



---

**Έκδοση Σ.Α.Τ. v.4.1.0**

***DSS Version 4.1.0***

**Σύστημα Εκκαθάρισης / *Clearing System***

**Οδηγίες & Σενάρια Δοκιμών**

***Guidelines & Mock Scenarios***

**Υπηρεσίες Έμμεσης Εκκαθάρισης για την Αγορά Παραγώγων στο  
Σύστημα Εκκαθάρισης**

***Clearing System/ Derivatives Market/ Indirect Clearing Services***

**ΔΙΕΥΘΥΝΣΗ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΗΣ ΚΙΝΔΥΝΟΥ & ΕΚΚΑΘΑΡΙΣΗΣ / *RISK MANAGEMENT & CLEARING DIVISION***

**Αθήνα, Δεκέμβριος 2017 / *Athens, December 2017***

---

## Πίνακας Περιεχομένων

---

<b>1.</b>	<b>Εισαγωγή / Introduction .....</b>	<b>2</b>
<b>2.</b>	<b>Γενικές Οδηγίες / General Guidelines.....</b>	<b>3</b>
2.1.	Χρονισμός Συστήματος Εκκαθάρισης / Clearing System Schedule .....	3
2.2.	Πρόσβαση στο Σ.Α.Τ. / Access to DSS .....	5
<b>3.</b>	<b>Δεδομένα στο περιβάλλον Δοκιμών / UAT System Data .....</b>	<b>7</b>
3.1.	Δεδομένα στο Σύστημα Εκκαθάρισης / Clearing System Data .....	7
<b>4.</b>	<b>Σενάρια Δοκιμών / Mock Scenarios.....</b>	<b>8</b>
4.1.	Λογαριασμός Εκκαθάρισης Έμμεσης Πελατείας / Indirect Clearing Account.....	8
<b>5.</b>	<b>Στοιχεία Επικοινωνίας / Contact Details .....</b>	<b>20</b>
<b>6.</b>	<b>Αναφορά Προβλημάτων / Problems Report .....</b>	<b>21</b>

## 1. Εισαγωγή / *Introduction*

---

Στο πλαίσιο του Κανονισμού (ΕΕ) 2017/2154 «για τη συμπλήρωση του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου όσον αφορά ρυθμιστικά τεχνικά πρότυπα για τις ρυθμίσεις έμμεσης εκκαθάρισης», η ΕΤ.ΕΚ προγραμματίζει μια σειρά κύκλων δοκιμών από τις **11 Δεκεμβρίου έως και τις 15 Δεκεμβρίου 2017** με σκοπό την εξοικείωση των Χρηστών με τη νέα λειτουργικότητα του Συστήματος Εκκαθάρισης και την προσαρμογή των πληροφοριακών συστημάτων των εμπλεκόμενων φορέων.

Για την αποτελεσματικότερη διεξαγωγή των δοκιμών στο παρόν κείμενο περιλαμβάνονται τα εξής:

- Γενικές οδηγίες που αφορούν τον τρόπο σύνδεσης στο περιβάλλον δοκιμών της εφαρμογής Σ.Α.Τ.
- Οδηγίες – Σενάρια που θα πρέπει να ακολουθήσουν οι Χρήστες κατά την διάρκεια των δοκιμών

Η συμβολή και η ενεργός συμμετοχή των Εκκαθαριστικών Μελών της Αγοράς Παραγώγων στις δοκιμές σε πραγματικές συνθήκες εργασίας, κρίνεται απαραίτητη.

*In the context of Regulation (EU) 2017/2154 “supplementing Regulation (EU) No 600/2014 of the European Parliament and of the Council with regard to regulatory technical standards on indirect clearing arrangements”, ATHEXClear is planning a sequence of test sessions from December 11<sup>th</sup> to December 15<sup>th</sup>, in order for the Users to familiarize with Clearing System’s new functionality and the adaptation of concerned/involved parties’ IT systems.*

*For effective test performance, this text includes:*

- *General Guidelines concerning the connectivity at the test environment of Dematerialised Securities System application*
- *Guidelines-Scenarios followed by Users during the trial rounds*

*The contribution and active participation of Derivatives Market Clearing Members in these tests under actual working conditions, is deemed necessary.”*

## 2. Γενικές Οδηγίες / *General Guidelines*

### 2.1. Χρονισμός Συστήματος Εκκαθάρισης / *Clearing System Schedule*

Το δοκιμαστικό περιβάλλον του ΣΑΤ θα είναι διαθέσιμο κατά τις ημέρες των δοκιμών από ώρα 09:00π.μ. έως 20:00 μ.μ.

*The DSS test environment will be available on testing dates, from 09:00 am to 20:00 pm. (Athens Time).*

Ο χρονισμός των ενεργειών που θα πραγματοποιηθούν από την ΕΤ.ΕΚ και τα Μέλη είναι ο παρακάτω:

*The AthexClear's Mock Sessions Timeline will be as follows:*

Έναρξη / <i>Start</i>	Λήξη / <i>Finish</i>	Ενέργειες / <i>Actions</i>
10:30	10:30	Αποστολή αρχικών ορίων από το Σύστημα Εκκαθάρισης (Σ.Ε.) στο ΟΑΣΗΣ <i>DSS sends the initial daily credit limits to OASIS</i>
10:50	16:30	Φόρτωση συναλλαγών από το Σύστημα Διαπραγμάτευσης στο Σ.Ε. σε πραγματικό χρόνο <i>Real time loading of transactions from OASIS to DSS</i>
10:30	16:30	Δυνατότητα δέσμευσης collaterals υπέρ ΕΤ.ΕΚ <i>Collateral Pledge</i>
11:00	16:30	Δυνατότητα αποδέσμευσης των collaterals υπέρ ΕΤΕΚ <i>Collateral Unpledge</i>
10:50	16:30	Λήξη δυνατότητας καταχώρισης ειδικής σήμανσης για real time διακανονισμό σε προϊόντα δανεισμού τίτλων <i>Expiration option flag registration for real time settlement in securities lending products</i>
10:50	16:30	Ενδοημερήσιος υπολογισμός κινδύνου ανά Λογαριασμό Εκκαθάρισης <i>Intraday margin calculation per clearing account</i> Κύκλοι υπολογισμού κινδύνου εκτελούνται ανά 5 λεπτά. <i>Intraday margin calculation per clearing account every 5 minutes</i>
16:30	16:45	Επιβεβαίωση της φόρτωσης των συναλλαγών από το ΟΑΣΗΣ στο Σύστημα Εκκαθάρισης

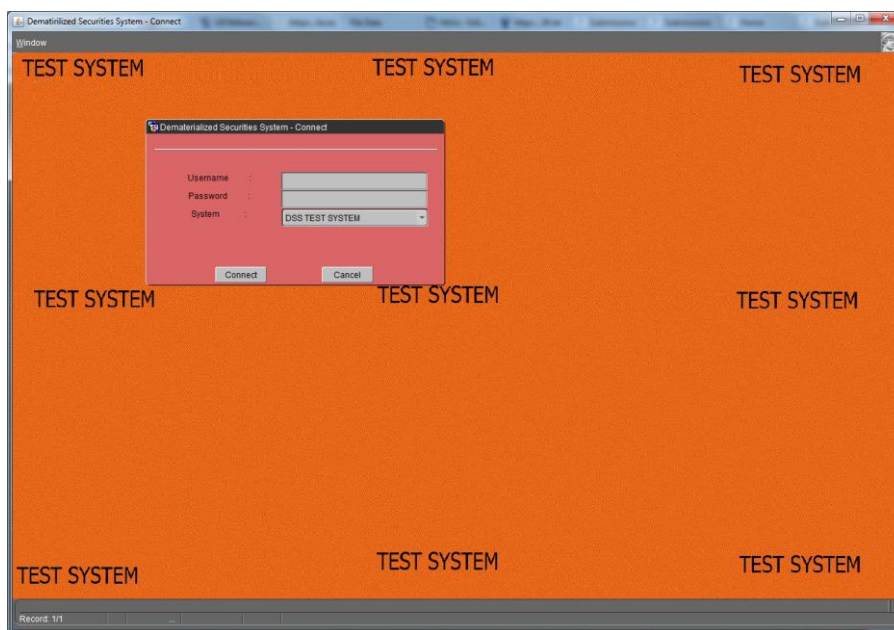
		<i>Confirmation of loading transactions to DSS from OASIS</i>
16:30	17:00	Δυνατότητα πρότασης για διάρθρωση συναλλαγών από Μέλη Διαπραγματεύσεως προς Εκκαθαριστικά Μέλη. <i>Time period for any changes on the structure of transactions file by trading member to clearing member.</i>
10:50	17:00	Δυνατότητα εξασκήσεως σε δικαιώματα προαίρεσης επί μετοχών καθώς και ακυρώσεις των αιτήσεων εξάσκησης. <i>Time period for options exercises and cancelations of exercises</i>
16:30	17:15	Δυνατότητα μετάθεσης εκκαθάρισης και αποδοχή μετάθεσης από Εκκαθαριστικά Μέλη. <i>Time period for Give Up /Take Up</i>
16:30	17:15	Δυνατότητα για διάρθρωση συναλλαγών από τα Εκκαθαριστικά Μέλη. <i>Time period for any changes on the structure of transactions file by clearing member.</i>
11:00	17:15	Δυνατότητα αίτησης μεταφοράς θέσεων από ένα ΕΜ σε ένα άλλο καθώς και αποδοχή των αιτήσεων μεταφοράς από άλλα Εκκαθαριστικά Μέλη. <i>Time period for position transfers between two Clearing Members.</i>
11:00	17:15	Δυνατότητα μεταφοράς θέσεων από ένα Υπολογαριασμό Εκκαθάρισης σε έναν άλλο του ίδιου του ΕΜ που αιτήθηκε τη μεταφορά θέσης. <i>Time period for position transfers between two Sub Accounts of the same Clearing Member.</i>
17:00	17:15	Υπολογισμός τιμών εκκαθάρισης <i>Fixing Prices Calculation</i>
17:15	17:20	Οριστικοποίηση των μεταφορών θέσεων <i>Finalization of Position Transfers</i>
17:20	17:25	Οριστικοποίηση των συναλλαγών <i>Finalization of Positions</i>
17:25	17:45	Υπολογισμός ημερήσιου χρηματικού διακανονισμού και προμηθειών (Υπολογισμός του Mark To Market) <i>Calculation of daily settlement and fees amounts (Mark To Market)</i>

17:45	18:00	<ul style="list-style-type: none"> <li>Αποτίμηση των collaterals που έχουν κατατεθεί για το ΛΕ</li> <li>Υπολογισμός Κινδύνου &amp; Πιστωτικών Ορίων (margin)</li> <li><i>Collateral valuation</i></li> <li><i>Margin &amp; Credit Limits Calculation</i></li> </ul>
-------	-------	---

## 2.2. Πρόσβαση στο Σ.Α.Τ. / Access to DSS

Για την πραγματοποίηση των δοκιμών θα πρέπει να συνδεθείτε στο ΣΑΤ μέσα από έναν web browser (προτιμάται Internet Explorer ή Firefox), χρησιμοποιώντας τα παρακάτω URL:

- <https://dssmock.athexnet.gr> (για πρόσβαση μέσω **ATHEXnet** ή **Intranet**).
- <https://Webdssmock.athexgroup.gr> (για πρόσβαση μέσω **Internet**)



Στη Φόρμα που θα εμφανιστεί θα πρέπει να συμπληρώσετε τα παρακάτω πεδία ως εξής:

«**Username**»: θα χρησιμοποιήσετε το user name της παραγωγής

«**Password**»: θα χρησιμοποιήσετε το password της παραγωγής που ίσχυε στις 10/11/2017

Αναλυτικές οδηγίες για την τεχνική προετοιμασία του σταθμού εργασίας που θα χρησιμοποιηθεί περιλαμβάνονται στο κείμενο «**Οδηγίες Παραμετροποίησης Client Συστήματος**» που είναι διαθέσιμο και στην ιστοσελίδα μας και συγκεκριμένα <https://www.athexgroup.gr/el/members-area-technical-specifications-post-trading>.

Να σημειωθεί ότι ο κωδικός πρόσβασης που θα χρησιμοποιηθεί για την πρόσβαση στο δοκιμαστικό περιβάλλον θα είναι αυτός που ίσχυε στο περιβάλλον παραγωγής κατά την 10/11/2017.

*In order to connect to the DSS please use a Web Browser (Internet Explorer and Firefox are supported) using the following URL:*

- <https://dssmock.athexnet.gr> (for access via **ATHEXnet** or **Intranet**)
- <https://Webdssmock.athexgroup.gr> (for access via **Internet**)

*In the connecting form the following fields should be completed accordingly:*

**"User name"**: fill in the production's user name

**"Password"**: fill in the production's password which active 10/11/2017

*Detailed technical information regarding the workstation requirements are provided in the document «**DSS-Guidelines for client workstation setup**» which is available at <https://www.athexgroup.gr/el/members-area-technical-specifications-post-trading>*

### 3. Δεδομένα στο περιβάλλον Δοκιμών / UAT System Data

---

#### 3.1. Δεδομένα στο Σύστημα Εκκαθάρισης / Clearing System Data

Τα δεδομένα που αφορούν τους Λογαριασμούς Εκκαθάρισης στο Δοκιμαστικό Περιβάλλον του Σ.Α.Τ. για την Αγορά Αξιών και για την Αγορά Παραγώγων θα είναι ίδια με αυτά του συστήματος παραγωγής της Παρασκευής 10/11/2017.

*Data concerning Clearing Accounts in Test Environment for both Cash & Derivatives Markets will be the same as the production system of Friday 10/11/2017.*

Όλοι οι υφιστάμενοι Λογαριασμοί Εκκαθάρισης Ιδίου, Πελατείας, Πελάτη θα χαρακτηριστούν από την ΕΤ.ΕΚ ως «Direct» (Άμεσος) και «Net» (ο υπολογισμός περιθωρίου ασφάλισης θα πραγματοποιείται συμψηφιστικά όπως και σήμερα).

*All existing Client, OWN & Clientele Clearing Accounts, will be designated by ATHEXClear as Direct and Net (the margin calculation will be compensated as today).*

Όσα Εκκαθαριστικά Μέλη της Αγοράς Παραγώγων παρέχουν υπηρεσίες έμμεσης εκκαθάρισης πρέπει να έχουν Λογαριασμό Εκκαθάρισης Έμμεσης Πελατείας (Gross ή Net) και να α) προβούν σε άνοιγμα Λογαριασμού Ασφαλειών Πελατείας επ' ονόματι του Εκκαθαριστικού Μέλους, β) εκδηλώσουν την πρόθεση τους αποστέλλοντας mail στο [Clearing&SettlementDpt@athexgroup.gr](mailto:Clearing&SettlementDpt@athexgroup.gr) ώστε η ΕΤ.ΕΚ να προβεί σε άνοιγμα Λογαριασμού Εκκαθάρισης Έμμεσης Πελατείας κατά την πρώτη ημέρα έναρξης των δοκιμών **11/12/2017**.

*Derivatives Market Clearing Members providing indirect clearing services must maintain an Indirect Clearing Account (Gross or Net) and a) create Collateral Account on behalf of the Clearing Member b) express their intention by sending mail to [Clearing&SettlementDpt@athexgroup.gr](mailto:Clearing&SettlementDpt@athexgroup.gr) so that ATHEXClear will create an Indirect Clientele Clearing Account on the first day of the test session (11/12/2017).*

Επίσης το Εκκαθαριστικό Μέλος δύναται να αιτηθεί για υφιστάμενο/ους Λογαριασμό/ους Εκκαθάρισης Πελατείας τη μεταβολή του τρόπου υπολογισμού περιθωρίου ασφάλισης γνωστοποιώντας στην ΕΤ.ΕΚ :

- α) τον κωδικό του Λογαριασμού Εκκαθάρισης Πελατείας
- β) τον κάτοχο του Λογαριασμού Εκκαθάρισης Έμμεσης Πελατείας ή το δικαιούχο του Λογαριασμού Εκκαθάρισης Έμμεσης Πελατείας και
- γ) τον ΝΕΟ τρόπο υπολογισμού του περιθωρίου ασφάλισης (Gross ή Net) μέσω mail στο [Clearing&SettlementDpt@athexgroup.gr](mailto:Clearing&SettlementDpt@athexgroup.gr).

*Also, the Clearing Member may apply for a change in the margin calculation type for existing Clientele Clearing Account(s) by informing ATHEXClear for:*

- (a) The Clientele Clearing Account code*
- (b) The holder of the Indirect Clientele Clearing Account or the beneficiary of the Indirect Clientele Clearing Account and*
- c) The New Calculation Type (Gross or Net) via mail to [Clearing&SettlementDpt@athexgroup.gr](mailto:Clearing&SettlementDpt@athexgroup.gr).*



## 4. Σενάρια Δοκιμών / Mock Scenarios

Προκειμένου να εξασφαλιστεί η επιτυχής ολοκλήρωση της δοκιμής παρακαλούνται όλα τα Εκκαθαριστικά Μέλη της Αγοράς Παραγώγων να συμμετάσχουν ακολουθώντας τις παρακάτω οδηγίες.

*DSS Operators are requested to follow all the actions below, in order to ensure the successful completion of the test session.*

### 4.1. Λογαριασμός Εκκαθάρισης Έμμεσης Πελατείας / Indirect Clearing Account

Στον παρακάτω πίνακα, περιγράφονται οι προτεινόμενες δοκιμές:

*The proposed actions are described to the following table:*

Ημερομηνία <i>Date</i>	Οθόνες <i>Screens</i>	Σενάρια <i>Scenarios</i>
11/12/2017	Custody → Functions → Inv. Shares Sec. Accounts → <b>Application for Investor's Account and Share</b>	<p><b>Άνοιγμα Λογαριασμού Αξιών «Ασφαλειών Πελατείας»</b> <i>Create a Collateral Securities Account</i></p> <p>Τα Εκκαθαριστικά Μέλη πρέπει να προβούν σε άνοιγμα Λογαριασμού Αξιών Ασφαλειών πελατείας επ' ονόματι του Εκκαθαριστικού Μέλους.</p> <p><i>Clearing Members have to create Collateral Securities Account. A Collateral Securities Account can be created the same way a simple Securities Account is created.</i></p>
11/12/2017	Custody → Functions → Inv. Shares Sec. Accounts → <b>Authorization of Use for Account</b>	<p><b>Δήλωση χρήσης Λογαριασμού Αξιών Ασφαλειών Πελατείας</b> <i>Authorization of use of the Clientele Collateral Securities Account</i></p> <p>Το Εκκαθαριστικό Μέλος μετά τη δήλωση χρήσης αποστέλλει με mail στο <a href="mailto:Clearing&amp;SettlementDpt@athexgroup.gr">Clearing&amp;SettlementDpt@athexgroup.gr</a> το αίτημα για άνοιγμα Λογαριασμού Εκκαθάρισης Έμμεσης Πελατείας γνωστοποιώντας :</p> <p>α) τον κάτοχο του Λογαριασμού Εκκαθάρισης Έμμεσης Πελατείας ή το δικαιούχο του Λογαριασμού Εκκαθάρισης Έμμεσης Πελατείας</p> <p>β) τον τρόπο υπολογισμού του περιθωρίου ασφάλισης (NET ή GROSS)</p> <p>γ) το Λογαριασμό Ασφαλειών Πελατείας</p> <p><i>The Clearing Member after the</i></p>

Ημερομηνία <i>Date</i>	Οθόνες <i>Screens</i>	Σενάρια <i>Scenarios</i>
		<p><i>Authorization of Use sends via email to <a href="mailto:Clearing&amp;SettlementDpt@athexgroup.gr">Clearing&amp;SettlementDpt@athexgroup.gr</a> application for the creation of the Indirect Clientele Clearing Account by informing ATHEXClear for:</i></p> <p><i>(a) The holder of the Indirect Clientele Clearing Account or the beneficiary of the Indirect Clientele Clearing Account and</i></p> <p><i>b) The Calculation Type (Gross or Net)</i></p> <p><i>c) The Collateral Account</i></p>
11/12/2017	Risk Management → Functions → Clearing Account	<p><b>Άνοιγμα Υπολογαριασμού Εκκαθάρισης (για απόδοση πιστωτικού ορίου).</b></p> <p><i>Create of a Clearing Sub Account for credit limit provision.</i></p> <p>Από την οθόνη αυτή δίδεται η δυνατότητα στο Εκκαθαριστικό Μέλος να δημιουργήσει νέο / νέους Υπολογαριασμούς με μορφή ΧΧ00 κάτω από Λογαριασμό Εκκαθάρισης Πελατείας ή Πελάτη και να δηλώσει το ποσοστό του κάθε υπολογαριασμού εκκαθάρισης.</p> <p><i>This screen is used in order to create Sub Accounts, in XX00 form, related with a Clientele/Client Clearing Account and declare the percentage of the credit limit for each Clearing Sub Account.</i></p>
11/12/2017	Risk Management → Functions → <b>Clearing Account - Trading Member Relations</b>	<p><b>Συσχέτιση Λογαριασμού Εκκαθάρισης / Υπολογαριασμού Εκκαθάρισης με Μέλος Διαπραγμάτευσης &amp; απόδοσης ποσοστών.</b></p> <p><i>Relation between Clearing Accounts / Clearing Sub-Accounts and output of credit limits percentages.</i></p> <p>Τα ΕΜ (ΑΕΜ/ ΓΕΜ) έχουν τη δυνατότητα να δηλώσουν το ποσοστό του κάθε Υπολογαριασμού το οποίο αποδίδουν στο Μέλος Διαπραγμάτευσης (για Α.Ε.Μ.) ή τα Μέλη Διαπραγμάτευσης (για Γ.Ε.Μ) το οποίο δεν μπορεί να υπερβαίνει το 100% του Λογαριασμού Εκκαθάρισης.</p> <p>Επίσης δηλώνει την πρόθεση του για «χειροκίνητη ή αυτόματη» καταχώριση του ποσοστιαίου επιμερισμού του συνολικού διαθέσιμου ορίου Λογαριασμού Εκκαθάρισης για κάθε Υπολογαριασμό &amp; Μ.Δ.</p> <p><i>Clearing Members (DCM/GCM) must be able to allocate the credit limit percentage for each Clearing Sub Account, for one or more Trading Members, which cannot exceed 100% of the Clearing's Account available credit</i></p>

Ημερομηνία <i>Date</i>	Οθόνες <i>Screens</i>	Σενάρια <i>Scenarios</i>
		<p><i>limit.</i></p> <p><i>In addition of the above the Clearing Member can choose between manual or automatic credit limit allocation for every Clearing Sub Account and Trading Member.</i></p>
11/12/2017	Derivatives Clearing → Environment → <b>Position Accounts</b>	<p><b>Λογαριασμός Θέσης</b> <b><i>Position Account</i></b></p> <p>Από την οθόνη αυτή δίδεται η δυνατότητα στα Εκκαθαριστικά Μέλη να ενεργοποιούν / απενεργοποιούν Λογαριασμό θέσης για κάθε επενδυτή και να συσχετίζουν τον αντίστοιχο Κωδικό Διαπραγμάτευσης σε Μέλος Διαπραγμάτευσης.</p> <p>Για να γίνει αποδεκτή αυτή η καταχώριση θα πρέπει προηγουμένως το Εκκαθαριστικό Μέλος να έχει προβεί σε δήλωση χρήσης του Λογαριασμού Αξιών.</p> <p><i>From this screen the Clearing Member can create / deactivate Position Accounts for an investor and relate the respective trading code for a Trading Member. In order this registration to be eligible the Clearing Member should previously make a declaration of use of a Securities Account.</i></p> <p>Οι τύποι Λογαριασμού Θέσης που ανοίγονται από τα Εκκαθαριστικά Μέλη είναι:</p> <p>«1 – Investor Position Account» και «2 - Agent Position Account».</p> <p><i>Types of Position Account can be created from a Clearing Member are:</i></p> <p><b><i>1 – Investor Position Account &amp;</i></b> <b><i>2 - Agent Position Account</i></b></p> <p>Η δημιουργία Λογαριασμού Θέσης με τύπο «2 - Agent Position Account» αφορά Κωδικό Διαχείρισης ή Κωδικό Διαμεσολαβητή.</p> <p><b><i>Position Account type «2– Agent Position Account» creation, concerns Intermediary Account</i></b></p>
11/12/2017		<p>Σε κάθε νέο Λογαριασμό Εκκαθάρισης Έμμεσης Πελατείας θα καταχωρηθούν από την ΕΤ.ΕΚ πρόσθετες ασφάλειες με τη μορφή μετρητών αξίας 1.000.000</p>

Ημερομηνία <i>Date</i>	Οθόνες <i>Screens</i>	Σενάρια <i>Scenarios</i>
		<i>Every new Indirect Clearing Account will be credited with an amount of 1.000.000€ by ATHEXclear.</i>
11/12/2017	Custody → Functions → Transfers → <b>Transfer to/ from Customer Collateral Account</b>	<p><b>Μεταφορά Αξιών από /σε Λογαριασμό Ασφαλειών</b>  <i>Transfer from/ to Customer Collateral Account</i></p> <p>Από την οθόνη αυτή γίνεται η μεταφορά Κινητών Αξιών από το Λογαριασμό Αξιών του πελάτη προς τον Λογαριασμό Ασφαλειών Πελατείας του Εκκαθαριστικού Μέλους και το αντίστροφο.</p> <p><i>From this screen a Clearing Member can transfer securities from an investor's securities account to a Collateral Securities Account and opposite.</i></p> <p>Η μεταφορά διενεργείται με διακριτές κινήσεις :</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• «<b>31 – 000055</b> - ΜΕΤΑΦΟΡΑ ΔΙΑΘΕΣΙΜΩΝ ΣΕ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟ ΑΣΦΑΛΕΙΩΝ ΠΕΛΑΤΕΙΑΣ»</li> <li>• «<b>31 – 000056</b> - ΜΕΤΑΦΟΡΑ ΔΙΑΘΕΣΙΜΩΝ ΑΠΟ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟ ΑΣΦΑΛΕΙΩΝ ΠΕΛΑΤΕΙΑΣ»</li> </ul> <p><i>Transfer is completed in two steps:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• «<b>31 – 000055- Transfer to Customer Collateral Account</b></li> <li>• «<b>31 – 000056- Transfer from Customer Collateral Account</b></li> </ul>
11/12/2017	Stock Derivatives → Functions → <b>Collateral for AthexClear</b>	<p><b>Collateral for AthexClear</b></p> <p>Από την οθόνη αυτή γίνεται η παροχή Περιθωρίου Ασφάλισης υπέρ ΕΤ.ΕΚ ανά Λογαριασμό Εκκαθάρισης και Χώρο Εκκαθάρισης.</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Ασφάλειες που τηρεί το ΕΜ για ίδιο λογαριασμό : Η δέσμευση κινητών αξιών στο Σ.Α.Τ. υπέρ της ΕΤΕΚ θα γίνεται από τους Λογαριασμούς Αξιών που το ΕΜ τηρεί για ίδιο λογαριασμό (ενδεικτικά : OWN, MMSPOT, MMETF, MMCL, FTSPOT κλπ).</li> <li>2. Ασφάλειες Διακριτού Λογαριασμού Εκκαθάρισης : Η δέσμευση επί κινητών αξιών στο Σ.Α.Τ. υπέρ της ΕΤΕΚ θα γίνεται από τον Λογαριασμό Αξιών του</li> </ol>

Ημερομηνία <i>Date</i>	Οθόνες <i>Screens</i>	Σενάρια <i>Scenarios</i>
		<p>ιδιοκτήτη του διακριτού Λογαριασμού Εκκαθάρισης.</p> <p><b>3.</b> Ασφάλειες για Λογαριασμό Εκκαθάρισης Πελατείας του ΕΜ : Η δέσμευση επί κινητών αξιών στο Σ.Α.Τ. υπέρ της ΕΤΕΚ θα γίνεται από τον «Λογαριασμό Ασφαλειών Πελατείας» και θα αφορά υπόλοιπο σε αξίες που έχουν παρασχεθεί από πελάτες υπέρ του ΕΜ.</p> <p><i>From this screen a Clearing Member can provide collateral in form of transferable securities for margin purposes for a specific Clearing Account &amp; Clearing Space.</i></p> <p><i>1-Guaranties that kept for the OWN Clearing Account: Pledge can only performed from the Securities Accounts kept for OWN (OWN, MMSPOT, MMETF, MMCL, FTSPOT)</i></p> <p><i>2-Guaranties that kept for a Client Clearing Account: Pledge can only performed from the Securities Account kept for the owner of the Client Clearing Account</i></p> <p><i>3-Guaranties that kept for a Clientele Clearing Account: Pledge can only performed from the Clientele Collaterals Securities Accounts.</i></p>
Από / From 12/12/2017 έως / Until 15/12/2017		<p>Διενέργεια συναλλαγών από Μέλη Διαπραγμάτευσης</p> <p><i>Transactions from Trading Members</i></p>
Από / From 12/12/2017 έως / Until 15/12/2017	<p>Risk Management → Functions → <b>C.M. Limits → Change Trading Member Limits</b></p>	<p><b>Ενδοημερήσιος υπολογισμός κινδύνου ανά Λογαριασμό Εκκαθάρισης</b></p> <p><i>Intraday margin calculation per clearing account</i></p> <p>Κύκλοι υπολογισμού κινδύνου εκτελούνται ανά 5 λεπτά.</p> <p><i>Intraday margin calculation per clearing account every 5 minutes</i></p>

Ημερομηνία <i>Date</i>	Οθόνες <i>Screens</i>	Σενάρια <i>Scenarios</i>
		<p>Από την οθόνη αυτή δίδεται η δυνατότητα στο Εκκαθαριστικό Μέλος να ελέγχει το νέο όριο συναλλαγών μετά τον υπολογισμό ορίων των υπό διαμόρφωση θέσεων ανά Λογαριασμό Εκκαθάρισης τη συγκεκριμένη στιγμή. Η διαδικασία της μεταβολής ορίου περιγράφεται παραπάνω.</p> <p><i>This screen is used from the Clearing Member in order to check the calculated credit limit after an intraday margin calculation. The process of intraday margin calculation is described above.</i></p>
Από / From 12/12/2017 έως / Until 15/12/2017	Derivatives Clearing → Environment → <b>Clearing Instructions Information</b>	<p><b>Clearing Instructions Information</b></p> <p>Στην οθόνη αυτή εμφανίζονται όλες οι συναλλαγές στην τρέχουσα κατάσταση τους.</p> <p><i>This screen displays all transactions in the current state.</i></p>
Από / From 12/12/2017 έως / Until 15/12/2017	Risk Management → <b>Reports → Risk Assessment</b>	
Από / From 12/12/2017 έως / Until 15/12/2017  <b>16:30 – 17:00</b>	Derivatives Clearing → Actions → <b>Clearing Instruction Trade Management</b>	<p><b>Clearing Instruction Trade Management</b> <b>από ΜΔ / <i>From Trading Member</i></b></p> <p>Χρησιμοποιείται από τα Μέλη Διαπραγμάτευσης για τις διαδικασίες αλλαγής κωδικού διαπραγμάτευσης και αλλαγής Υπολογαριασμού Εκκαθάρισης.</p> <p>Κατά την ενέργεια αυτή για τις πράξεις που έχουν υποστεί διάρθρωση δεν αλλάζει το A/A πράξης.</p> <p><i>Trading Members use this screen in order to change Trading Code or Clearing Sub Account.</i></p> <p><i>The SN for the changed trades will remain the same.</i></p>
Από / From 12/12/2017 έως / Until 15/12/2017  <b>α) 16:30 – 17:15</b> <b>β) 10:50 – 16:30</b>	Derivatives Clearing → Actions → <b>Clearing Instruction Trade Management</b>	<p><b>Clearing Instruction Trade Management</b> <b>από ΕΜ/ <i>From Clearing Member</i></b></p> <p>Χρησιμοποιείται από τα Εκκαθαριστικά Μέλη α) για αλλαγή Λογαριασμού Θέσης και β) για δήλωση για real time διακανονισμό σε προϊόντα δανεισμού (SB /RA).</p> <p>Κατά την ενέργεια αυτή για τις πράξεις που έχουν υποστεί την διάρθρωση δεν</p>

Ημερομηνία <i>Date</i>	Οθόνες <i>Screens</i>	Σενάρια <i>Scenarios</i>
		<p>αλλάζει το A/A πράξης.</p> <p><i>Clearing Members use this screen in order to change Position Account and declare its wish for real time settlement in borrowing products.</i></p> <p><i>The SN for the changed trades will remain the same.</i></p>
<p>Από / From 12/12/2017 έως / Until 15/12/2017  16:30 – 17:00</p>	<p>Derivatives Clearing → Actions → Clearing Instruction Split</p>	<p><b>Clearing Instruction Split από ΜΔ / <i>From Trading Member</i></b></p> <p>Χρησιμοποιείται από τα Μέλη Διαπραγμάτευσης για τις διαδικασίες :</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Διάσπαση και καταχώριση των ορθών κωδικών διαπραγμάτευσης</li> <li>• Διορθώσεις λαθών στον κωδικό διαπραγμάτευσης ή και στον Υπολογαριασμό Εκκαθάρισης.</li> </ul> <p><i>This screen used from:</i></p> <p><i>Trading Member in order to split trades quantity, and changes Trading Code or make corrections to trading code and Clearing Sub Account</i></p> <p>Κατά την ενέργεια του split διαγράφονται οι πράξεις που έχουν υποστεί την διάρθρωση και στη θέση τους δημιουργούνται νέες πράξεις με νέα A/A .</p> <p><i>SN for the splited trades will be replaced with new ones.</i></p> <p>Δεν υπάρχει περιορισμός στη δημιουργία νέων πράξεων αρκεί οι επιμέρους ποσότητες να συμφωνούν με τη συνολική ποσότητα.</p> <p><i>There is no restriction creating new trades provided that the total quantity of the new trades agrees with the previous one.</i></p> <p>ΕΝΕΡΓΕΙΕΣ:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Ακύρωση μιας πράξης (Αγορά / Πώληση) και δημιουργία νέων .</li> <li>• Ακύρωση μιας πράξης πακέτου και δημιουργία νέων.</li> <li>• Ακύρωση μιας πράξης (Αγορά / Πώληση) και δημιουργία νέων με αλλαγή και του Κωδικού Διαπραγμάτευσης.</li> </ul>

Ημερομηνία <i>Date</i>	Οθόνες <i>Screens</i>	Σενάρια <i>Scenarios</i>
		<ul style="list-style-type: none"> <li>Ακύρωση μιας πράξης (Αγορά / Πώληση) και δημιουργία νέων με αλλαγή του Κωδικού Διαπραγμάτευσης καθώς και του Υπολογαριασμού Εκκαθάρισης.</li> </ul> <p><b>ACTIONS:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li><i>Cancellation of a trade (Buy /Sell)</i></li> <li><i>Cancellation of a block trade.</i></li> <li><i>Cancellation of a trade and creation of a new one with change of Trading Code.</i></li> <li><i>Cancellation of a trade and creation of a new one with change of Trading Code and Clearing Sub Account</i></li> </ul>
<p>Από / From 12/12/2017 έως / Until 15/12/2017  16:30 – 17:15</p>	<p>Derivatives Clearing → Actions → <b>Clearing Instruction Split</b></p>	<p><b>Clearing Instruction Split από EM / <i>From Clearing Member</i></b></p> <p>Χρησιμοποιείται από τα Εκκαθαριστικά Μέλη για τις διαδικασίες :</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Διάσπαση και καταχώρηση των ορθών Λογαριασμών Θέσης και ποσοτήτων στις συναλλαγές.</li> <li>Διορθώσεις λαθών σε Λογαριασμό Θέσης</li> </ul> <p>Κατά την ενέργεια του split διαγράφονται οι πράξεις που έχουν υποστεί την διάρθρωση και στη θέση τους δημιουργούνται νέες πράξεις με νέα Α/Α .</p> <p>Δεν υπάρχει περιορισμός στη δημιουργία νέων πράξεων αρκεί οι επιμέρους ποσότητες να συμφωνούν με τη συνολική ποσότητα.</p> <p><b><i>This screen used from:</i></b></p> <p><b><i>Clearing Members in order to split trades quantity, and changes Positions Accounts or make corrections to Positions Accounts.</i></b></p> <p><b><i>SN for the splitted trades will change with new ones.</i></b></p> <p><b><i>There is no restriction creating new trades provided that the total quantity of the new trades agrees with the previous one.</i></b></p> <p>ΕΝΕΡΓΕΙΕΣ:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Ακύρωση μιας πράξης (Αγορά /</li> </ul>



Ημερομηνία <i>Date</i>	Οθόνες <i>Screens</i>	Σενάρια <i>Scenarios</i>
		<p>Πώληση) και δημιουργία νέων .</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Ακύρωση μιας πράξης πακέτου και δημιουργία νέων.</li> <li>• Ακύρωση μιας πράξης (Αγορά / Πώληση) και δημιουργία νέων με αλλαγή του Λογαριασμού Θέσης</li> </ul> <p><b>ACTIONS:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• <i>Cancellation of a trade (Buy /Sell) and create a new.</i></li> <li>• <i>Cancellation of a block trade and create a new.</i></li> <li>• <i>Cancellation of a trade and creation of a new one with change of Position Account</i></li> </ul>
<p>Από / From 12/12/2017 έως / Until 15/12/2017  16:30 – 17:15</p>	<p>Derivatives Clearing → Actions → <b>Giveup / Takeup</b></p>	<p><b>Give up / Take up</b></p> <p>Χρησιμοποιείται από τα Εκκαθαριστικά Μέλη για την μεταφορά συναλλαγών μεταξύ Υπολογαριασμών Εκκαθάρισης ή Λογαριασμών Εκκαθάρισης του ίδιου ή διαφορετικών Εκκαθαριστικών Μελών.</p> <p><i>This screen is used from the Clearing Members for transfer a trade between Clearing Sub Accounts or Clearing Accounts of the same or different Clearing Members.</i></p>
<p>Από / From 12/12/2017 έως / Until 15/12/2017  11:00 – 17:15</p>	<p>Derivatives Clearing → Actions → <b>Transfer</b></p>	<p><b>Transfer</b></p> <p>Χρησιμοποιείται από τα Εκκαθαριστικά Μέλη για την μεταφορά Θέσεων μεταξύ Λογαριασμών Θέσεων - επενδυτών του ίδιου Εκκαθαριστικού Μέλους καθώς και μεταξύ διαφορετικών Εκκαθαριστικών Μελών με την προϋπόθεση ότι :</p> <p>α) Οι δύο Λογαριασμοί Θέσης «βλέπουν» στον ίδιο Λογαριασμό Αξιών (έχουν τον ίδιο ιδιοκτήτη)</p> <p>β) Όταν ο αρχικός Λογαριασμός Θέσης είναι ΛΘ Διαμεσολαβητή.</p> <p><i>This screen is used from the Clearing Members for transferring positions of investors between Clearing Members or in the same Clearing Member provided that:</i></p> <p><i>a) The two Position Accounts belongs to one investor (same Securities Account)</i></p>

Ημερομηνία <i>Date</i>	Οθόνες <i>Screens</i>	Σενάρια <i>Scenarios</i>
		<b>b) When the initial Position Account is an Intermediary Account</b>
Από / From 12/12/2017 έως / Until 15/12/2017 <b>10:50 – 17:00</b>	Derivatives Clearing → Actions → <b>Exercise</b>	<b>Exercise</b> Δυνατότητα εξασκήσεως σε δικαιώματα προαίρεσης επί μετοχών. <b>Exercise of Stock Options time period</b>
Από / From 12/12/2017 έως / Until 15/12/2017 <b>10:50 – 17:00</b>	Derivatives Clearing → Actions → <b>Cancel Exercise</b>	<b>Cancel Exercise</b> Δυνατότητα ακύρωσης των αιτήσεων εξάσκησης σε δικαιώματα προαίρεσης επί μετοχών. <b>Cancellation of Stock Options Exercise time period</b>
Από / From 12/12/2017 έως / Until 15/12/2017 <b>10:00 – 20:00</b>	System Administration → CSV Files → Group: Derivatives → <b>CSV Files</b>	<b>Έκδοση αρχείων CSV:</b> <b>CSV FILES</b>  <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Cash Settlement</li> <li>2. Classes</li> <li>3. Deliveries File</li> <li>4. Fixing Prices</li> <li>5. Instrument Types</li> <li>6. Margin Collateral Analysis</li> <li>7. Margin Requirement per Clearing Account</li> <li>8. Margin Requirement per Position Account</li> <li>9. Margin Requirement per SUB Account</li> <li>10. Position Account</li> <li>11. Position on Series</li> <li>12. Position on Series Per Clearing Account</li> <li>13. Position on Series Per Clearing Sub Account</li> <li>14. Projected Position on Series Per Clearing Sub Account</li> <li>15. Projected Position on Series</li> <li>16. Projected Position on Series Per Clearing Account</li> <li>17. Series</li> <li>18. Vector Files</li> </ol>
Από / From 12/12/2017 έως / Until 15/12/2017 <b>10:00 – 16:30</b>		Το Εκκαθαριστικό Μέλος δύναται να αιτηθεί τη μεταβολή του τρόπου υπολογισμού περιθωρίου ασφάλισης για τον/ους Λογαριασμό /ούς Εκκαθάρισης Πελατείας γνωστοποιώντας στην ΕΤ.ΕΚ : α) τον κωδικό του Λογαριασμού Εκκαθάρισης Πελατείας β) τον κάτοχο του Λογαριασμού

Ημερομηνία <i>Date</i>	Οθόνες <i>Screens</i>	Σενάρια <i>Scenarios</i>
		<p>Εκκαθάρισης Έμμεσης Πελατείας ή το δικαιούχο του Λογαριασμού Εκκαθάρισης Έμμεσης Πελατείας και γ) τον ΝΕΟ τρόπο υπολογισμού του περιθωρίου ασφάλισης (NET ή GROSS) μέσω mail στο <a href="mailto:Clearing&amp;SettlementDpt@athexgroup.gr">Clearing&amp;SettlementDpt@athexgroup.gr</a></p> <p><i>The Clearing Member can apply the change of a Clearing Account's calculation type, by disclosing to ATHEXclear:</i></p> <p><i>(a) the Clientele's Clearing Account code</i>  <i>(b) the holder of the Indirect Clientele's Clearing Account or the beneficiary of the Indirect Clientele's Clearing Account and</i>  <i>(c) the new margin calculation type for Clientele's Clearing Account (NET or GROSS) via mail to</i>  <a href="mailto:Clearing&amp;SettlementDpt@athexgroup.gr">Clearing&amp;SettlementDpt@athexgroup.gr</a></p>
Από / From 12/12/2017 έως / Until 15/12/2017 10:00 – 20:00	Risk Management → Reports → <b>Risk Assessment</b>	<p>Παραγωγή αναφοράς και έλεγχος υπολογισμού κινδύνου</p> <p><i>Check for the results by using the relevant reports</i></p>
15/12/2017	System Administration → CSV Files → Group: Derivatives → <b>CSV Files → Fees File</b>	<p>Η 15/12/2017 θα θεωρηθεί ότι είναι η τελευταία εργάσιμη του μήνα για να είναι δυνατή η παραγωγή της αναφοράς με τους παρακάτω νέους τύπους χρεώσεων:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• <b>«20 – Clearing Account Fees»</b> (για κάθε επιπλέον Λογαριασμό Εκκαθάρισης Ιδίου ή Λογαριασμό Εκκαθάρισης Άμεσης Πελατείας ή Λογαριασμό Εκκαθάρισης Έμμεσης Πελατείας ή Λογαριασμό Εκκαθάρισης Πελάτη)</li> <li>• <b>«21 – Gross margin position Fees»</b> (ανά ημέρα εκκαθάρισης για κάθε Λογαριασμό Θέσης Λογαριασμού Εκκαθάρισης Πελατείας - Gross εφόσον στη λήξη της ημέρας διατηρεί θέση).</li> </ul> <p>Όλες οι παραπάνω χρεώσεις θα καταβάλλονται την πρώτη (1η) εργάσιμη ημέρα του ημερολογιακού μήνα που έπεται του μήνα αναφοράς με βάση τη διαδικασία του χρηματικού</p>

Ημερομηνία <i>Date</i>	Οθόνες <i>Screens</i>	Σενάρια <i>Scenarios</i>
		<p>διακανονισμού της σχετικής ημέρας.</p> <p><i>15/12/2017 will be considered as the last business day of the month in order for the Clearing Members to be able to produce the report with the following new types of charges</i></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• <i>«20 – Clearing Account Fees» (for each additional OWN Clearing Account or Clientele Clearing Account or Indirect Clientele Clearing Account or Client Clearing Account)</i></li> <li>• <i>«21 – Gross margin position Fees» (per clearing day for each Position Account of a Clientele Clearing Gross, if at the end of the day it retains a position)</i></li> </ul> <p><i>All the above charges will be paid on the first (1st) business day of the calendar month following the reference month based on the cash settlement process of the relevant day.</i></p>

## 5. Στοιχεία Επικοινωνίας / **Contact Details**

---

Για κάθε επιπλέον διευκρίνιση και πληροφορία μπορείτε να επικοινωνείτε με το Τμήμα Εξυπηρέτησης Μελών

*For any inquiries you can contact with the Members Support Department:*

Tel: (+30) 210 3366 393

Tel: (+30) 210 3366 385

Fax: (+30) 210 3366 286

E-mail: [Members-Support@athexgroup.gr](mailto:Members-Support@athexgroup.gr)

Service Desk: <https://www.athexgroup.gr/en/service-desk>

## 6. Αναφορά Προβλημάτων / Problems Report

---

Κατά την περίοδο των δοκιμών στο UAT και εφόσον τα Εκκαθαριστικά Μέλη της Αγοράς Παραγώγων αντιμετωπίσουν οποιοδήποτε πρόβλημα (τεχνικό ή άλλο), θα πρέπει να επικοινωνήσουν τηλεφωνικά ή μέσω του Service Desk στην ενότητα **11. Mock Session**, στο **Trading Mock Session on UAT**.

*Τμήμα Εξυπηρέτησης Μελών*

*Tel: + 30 - 210 - 33.66.385 & 33.66.393*

*Service Desk: <http://www.athexgroup.gr/el/web/quest/members-service-desk>*

*During the testing on the UAT, Clearing Members that may face a problem (technical or not) should contact Members Support Dpt via phone or the Service Desk on 11. Mock Session, on Trading Mock Session on UAT.*

*Members Support Dpt*

*Tel: + 30 - 210 - 33.66.385 & 33.66.393*

*Service Desk: <http://www.athexgroup.gr/el/web/quest/members-service-desk>*