκος	Τιμή	Παρατηρήσεις
MIC αγοράς	7	E01XADE,E01HEDE	Σταθερή τιμή. Είναι το MIC της αγοράς.
Τύπος Αναφοράς	1	P	Σταθερή τιμή για όλες τις αναφορές θέσεων
Κωδικός Μέλους	7	Ο κωδικός μέλους στο σύστημα εκκαθάρισης	Σε περίπτωση που ο κωδικός έχει περισσότερα από 7 ψηφία χρησιμοποιούνται τα 7 τελευταία.
Λογαριασμός Θέσης	20	Ο κωδικός αναφοράς του λογαριασμού θέσης.	Αν το μήκος του λογαριασμού είναι μικρότερο από τους 20 χαρακτήρες θα συμπληρώνεται στα δεξιά με κενά χαρακτήρες «_» (underscore).



Κωδικός προϊόντος	16	Ο κωδικός σειράς του προϊόντος	Συμπληρώνεται με κενά χαρακτήρες «_» (underscore) στα δεξιά ώστε το συνολικό μήκος να είναι 16.
Σκέλος Θέσης	1	1: Θέση μεταξύ ΕΤΕΚ και Εκ. Μέλους 2: Θέση μεταξύ Εκ. Μέλους και Πελάτη	Δείχνει το αν αφορά τη θέση μεταξύ της ΕΤΕΚ και του ΕΜ ή του ΕΜ με τον Πελάτη

4.2. Περιγραφή του κωδικού TRN

Όταν πρόκειται για αναφορά συναλλαγής το TRN θα ταυτίζεται με τον αριθμό συναλλαγής στο κεντρικό σύστημα. Οι αναφορές που αφορούν θέσεις θα έχουν κενό το πεδίο TRN.

4.3. Περιγραφή του προϊόντος

Για τον καθορισμό των προϊόντων, στις αναφορές χρησιμοποιούνται από την ΕΤ.ΕΚ οι κωδικοί CFI και ISIN στα πεδία αναγνώρισης του προϊόντος. Αναλυτικότερη περιγραφή ακολουθεί στην παράγραφο 4.5 με τίτλο «Περιγραφή Κοινών Πεδίων για τις αναφορές της ΕΤΕΚ».

Το CFI των προϊόντων καταγράφεται στον επόμενο πίνακα ¹:

Προϊόντα	Product ID 2 (CFI)
Index Futures	FFICSX
Stock Futures	FFSPSX
Call Index Options (European)	OCEICS
Put Index Options (European)	OPEICS
Call Stock Option (American)	OCASPS

¹ (η τροποποίηση στην κωδικοποίηση των CFI θα εφαρμοσθεί από τις αναφορές της 03/07/2017 για τις συναλλαγές και θέσεις της 30/06/2017)



Put Stock Option (American)	OPASPS
Energy Futures	FCHCSX

4.4. Κωδικός LEI της ΕΤΕΚ

Ο κωδικός LEI της ΕΤΕΚ είναι ο **213800IW53U9JMJ4QR40**

4.5. Περιγραφή Κοινών Πεδίων για τις αναφορές της ΕΤΕΚ

Στον επόμενο πίνακα παρουσιάζονται τα κοινά πεδία των αναφορών όπως θα συμπληρώνονται από την ΕΤΕΚ.

Πεδίο Κανονισμού	Όνομα Πεδίου	Τρόπος συμπλήρωσης
1	Contract Type	FU = Futures OP = Option
2	Asset Class	EQ = Equity για ΧΑΔΕ, CO = Commodity για HEDE
3	Product Classification Type	C=CFI
4	Product Classification	Ο κωδικός CFI του προϊόντος
5	Product Identification Type	I=ISIN
6	Product Identification	Ο κωδικός ISIN του προϊόντος
7	Underlying Identification Type	I=ISIN για ΧΑΔΕ , Κενό για HEDE
8	Underlying Identification	Το ISIN της υποκείμενης αξίας ή δείκτη για ΧΑΔΕ , Κενό για HEDE
9	Notional currency 1	EUR
10	Notional currency 2	Κενό
11	Deliverable currency	EUR
12	Trade ID	Βλέπε παράγραφο που αφορά UTI
13	Report Tracking number	Το TRN της συναλλαγής (ΟΑΣΗΣ Trade Number), για θέσεις Κενό
14	Complex trade component ID	Κενό
15	Venue of execution	ΧΑΔΕ ,HEDE
16	Compression	N



17	Price / rate	Τιμή συναλλαγής για συναλλαγές, Τιμή Εκκαθάρισης για θέσεις
18	Price notation	U=Unit
19	Currency of price	EUR
20	Notional	Για τα ΣΜΕ: τιμή εκκαθάρισης x ποσότητα x πολλαπλασιαστή Για τα δικαιώματα: τιμή άσκησης x ποσότητα x πολλαπλασιαστή
21	Price multiplier	Πολλαπλασιαστής
22	Quantity	Αριθμός συμβολαίων συναλλαγής, Αριθμός συμβολαίων για θέσεις
23	Up-front payment	Κενό
24	Delivery type	C για ΣΜΕ και δικαιώματα σε δείκτη P για ΣΜΕ και δικαιώματα σε μετοχές
25	Execution timestamp	Ημερομηνία και ώρα συναλλαγής για συναλλαγές ή Τέλος Ημέρας για αναφορά θέσεων
26	Effective date	Ημερομηνία Συναλλαγής για αναφορά συναλλαγών ή Ημερομηνία Θέσης για αναφορά θέσεων
27	Maturity date	Ημερομηνία λήξης σειράς
28	Termination date	Κενό
29	Settlement Date	Για προϊόντα με φυσική παράδοση, η ημερομηνία της φυσικής παράδοσης, αλλιώς Κενό
30	Master Agreement type	Κενό
31	Master Agreement version	Κενό
32	Confirmation timestamp	Κενό
33	Confirmation means	N
34	Clearing obligation	Κενό για συναλλαγές, X για Θέσεις
35	Cleared	Y
36	Clearing timestamp	Όμοιο με το πεδίο execution timestamp
37	CCP	Το LEI της ΕΤΕΚ
38	Intragroup	Κενό
65	Commodity base	IN για HEDE αλλιως κενό
78	Option Type	P : Put ή C : Call , Κενό για ΣΜΕ
79	Option Exercise Style	A για Stock Option, E για Index Option Κενό για ΣΜΕ
80	Strike price (cap/floor rate)	Τιμή άσκησης για τα δικαιώματα Κενό για τα ΣΜΕ
81	Strike price notation	U =Unit για τα δικαιώματα Κενό για τα ΣΜΕ
82	Maturity date of the underlying	Κενό
93	Action type	P για τις αναφορές συναλλαγών N για τις νέες θέσεις



		M για την ενημέρωση των θέσεων C για πρόωρη λήξη των θέσεων R για διόρθωση αναφοράς
94	Level	T για συναλλαγές P για θέσεις

4.6. Περιγραφή πεδίων που αφορούν την αποτίμηση των θέσεων

Στη συνέχεια παρουσιάζεται ο τρόπος που συμπληρώνει η ΕΤΕΚ τα πεδία που αφορούν την αποτίμηση των ασφαλειών, τόσο για τις δικές της αναφορές όσο και για τις αναφορές που στέλνει εκ μέρους των μελών της και των πελατών τους που την έχουν εξουσιοδοτήσει σχετικά.

Πεδίο Κανονισμού	Όνομα Πεδίου	Τρόπος συμπλήρωσης
17	Value of contract	Για options: τελευταία τιμή κλεισίματος στο ΧΑ * Πολλαπλασιαστή * Αριθμό συμβολαίων Για futures: Settlement amount for next day Το settlement amount υπολογίζεται ως εξής: <ul style="list-style-type: none">για τις παλιές θέσεις: (τιμή κλεισίματος – τιμή κλεισίματος προηγούμενης ημέρας) * Πολλαπλασιαστή * Αριθμό Συμβολαίωνγια τις θέσεις που ανοίξαν σήμερα: (τιμή κλεισίματος – τιμή πράξης) * Πολλαπλασιαστή * Αριθμό συμβολαίων η τιμή του πεδίου μπορεί να πάρει και αρνητικές τιμές
18	Currency of the value	EUR
19	Valuation Timestamp	Η 23:59:59 της ημέρας που υπολογίσθηκε η θέση σε μορφή: YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ
20	Valuation type	C

4.7. Περιγραφή πεδίων που αφορούν τις απαιτούμενες ασφάλειες

Στη συνέχεια παρουσιάζεται ο τρόπος που συμπληρώνει η ΕΤΕΚ τα πεδία που αφορούν την αποτίμηση των ασφαλειών, τόσο για τις δικές της αναφορές όσο και για τις αναφορές που στέλνει εκ μέρους των μελών της και των πελατών τους που την έχουν εξουσιοδοτήσει σχετικά.

Σημειώνεται ότι:



- η ΕΤΕΚ συμπληρώνει τα συγκεκριμένα πεδία μόνο για τις αναφορές θέσεων και όχι σε επίπεδο αναφοράς συναλλαγών.
- ασφάλειες υπολογίζονται συνολικά για το χαρτοφυλάκιο του αντισυμβαλλόμενου και όχι για συγκεκριμένη θέση
- θεωρείται ότι σαν ασφάλεια έναντι της θέσης του μέλους έναντι της ΕΤΕΚ χρησιμοποιείται το σύνολο των ασφαλειών των Λογαριασμών Εκκαθάρισης του μέλους
- **θεωρείται ότι οι πελάτες των μελών δεν έχουν παράσχει ως ασφάλεια οτιδήποτε άλλο πέρα από ότι έχει υπολογισθεί στο σύστημα της ΕΤΕΚ ως απαιτούμενο margin για το συγκεκριμένο λογαριασμό θέσης. Σε αντίθετη περίπτωση θα πρέπει να καταχωρείται σε καθημερινή βάση και πριν τις 13:00 αρχείο με τις ασφάλειες ανά πελάτη σύμφωνα με την περιγραφή στην παράγραφο 5.2.**

Με βάση τα παραπάνω, τα σχετικά πεδία στις αναφορές θέσεων θα συμπληρώνονται ως εξής:

Πεδίο Κανονισμού	Όνομα Πεδίου	Τρόπος συμπλήρωσης
21	Collateralisation	<ul style="list-style-type: none"> • για τις αναφορές της ΕΤΕΚ με αντισυμβαλλόμενο το μέλος: "PC" • για τις αναφορές του μέλους με αντισυμβαλλόμενη την ΕΤΕΚ: "OC" • για τις αναφορές του μέλους με αντισυμβαλλόμενο τον επενδυτή: "PC" • για τις αναφορές του επενδυτή με αντισυμβαλλόμενο το μέλος: "OC"
22	Collateral portfolio	Υ
23	Collateral portfolio code	<ul style="list-style-type: none"> • για τις αναφορές της ΕΤΕΚ με αντισυμβαλλόμενο το μέλος: Κωδικός Μέλους (10-ψήφιος κωδικός ΣΑΤ) • για τις αναφορές του μέλους με αντισυμβαλλόμενη την ΕΤΕΚ: Κωδικός Μέλους (10-ψήφιος κωδικός ΣΑΤ) • για τις αναφορές του μέλους με αντισυμβαλλόμενο τον επενδυτή: Λογαριασμός Θέσης Πελάτη • για τις αναφορές του επενδυτή με αντισυμβαλλόμενο το μέλος: Λογαριασμός Θέσης Πελάτη
24	Initial Margin Posted	<ul style="list-style-type: none"> • για τις αναφορές της ΕΤΕΚ με αντισυμβαλλόμενο το μέλος: Κενό • για τις αναφορές του μέλους με αντισυμβαλλόμενη την ΕΤΕΚ: Άθροισμα των Περιθωρίων Ασφαλείας (Margin) όλων των Λογαριασμών Εκκαθάρισης • για τις αναφορές του μέλους με αντισυμβαλλόμενο τον επενδυτή: Κενό • για τις αναφορές του επενδυτή με αντισυμβαλλόμενο το μέλος: Υπολογισμένο margin για τον λογαριασμό θέσης (ή η τιμή που έχει δηλώσει το μέλος μέσω αρχείου)
25	Currency of the initial margin posted	Κενό αν το προηγούμενο πεδίο είναι κενό, αλλιώς EUR
26	Variation Margin Posted	<ul style="list-style-type: none"> • για τις αναφορές της ΕΤΕΚ με αντισυμβαλλόμενο το μέλος: <ul style="list-style-type: none"> ◦ Κενό αν το Μέλος είναι χρεωστικό



		<ul style="list-style-type: none">○ το συνολικό ποσό διακανονισμού αν το Μέλος είναι πιστωτικό τη συγκεκριμένη ημέρα• για τις αναφορές του μέλους με αντισυμβαλλόμενη την ΕΤΕΚ:<ul style="list-style-type: none">○ Κενό αν το Μέλος είναι πιστωτικό○ το συνολικό ποσό διακανονισμού αν το Μέλος είναι χρεωστικό τη συγκεκριμένη ημέρα• για τις αναφορές του μέλους με αντισυμβαλλόμενο τον επενδυτή:<ul style="list-style-type: none">○ Κενό αν ο επενδυτής είναι χρεωστικός○ το ποσό διακανονισμού του Λογαριασμού Θέσης αν ο συγκεκριμένος επενδυτής είναι πιστωτικός τη συγκεκριμένη ημέρα• για τις αναφορές του επενδυτή με αντισυμβαλλόμενο το μέλος:<ul style="list-style-type: none">○ Κενό αν ο επενδυτής είναι πιστωτικός○ το συνολικό ποσό διακανονισμού του Λογαριασμού Θέσης αν ο επενδυτής είναι χρεωστικός τη συγκεκριμένη ημέρα
27	Currency of the variation margin posted	<ul style="list-style-type: none">• Κενό αν το προηγούμενο πεδίο είναι κενό, αλλιώς EUR
28	Initial margin received	<ul style="list-style-type: none">• για τις αναφορές της ΕΤΕΚ με αντισυμβαλλόμενο το μέλος: Άθροισμα των Περιθωρίων Ασφάλισης (Margin) όλων των Λογαριασμών Εκκαθάρισης• για τις αναφορές του μέλους με αντισυμβαλλόμενη την ΕΤΕΚ: Κενό• για τις αναφορές του μέλους με αντισυμβαλλόμενο τον επενδυτή: Υπολογισμένο margin για τον λογαριασμό θέσης (ή τιμή που έχει δηλώσει το μέλος μέσω αρχείου)• για τις αναφορές του επενδυτή με αντισυμβαλλόμενο το μέλος: Κενό
29	Currency of the initial margin received	<ul style="list-style-type: none">• Κενό αν το προηγούμενο πεδίο είναι κενό, αλλιώς EUR
30	Variation Margin received	<ul style="list-style-type: none">• για τις αναφορές της ΕΤΕΚ με αντισυμβαλλόμενο το μέλος:<ul style="list-style-type: none">○ Κενό αν το Μέλος είναι πιστωτικό○ το συνολικό ποσό διακανονισμού αν το Μέλος είναι χρεωστικό τη συγκεκριμένη ημέρα• για τις αναφορές του μέλους με αντισυμβαλλόμενη την ΕΤΕΚ:<ul style="list-style-type: none">○ Κενό αν το Μέλος είναι χρεωστικό



		<ul style="list-style-type: none">○ το συνολικό ποσό διακανονισμού αν το Μέλος είναι πιστωτικό τη συγκεκριμένη ημέρα• για τις αναφορές του μέλους με αντισυμβαλλόμενο τον επενδυτή:<ul style="list-style-type: none">○ Κενό αν ο επενδυτής είναι πιστωτικός○ το ποσό διακανονισμού του Λογαριασμού Θέσης αν ο συγκεκριμένος επενδυτής είναι χρεωστικός τη συγκεκριμένη ημέρα• για τις αναφορές του επενδυτή με αντισυμβαλλόμενο το μέλος:<ul style="list-style-type: none">○ Κενό αν ο επενδυτής είναι χρεωστικός○ το συνολικό ποσό διακανονισμού του Λογαριασμού Θέσης αν ο επενδυτής είναι πιστωτικός τη συγκεκριμένη ημέρα
31	Currency of the variation margins received	<ul style="list-style-type: none">• Κενό αν το προηγούμενο πεδίο είναι κενό, αλλιώς EUR
32	Excess collateral posted	<ul style="list-style-type: none">• για τις αναφορές της ΕΤΕΚ με αντισυμβαλλόμενο το μέλος: Κενό• για τις αναφορές του μέλους με αντισυμβαλλόμενη την ΕΤΕΚ: Άθροισμα των Λογαριασμών Εκκαθάρισης μείον το άθροισμα των υπολογιζόμενων περιθωρίων ασφάλισης για όλους τους λογαριασμούς εκκαθάρισης• για τις αναφορές του μέλους με αντισυμβαλλόμενο τον επενδυτή: Κενό• για τις αναφορές του επενδυτή με αντισυμβαλλόμενο το μέλος: Πλεονάζουσες Ασφάλειες που έχει δηλώσει το Μέλος μέσω του αρχείου για το λογαριασμό θέσης του επενδυτή, ή μηδέν αν δεν έχουν δηλωθεί
33	Currency of the excess collateral posted	<ul style="list-style-type: none">• Κενό αν το προηγούμενο πεδίο είναι κενό, αλλιώς EUR
34	Excess collateral received	<ul style="list-style-type: none">• για τις αναφορές της ΕΤΕΚ με αντισυμβαλλόμενο το μέλος: Άθροισμα των ασφαλειών όλων των Λογαριασμών Εκκαθάρισης μείον το άθροισμα των υπολογιζόμενων περιθωρίων ασφάλισης για όλους τους λογαριασμούς εκκαθάρισης• για τις αναφορές του μέλους με αντισυμβαλλόμενη την ΕΤΕΚ: Κενό• για τις αναφορές του μέλους με αντισυμβαλλόμενο τον επενδυτή: Πλεονάζουσες Ασφάλειες που έχει δηλώσει το Μέλος μέσω του αρχείου για το λογαριασμό θέσης του



		επενδυτή, ή μηδέν αν δεν έχουν δηλωθεί <ul style="list-style-type: none">για τις αναφορές του επενδυτή με αντισυμβαλλόμενο το μέλος: Κενό
35	Currency of the excess collateral received	<ul style="list-style-type: none">Κενό αν το προηγούμενο πεδίο είναι κενό, αλλιώς EUR

5. Στοιχεία που απαιτούνται από τα Μέλη για την παροχή της υπηρεσίας EMIR-TR για συναλλαγές που εκκαθαρίζονται από την ΕΤΕΚ

Σε περίπτωση που το Μέλος επιλέξει να ζητήσει από την ΕΤΕΚ να αναφέρει τις συναλλαγές του, θα πρέπει εκτός από την αίτηση/σύμβαση (βλέπε παράγραφο 7) που θα πρέπει να συμπληρώσει, να ενημερώσει την ΕΤΕΚ για τα παρακάτω στοιχεία των πελατών του συμπεριλαμβανομένων και των ίδιων λογαριασμών του μέλους.

- Λογαριασμός Θέσης (position account) του πελάτη
- Αν ο πελάτης είναι φυσικό ή νομικό πρόσωπο
- LEI που αντιστοιχεί στον πελάτη (αν είναι νομικό πρόσωπο)
- Αν ο πελάτης διαμένει εκτός του Ευρωπαϊκού Οικονομικού Χώρου (EOX)
- Τη χώρα προέλευσης του πελάτη

Σημειώνεται ότι στις αναφορές που θα στέλνουμε για τα μέλη θα χρησιμοποιούμε τον κωδικό LEI των πελατών τους με την προϋπόθεση ότι μας τον έχουν δηλώσει. Σε αντίθετη περίπτωση θα θεωρείται ότι ο αντισυμβαλλόμενος είναι φυσικό πρόσωπο.

Επίσης στο πεδίο Σύμβαση με αντισυμβαλλόμενο εκτός EOX θα σημειώνουμε «ΟΧΙ» εκτός αν μας έχει δηλωθεί διαφορετικά.

Αν επιπλέον το Μέλος ζητήσει να αναφέρονται οι συναλλαγές εκ μέρους κάποιων πελατών του, θα πρέπει να ενημερώσει την ΕΤΕΚ και για τα παρακάτω επιπλέον πεδία για τους πελάτες αυτούς:

- Εταιρικός τομέας πελάτη (πεδίο 6 του ΕΕ 1247/2013)
- Χρηματοοικονομικός ή μη χαρακτήρας του πελάτη (πεδίο 7 του ΕΕ 1247/2013)
- Αν οι συναλλαγές είναι άμεσα συνδεδεμένες με εμπορική δραστηριότητα του πελάτη ή με δραστηριότητα χρηματοδότησης χρηματικών διαθεσίμων (πεδίο 15 του ΕΕ 1247/2013). Αφορά μόνο τα νομικά πρόσωπα που δεν ανήκουν στον χρηματοοικονομικό χώρο.
- Κατώφλι εκκαθάρισης (πεδίο 16 του ΕΕ 1247/2013). Συμπληρώνεται μόνο για τα νομικά πρόσωπα που δεν ανήκουν στον χρηματοοικονομικό χώρο.

Σημειώνεται τέλος ότι στο πεδίο BENEFICIARY ID θα συμπληρώνεται η ίδια τιμή με το πεδίο REPORTING COUNTERPARTY ID.



Για τις περιπτώσεις που το Μέλος υπολογίζει διαφορετικό περιθώριο ασφάλισης για έναν επενδυτή/λογαριασμό θέσης από το υπολογιζόμενο από την ΕΤΕΚ περιθώριο ασφάλισης, ή έχει πλεονάζουσες εγγυήσεις μπορεί να καταχωρεί στο σύστημα τα στοιχεία αυτά προκειμένου να ενημερωθούν σωστά τα πεδία της παραγράφου 4.7 για τις αναφορές του πελάτη. Η καταχώρηση αυτή θα πρέπει να γίνεται την επόμενη εργάσιμη της ημερομηνίας που έγινε η συναλλαγή πριν τις 13:00.

Αν δεν έχει καταχωρηθεί σχετικό αρχείο θα χρησιμοποιείται το υπολογιζόμενο από την ΕΤΕΚ περιθώριο ασφάλισης και μηδενικές πλεονάζουσες ασφάλειες για το συγκεκριμένο λογαριασμό θέσης.

Η περιγραφή του αρχείου περιλαμβάνεται στην παράγραφο 5.2.

5.1. Γραμμογράφηση στοιχείων πελατών για συναλλαγές που εκκαθαρίζονται από την ΕΤΕΚ

Προκειμένου να αναφερθούν στην ΕΤΕΚ τα παραπάνω στοιχεία, θα πρέπει να δημιουργηθεί από τα Μέλη ένα αρχείο τύπου "CSV" όπου τα πεδία θα διαχωρίζονται με «,» και θα έχει την εξής γραμμογράφηση:

A/A Πεδίου	Πεδίο	Περιγραφή
1	Κωδικός Μέλους	Ο δεκαψήφιος κωδικός του Μέλους
2	Action	A: Add, Προσθήκη νέου πελάτη U: Update, Αλλαγή στοιχείων πελάτη D: Delete, Διαγραφή πελάτη
3	Λογαριασμός Θέσης	Ο λογαριασμός θέσης (position account) του πελάτη ή του ίδιου του Μέλους αν πρόκειται για ίδιο λογαριασμό.
4	φυσικό ή νομικό πρόσωπο	L: Για νομικά πρόσωπα N: Για φυσικά πρόσωπα
5	LEI	Το LEI του δικαιούχου του λογαριασμού εκκαθάρισης αν ο δικαιούχος είναι νομικό πρόσωπο, αλλιώς κενό
6	EOX	Αφορά το πεδίο 14 του ΕΕ 1247/2013. Y: Αν ο πελάτης διαμένει εκτός του Ευρωπαϊκού Οικονομικού Χώρου (EOX) N: αλλιώς
7	Reporting	Y: Αν η ΕΤΕΚ εξουσιοδοτείται να αναφέρει τις συναλλαγές εκ μέρους του πελάτη
ΤΑ ΠΑΡΑΚΑΤΩ ΠΕΔΙΑ (8-10) ΣΥΜΠΛΗΡΩΝΟΝΤΑΙ ΜΟΝΟ ΑΝ ΤΟ ΠΕΔΙΟ REPORTING ΕΙΝΑΙ "Y" ΑΛΛΙΩΣ ΕΙΝΑΙ ΚΕΝΑ		



A/A Πεδίου	Πεδίο	Περιγραφή
8	Φύση Δραστηριότητας αντισυμβαλλόμενου	<p>F: Χρηματοοικονομικός Αντισυμβαλλόμενος</p> <p>N: Μη Χρηματοοικονομικός Αντισυμβαλλόμενος</p> <p>C: Κεντρικός Αντισυμβαλλόμενος</p> <p>O: Άλλο</p>
9	Εταιρικός τομέας πελάτη	<p>Αφορά το πεδίο 6 του ΕΕ 1247/2013</p> <p>A: Ασφαλιστική επιχείρηση με άδεια λειτουργίας σύμφωνα με την οδηγία 2002/83/ΕΚ</p> <p>C: Πιστωτικό ίδρυμα με άδεια λειτουργίας σύμφωνα με την οδηγία 2006/48/ΕΚ</p> <p>F: Επιχείρηση επενδύσεων σύμφωνα με την οδηγία 2004/39/ΕΚ</p> <p>I : Ασφαλιστική επιχείρηση με άδεια λειτουργίας σύμφωνα με την οδηγία 73/239/ΕΟΚ</p> <p>L: Οργανισμός εναλλακτικών επενδύσεων διαχειριζόμενος από ΔΟΕΕ με άδεια λειτουργίας ή καταχώριση σύμφωνα με την οδηγία 2011/61/ΕΕ</p> <p>O: Ίδρυμα επαγγελματικών συνταξιοδοτικών παροχών κατά την έννοια του άρθρου 6 στοιχείο α) της οδηγίας 2003/41/ΕΚ·</p> <p>R: Αντασφαλιστική επιχείρηση με άδεια λειτουργίας σύμφωνα με την οδηγία 2005/68/ΕΚ</p> <p>U: ΟΣΕΚΑ και η διαχειριστική εταιρεία του σύμφωνα με την οδηγία 2009/65/ΕΚ</p> <p>Κενό: στην περίπτωση που το προηγούμενο πεδίο έχει συμπληρωθεί με O.</p> <p>Στην περίπτωση που το προηγούμενο πεδίο έχει συμπληρωθεί με N τότε οι τιμές μπορούν να είναι οι παρακάτω:</p> <ul style="list-style-type: none">1= γεωργία, δασοκομία και αλιεία2=εξόρυξη και λατομεία3=βιομηχανοποίηση4=παροχή ηλεκτρικού ρεύματος, φυσικού αερίου, ατμού και κλιματισμού5=υδροδότηση, αποχέτευση, διαχείριση αποβλήτων και δραστηριότητες αποκατάστασης6=κατασκευή7=χονδρικό και λιανικό εμπόριο, επισκευή αυτοκινήτων και μοτοσικλετών8=μεταφορά και αποθήκευση



A/A Πεδίου	Πεδίο	Περιγραφή
		9=διαμονή και δραστηριότητες παροχής υπηρεσιών φαγητού 10=πληροφόρησης και επικοινωνίας 11=χρηματοπιστωτικές και ασφαλιστικές δραστηριότητες 12=δραστηριότητες ακίνητης περιουσίας 13=επαγγελματικές, επιστημονικές και τεχνικές δραστηριότητες 14=διοικητικές και υποστηρικτικές δραστηριότητες παροχής υπηρεσιών 15=δημόσια διοίκηση και άμυνα · υποχρεωτική κοινωνική ασφάλιση 16=εκπαίδευση 17=δραστηριότητες στον τομέα της ανθρώπινης υγείας και της κοινωνικής εργασίας 18=τέχνες, ψυχαγωγία και αναψυχή 19=άλλες δραστηριότητες παροχής υπηρεσιών 20= δραστηριότητες των νοικοκυριών ως εργοδότες · μη διαφοροποιημένες δραστηριότητες παραγωγής οικιακών προϊόντων και υπηρεσιών για ίδια χρήση 21=δραστηριότητες εξωεδαφικών οργανώσεων και οργανισμών
10	Σύνδεση με εμπορική δραστηριότητα	Αφορά το πεδίο 15 του ΕΕ 1247/2013 Για τα νομικά πρόσωπα που δε ανήκουν στον χρηματοοικονομικό χώρο συμπληρώνεται με: Y: Αν οι συναλλαγές είναι άμεσες συνδεδεμένες με εμπορική δραστηριότητα του πελάτη ή με δραστηριότητα χρηματοδότησης χρηματικών διαθεσίμων. (πεδίο 15 του ΕΕ 1247/2013). N: Αλλιώς Κενό: για τα νομικά πρόσωπα που ανήκουν στον χρηματοοικονομικό χώρο.
11	Κατώφλι εκκαθάρισης	Αφορά το πεδίο 16 του ΕΕ 1247/2013. Για τα νομικά πρόσωπα που δε ανήκουν στον χρηματοοικονομικό χώρο συμπληρώνεται με: Y: Αν ο υπόχρεος υπερβαίνει το κατώφλι εκκαθάρισης όπως αναφέρεται στο Άρθρο 10 παρ. 2 του EMIR N: Αλλιώς Κενό: για τα νομικά πρόσωπα που ανήκουν στον χρηματοοικονομικό χώρο.
12	Χώρα προέλευσης δικαιούχου	Ο διψήφιος λατινικός κωδικός που δηλώνει τη χώρα προέλευσης του δικαιούχου.



Το παραπάνω αρχείο θα πρέπει να χρησιμοποιείται κάθε φορά που υπάρχει μεταβολή στα στοιχεία των πελατών του Μέλους ώστε να παράγονται σωστά οι αναφορές.

Επιπλέον, σε περίπτωση που το πεδίο «Reporting» είναι «Υ» το Μέλος δηλώνει ότι έχει την απαιτούμενη εξουσιοδότηση για την αναφορά των συναλλαγών του πελάτη και παράλληλα παρέχει την αντίστοιχη εξουσιοδότηση στην ΕΤΕΚ.

ΠΡΟΣΟΧΗ: Στο αρχείο θα πρέπει να περιλαμβάνεται και μία πρώτη σειρά με τις επικεφαλίδες. Η κωδικοποίηση του αρχείου θα πρέπει να είναι UTF-8.

Το παραπάνω αρχείο θα καταχωρείται από εξουσιοδοτημένο χρήστη του μέλους στη σχετική web εφαρμογή στη διεύθυνση: <https://tr-portal.helex.gr/>

5.2. Γραμμογράφηση ασφαλειών ανά πελάτη (λογαριασμό θέσης) για συναλλαγές που εκκαθαρίζονται από την ΕΤΕΚ

Προκειμένου να αναφερθούν στην ΕΤΕΚ τα παραπάνω στοιχεία, θα πρέπει να δημιουργηθεί από τα Μέλη ένα αρχείο τύπου "CSV" όπου τα πεδία θα διαχωρίζονται με «,» και θα έχει την εξής γραμμογράφηση:

A/A Πεδίου	Πεδίο	Περιγραφή
1	Ημερομηνία	Η ημερομηνία συναλλαγών σύμφωνα με το πρότυπο ISO 8601 (μορφή YYYY-MM-DD).
2	Μέλος	Ο 10-ψήφιος κωδικός του Μέλους στο ΣΑΤ
3	Λογαριασμός Θέσης	Ο λογαριασμός θέσης (position account) του πελάτη ή του ίδιου του Μέλους αν πρόκειται για ίδιο λογαριασμό
4	Περιθώριο ασφάλισης	Αριθμός με έως και πέντε (5) δεκαδικά ψηφία. Αν υπάρχει υποδιαστολή πρέπει να χρησιμοποιείται η τελεία «.»
5	Νόμισμα περιθωρίου ασφάλισης	Ο ISO 4217 κωδικός του νομίσματος (EUR για το Ευρώ)
6	Πλεονάζουσες ασφάλειες	Αριθμός με έως και πέντε (5) δεκαδικά ψηφία. Αν υπάρχει υποδιαστολή πρέπει να χρησιμοποιείται η τελεία «.»
7	Νόμισμα πλεοναζουσών ασφαλειών	Ο ISO 4217 κωδικός του νομίσματος (EUR για το Ευρώ)

ΠΡΟΣΟΧΗ: Στο αρχείο θα πρέπει να περιλαμβάνεται και μία πρώτη σειρά με τις επικεφαλίδες. Η κωδικοποίηση του αρχείου θα πρέπει να είναι UTF-8.

Το παραπάνω αρχείο θα καταχωρείται από εξουσιοδοτημένο χρήστη του μέλους στη σχετική web εφαρμογή στη διεύθυνση: <https://tr-portal.helex.gr/> .



6. Στοιχεία για την παροχή της υπηρεσίας EMIR-TR για συναλλαγές που δεν εκκαθαρίζονται από την ΕΤΕΚ

6.1. Γραμμογράφηση αρχείου αναφορών

Για τα Μέλη που θέλουν μέσω της υπηρεσίας της ΕΤΕΚ να αναφέρουν συναλλαγές που εκτελούνται είτε εξωχρηματιστηριακά είτε σε άλλες αγορές, θα δίνεται αυτή η δυνατότητα με την προϋπόθεση ότι θα χρησιμοποιούν τις απαιτούμενες προδιαγραφές του συνεργαζόμενου με την ΕΤ.ΕΚ Trade Repository, οι οποίες και θα τους διατεθούν από την τελευταία.

6.2. Γραμμογράφηση αρχείου με LEI πελατών για συναλλαγές εκτός ΕΤΕΚ

Σε αυτή την περίπτωση το μόνο στοιχείο που απαιτείται είναι το LEI του πελάτη, ώστε να προστεθεί στη λίστα με τα LEI των πελατών που έχουν τη δυνατότητα να αποστέλλουν αναφορές μέσω της ΕΤΕΚ.

Προκειμένου να αναφερθούν στην ΕΤΕΚ τα LEIs των πελατών αυτών, θα πρέπει να δημιουργηθεί από τα Μέλη ένα αρχείο τύπου "CSV" όπου τα πεδία θα διαχωρίζονται με «,» και θα έχει την εξής γραμμογράφηση:

A/A Πεδίου	Πεδίο	Περιγραφή
1	Lei	Το LEI του πελάτη
2	Name	Η Επωνυμία του πελάτη
3	Status	Το status της εγγραφής. Παίρνει δύο τιμές : ACT: αν πρόκειται για νέα εγγραφή CANC: αν πρόκειται για διαγραφή εγγραφής
4	Effective date	Η ημερομηνία της μεταβολής

ΠΡΟΣΟΧΗ: Στο αρχείο θα πρέπει να περιλαμβάνεται και μία πρώτη σειρά με τις επικεφαλίδες. Η κωδικοποίηση του αρχείου θα πρέπει να είναι UTF-8.

7. Αίτηση για τη συμμετοχή Μέλους στην Υπηρεσία

Στον ιστότοπο της υπηρεσίας στο web site της ΕΧΑΕ:

<http://www.athexgroup.gr/el/emir-tr-service>



είναι αναρτημένη η αίτηση για την συμμετοχή στην υπηρεσία μαζί με τους γενικούς όρους και πληροφορίες σχετικά με τις χρεώσεις.