
Οδηγίες & Σενάρια Γενικής Δοκιμής

Mock Scenarios



ATHEXGROUP
Athens Exchange Group

ΔΙΕΥΘΥΝΣΗ ΛΕΙΤΟΥΡΓΙΑΣ ΑΓΟΡΑΣ & ΕΞΥΠΗΡΕΤΗΣΗΣ ΜΕΛΩΝ

MARKET OPERATION & MEMBERS SUPPORT DIVISION

Αθήνα, Μάρτιος 2015

Athens, March 2015

Πίνακας Περιεχομένων/*Table of Contents*

1. ΕΙΣΑΓΩΓΗ / INTRODUCTION	1
1.1. ΔΕΔΟΜΕΝΑ ΕΙΚΟΝΙΚΗΣ ΣΥΝΕΔΡΙΑΣΗΣ / MOCK TRADING DATA	1
1.2. ΑΣΦΑΛΕΙΑ ΔΕΔΟΜΕΝΩΝ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ ΠΑΡΑΓΩΓΗΣ / SECURITY OF PRODUCTION SYSTEM DATA.....	2
2. ΧΡΟΝΙΣΜΟΙ ΕΙΚΟΝΙΚΗΣ ΣΥΝΕΔΡΙΑΣΗΣ/ SCHEDULE OF MOCK TRADING SESSION	3
2.1. ΧΡΟΝΟΔΙΑΓΡΑΜΜΑ / SCHEDULE	3
2.2. ΧΡΟΝΙΣΜΟΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΗΣ / TRADING SCHEDULE	3
2.3. ΧΡΟΝΙΣΜΟΣ ΕΚΚΑΘΑΡΙΣΗΣ / CLEARING SCHEDULE	5
2.3.1. Αγορά Αξιών / Cash Market	5
2.3.2. Αγορά Παραγώγων Χ.Α./ Derivatives market ATHEX.....	7
2.3.3. Αγορά Παραγώγων SIBEX/ Derivatives market SIBEX.....	9
2.4. ΑΝΑΜΕΤΑΔΟΤΕΣ ΠΛΗΡΟΦΟΡΙΑΣ / DATA VENDORS	11
3. ΠΡΟΣΒΑΣΗ ΣΤΟ ΣΥΣΤΗΜΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΗΣ / ACCESS TO TRADING SYSTEM	13
3.1. ΕΦΑΡΜΟΓΗ ORAMA / ORAMA APPLICATION	13
3.2. ΥΠΗΡΕΣΙΑ ATHEX G/W (ODL) / ATHEX G/W (ODL) SERVICE	13
4. ΠΡΟΣΒΑΣΗ ΣΤΟ ΣΑΤ / ACCESS TO DSS	15
5. ΠΡΟΣΒΑΣΗ ΣΤΟ ΔΙΚΤΥΟ ΧΝΕΤ / ACCESS TO ΧΝΕΤ	16
6. ΣΕΝΑΡΙΑ ΕΚΚΑΘΑΡΙΣΗΣ ΣΤΗΝ ΑΓΟΡΑ ΑΞΙΩΝ/CLEARING SCENARIOS CASH MARKET	17
7. ΣΕΝΑΡΙΑ ΕΚΚΑΘΑΡΙΣΗΣ ΣΤΗΝ ΑΓΟΡΑ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ / CLEARING SCENARIOS DERIVATIVES MARKET.....	22
7.1. ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΗ ΚΙΝΔΥΝΟΥ / RISK MANAGEMENT	22
7.2. ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΙ ΘΕΣΗΣ / POSITION ACCOUNTS.....	22
7.3. ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΗ ΑΣΦΑΛΕΙΩΝ / COLLATERALS MANAGEMENT	23
7.4. ΕΞΑΣΚΗΣΕΙΣ / EXERCISE.....	24
7.5. ΜΕΤΑΦΟΡΕΣ/ TRANSFERS.....	25
7.6. ΠΑΡΑΚΟΛΟΥΘΗΣΗ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ / CLEARING INSTRUCTIONS MONITORING.....	26
7.7. ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΗ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ / CLEARING INSTRUCTIONS MANAGEMENT	27
7.8. ΜΕΤΑΘΕΣΗ ΕΚΚΑΘΑΡΙΣΗΣ / CLEARING GIVE-UP	29
7.9. ΗΜΕΡΗΣΙΟΣ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΣ / SETTLEMENT.....	30
7.10. ΔΑΝΕΙΣΜΟΣ ΜΕΤΟΧΩΝ / STOCK LENDING	30
8. ΣΕΝΑΡΙΑ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΗΣ / TRADING SYSTEM SCENARIOS	32
8.1. ΕΙΣΑΓΩΓΗ ΕΝΤΟΛΩΝ/ ORDER ENTERING.....	32
8.2. ΠΡΟ-ΣΥΜΦΩΝΗΜΕΝΕΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΕΣ/ PRE-AGREED TRADES	32
8.3. ΣΤΑΤΙΣΤΙΚΕΣ ΠΛΗΡΟΦΟΡΙΕΣ/ STATISTICAL INFORMATION	33
8.4. ΑΡΧΕΙΟ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ/ TRANSACTION FILE	33
9. ΣΕΝΑΡΙΑ ΔΙΚΤΥΟΥ ΧΝΕΤ / ΧΝΕΤ SCENARIOS	34
9.1. ΈΛΕΓΧΟΣ ΠΡΟΣΒΑΣΗΣ ΣΤΗΝ ΕΦΑΡΜΟΓΗ ΧORDER CLIENT / ACCESS TO ΧORDER CLIENT	34
9.2. ΈΛΕΓΧΟΣ ΠΙΣΤΩΤΙΚΩΝ ΟΡΙΩΝ / CREDIT LIMITS' CHECK.....	34
10. ΑΝΑΦΟΡΑ ΠΡΟΒΛΗΜΑΤΩΝ / PROBLEM REPORT	35

1. Εισαγωγή / Introduction

Ο Όμιλος Χρηματιστηρίου Αθηνών προγραμματίζει για το **Σάββατο, 7 Μαρτίου** τη διεξαγωγή Δοκιμαστικής Λειτουργίας του συστήματος Διαπραγμάτευσης, Εκκαθάρισης και Διακανονισμού στην αγορά Αξιών και Παραγώγων με χρήση των συστημάτων του Εναλλακτικού Μηχανογραφικού Κέντρου (Disaster Recovery Site) του Ομίλου.

Η Γενική Δοκιμή έχει ως στόχο να δώσει στα Μέλη ΧΑ και στους Χειριστές ΣΑΤ την δυνατότητα να πραγματοποιήσουν τεχνικούς ελέγχους, προκειμένου να δοκιμαστεί ο συνολικός σχεδιασμός του Σχεδίου Επιχειρησιακής Συνέχειας του Ομίλου Χρηματιστηρίου Αθηνών, στο υποσύστημα Διαπραγμάτευσης κι Εκκαθάρισης, στο περιβάλλον παραγωγής.

Για την αποτελεσματικότερη διεξαγωγή και παρακολούθηση της Δοκιμαστικής Λειτουργίας στο παρόν κείμενο περιλαμβάνονται τα εξής:

- Γενικές οδηγίες που αφορούν τον τρόπο σύνδεσης στις εφαρμογές
- Οδηγίες – Σενάρια που θα πρέπει να ακολουθήσουν οι χρήστες κατά την διάρκεια της δοκιμαστικής λειτουργίας

Η συμβολή και η ενεργός συμμετοχή των Μελών και των Χειριστών ΣΑΤ στις παρακάτω διαδικασίες Διαπραγμάτευσης κι Εκκαθάρισης στην αγορά Αξιών & Παραγώγων αποτελεί σημαντικό παράγοντα για την δοκιμή του Εναλλακτικού Σημείου Πρόσβασης.

The ATHEX Group is organizing on Saturday, 7th of March a General Mock trading session of Cash and Derivatives Trading and Clearing System at the Production environment which involves the use of the Disaster Recovery Site.

The scope of the mock trading session is to ensure that the members' systems will connect to the Disaster Site and operate smoothly and that the design and implementation of the new Business Continuity Plan (BCP) has been completed.

The present document includes all the necessary information to achieve an effective test session. Specifically:

- *General instructions concerning the connectivity to the relevant applications*
- *The Test scenarios that should be followed by the participants*

The contribution and active participation of all the Cash and Derivatives Trading & Clearing Members to the General mock session, is critical in order to ensure the business continuity of the services provided to the market participants.

1.1. Δεδομένα εικονικής συνεδρίασης / Mock Trading Data

Τα δεδομένα που θα χρησιμοποιηθούν στην εικονική συνεδρίαση θα είναι ίδια με αυτά του συστήματος παραγωγής μετά το τέλος της συνεδρίασης της Παρασκευής 06/03/2015 με τις εταιρικές μεταβολές που θα ισχύουν την Δευτέρα 09/03/2015.

*The data of the production system of **Friday 06/03/2015** will be used for the mock trading session.*

1.2. Ασφάλεια Δεδομένων Συστήματος Παραγωγής / *Security of Production System Data*

Τα Μέλη Διαπραγμάτευσης θα πρέπει να φροντίσουν, σε στενή συνεργασία με τους προμηθευτές των εφαρμογών τους, για τις απαιτούμενες ρυθμίσεις στο εσωτερικό τους δίκτυο ώστε **να μην επηρεαστεί το περιβάλλον παραγωγής** των εφαρμογών τους (front office και back office εφαρμογές Μελών).

*The trading members should take all the necessary actions regarding their API in order **not to affect their production systems.***

2. Χρονισμοί Εικονικής Συνεδρίασης/ *Schedule of Mock Trading Session*

2.1. Χρονοδιάγραμμα / *Schedule*

Η Γενική Εικονική συνεδρίαση θα πραγματοποιηθεί το **Σαββάτο, 07/03/2015** για το διάστημα **11:00 έως 12:00**.

Τα συστήματα Διαπραγμάτευσης κι Εκκαθάρισης θα είναι διαθέσιμα κατά τα παρακάτω χρονικά διαστήματα:

- ΣΑΤ από 10:00π.μ. έως 14:00μ.μ.
- ΟΑΣΗΣ από 10:00 έως 13:00.

*The General Mock trading session will take place on **Saturday, 7th of March**, at the Production System, between **11:00 and 12:00** (Athens Time).*

The Trading & Clearing systems will be available during the following time frames:

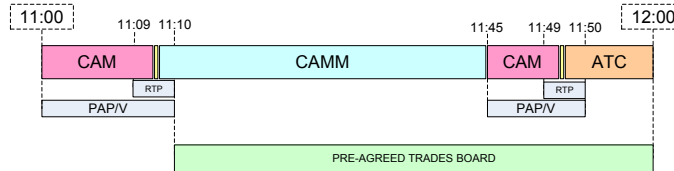
- DSS *from 10.00 am to 14.00 pm. (Athens Time).*
- OASIS *from 10:00 am 13:00 (Athens Time).*

2.2. Χρονισμός Διαπραγμάτευσης / *Trading Schedule*

Ο χρονισμός των αγορών του Χρηματιστηρίου Αθηνών, του Χρηματιστηρίου Κύπρου και του Χρηματιστηρίου Ρουμανίας θα έχει ως εξής:

ATHEX, CSE and SIBEX Market schedule will be as follows:

Mock Trading - ATHEX Markets Schedule / Mock Trading - Χρονισμός Αγορών ΧΑ



Main Market (Market ID:M)

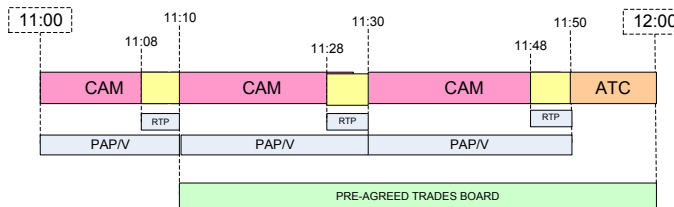
Closing Price: Closing auction / 30% of last trades
Price Fluctuation Limits*: $\pm 30\%$
Static Price Range: $\pm 10\%$
Dynamic Price Range: $\pm 3\%$
Price Tolerance Rule: 30%
Volume Min Rule: 30%
Vol. Int Pre Call: 5 min
Vol. Int Extension: 3 min
Vol. Int. Random: 1 min

Κύρια αγορά (Κωδ.αγοράς:M)

Τιμή Κλεισίματος: Δημοπρασία στο κλείσιμο / 30% των τελευταίων πράξεων
Όρια Διακύμανσης*: $\pm 30\%$
Στατικό όριο: $\pm 10\%$
Δυναμικό όριο: $\pm 3\%$
Σημαντική Απόκλιση Δημοπρασίας: 30%
Σημαντικός Όγκος Δημοπρασίας: 30%
Χρόνος Προσυνεδρίασης AMEM: 5 min
Χρόνος Επέκτασης AMEM: 3 min
Περίοδος Τυχαίου Χρόνου AMEM: 1 min

*Price Fluctuation Limits for shares with low turnover velocity $\pm 10\%$

* Όρια Διακύμανσης σε μετοχές με χαμηλή κυκλοφοριακή ταχύτητα $\pm 10\%$

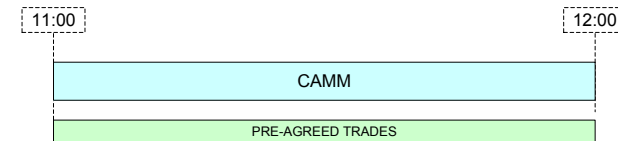


Low Dispersion (Market ID:B)

Closing Price: 100% of traded Volume
Price Fluctuation Limits: $\pm 20\%$

Χαμηλής Διασποράς (Κωδ.αγοράς:B)

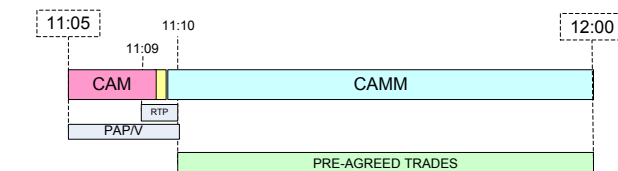
Τιμή Κλεισίματος: 100% του όγκου των ημερήσιων συν.
Όρια Διακύμανσης: $\pm 20\%$



Index Futures & Options

Market ID:1, Venue ID: **XADE**

Index FUT: Fluctuation Limits: $\pm 20\%$ adjusted to $\pm 35\%$
Index OPT: Fluctuation Limits: For each (call & put) option series, the **theoretical price** is calculated, on which the **absolute value resulted from the $\pm 35\%$ on the starting price of the underlying instrument** will be added, in order the fluctuation limits to be defined respectively



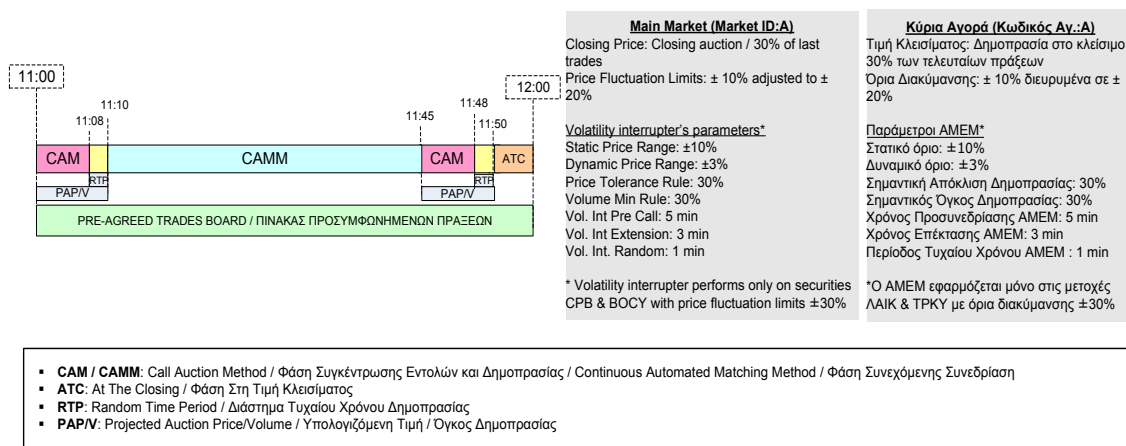
Repos

Market ID:3, Venue ID: **XADE**

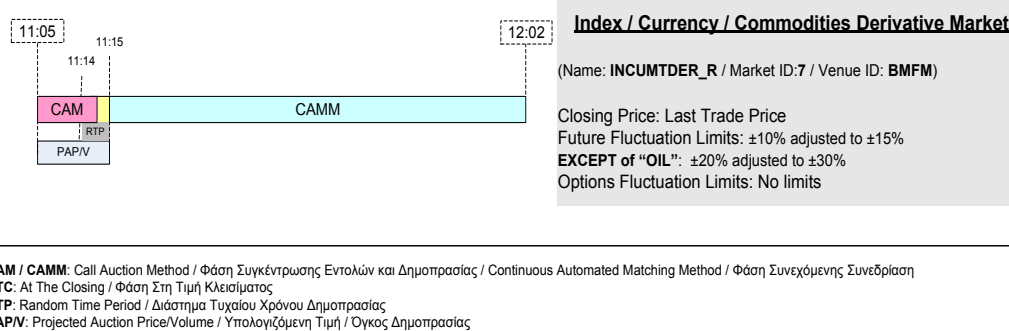
Price Fluctuation Limits: Unlimited

- **CAM / CAMM**: Call Auction Method / Φάση Συγκέντρωσης Εντολών και Δημοπρασίας / Continuous Automated Matching Method / Φάση Συνεχόμενης Συνεδρίασης
- **ATC**: At The Closing / Φάση Στη Τιμή Κλεισίματος
- **RTP**: Random Time Period / Διάστημα Τυχαίου Χρόνου Δημοπρασίας
- **PAP/V**: Projected Auction Price/Volume / Υπολογιζόμενη Τιμή / Όγκος Δημοπρασίας

Mock Trading - CSE Markets Schedule / Mock Trading - Χρονισμός Αγορών ΧΑΚ



Mock Trading - SIBEX Markets Schedule / Mock Trading - Χρονισμός Αγορών SIBEX



Μετά τη λήξη της συνεδρίασης θα ξεκινήσει η διαδικασία της **Εκκαθάρισης**.

*After the end of Trading, the **Clearing** procedure will start.*

2.3. Χρονισμός Εκκαθάρισης / **Clearing Schedule**

2.3.1. Αγορά Αξιών / **Cash Market**

Ο χρονισμός των ενεργειών που θα πραγματοποιηθούν από την ΕΤ.ΕΚ και αφορούν την εκκαθάριση & διακανονισμό των συναλλαγών, είναι ο παρακάτω:

Έναρξη	Λήξη	Ενέργειες
9:00	9:30	Κύκλος Διακανονισμού DVP

9:00	09:30	Κατά το συγκεκριμένο χρονικό διάστημα θα γίνεται: <ul style="list-style-type: none"> • Η φόρτωση των συναλλαγών από τον ΧORDER στο Σ.Α.Τ. (για ημερομηνία συναλλαγών 06/03/2015) • Σύμπτυξη και οριστικοποίηση συναλλαγών προς εκκαθάριση • Ο Υπολογισμός κινδύνου τριημέρου και απόδοση πιστωτικού ορίου για κάθε Κύριο / Διακριτό λογαριασμό εκκαθάρισης.
10:00	10:00	Αποστολή αρχικών ορίων από το Σ.Α.Τ στο ΟΑΣΗΣ
10:00	10:00	Αποστολή αρχικών ορίων από το Σ.Α.Τ στον ΧORDER
10:30	11:00	Κατά το συγκεκριμένο χρονικό διάστημα θα τρέξει ο πρώτος κύκλος διακανονισμού, χωρίς όμως να πραγματοποιηθούν χρηματικές κινήσεις στο T2.
11:30	11:30	Ακύρωση μεταθέσεων μη αναλυμένων (για ημερομηνία συναλλαγών 5/3/2015).
11:45	12:00	Τελευταίος κύκλος διακανονισμού (για ημερομηνία συναλλαγών 5/3/2015) Δεν θα πραγματοποιηθούν χρηματικές κινήσεις στο T2.
11:45	12:00	Διακανονισμός εντολών OTC FOP (με ημερομηνία διακανονισμού 9/3/2015)
12:15	12:15	Μεταφορά ποσοτήτων από τη μερίδα του Διαμεσολαβητή στη συνδεδεμένη μερίδα επενδυτή του Διαμεσολαβητή..
12:15	12:45	Υπολογισμός Δικαιωμάτων OTC από ΕΤ.ΕΚ
12:15	12:45	Υπολογισμός Δικαιωμάτων ΕΤ.ΕΚ (0,020%), Φόρος πωλήσεων καθώς και υπολογισμός των κινήσεων ανάλυσης, μετάθεσης και διάρθρωσης.
12:15	12:45	Κατά το συγκεκριμένο χρονικό διάστημα θα γίνεται <ul style="list-style-type: none"> • η φόρτωση των συναλλαγών από το ΟΑΣΗΣ στο Σ.Α.Τ. (για ημερομηνία συναλλαγών 9/3/2015) • Σύμπτυξη και οριστικοποίηση συναλλαγών προς εκκαθάριση • Ο Υπολογισμός κινδύνου τριημέρου και απόδοση πιστωτικού ορίου για κάθε Κύριο / Διακριτό λογαριασμό εκκαθάρισης.

The schedule of clearing and settlement procedures will be as follows:

Start	End	Activities
9:00	9:30	Settlement cycle DVP
9:00	09:30	During this time period the following actions will take place: <ul style="list-style-type: none"> • transactions are loaded to DSS from ΧORDER (for business day 06/03/2015) • confirmation of transactions • risk and credit limit calculation for each clearing account

10:00	10:00	DSS sends the initial daily credit limits to OASIS
10:00	10:00	DSS sends the initial daily credit limits to XORDER
10:30	11:00	1st Settlement cycle. Actual cash settlement in T2 will not take place.
11:30	11:30	Shifting cancelation of non allocating actions for business day 5/3/2015.
11:45	12:00	Final Settlement cycle. (for business day 5/3/2015). Actual cash settlement in T2 will not take place..
11:45	12:00	Settlement of OTC orders FOP (Settlement date 9/3/2015)
12:15	12:15	Quantity transfer from Intermediary's DSS share to the connected client's DSS share.
12:15	12:45	OTC fees calculation by ATHEX Clear
12:15	12:45	AthexClear Fees calculation (0,020%), sales tax as well as calculation for allocation, shifting and other transactions.
12:15	12:45	During this time period the following actions will take place: <ul style="list-style-type: none"> • transactions are loaded to DSS from OASIS (for business day 9/3/2015) • confirmation of transactions • risk and credit limit calculation for each clearing account

2.3.2. Αγορά Παραγώγων Χ.Α./ Derivatives market ATHEX

Ο χρονισμός των ενεργειών που θα πραγματοποιηθούν από την ΕΤ.ΕΚ και αφορούν την εκκαθάριση παραγώγων, είναι ο παρακάτω:

Έναρξη	Λήξη	Ενέργειες
10:00	10:00	Αποστολή αρχικών ορίων από το Σύστημα Εκκαθάρισης (Σ.Ε.) στο ΟΑΣΗΣ
11:00	11:00	Εισαγωγή εντολών διάθεσης Δανεισμού από την ΕΤ.ΕΚ στο Σύστημα Διαπραγμάτευσης
11:00	12:00	Φόρτωση συναλλαγών από το Σύστημα Διαπραγμάτευσης στο Σ.Ε. σε πραγματικό χρόνο
10:00	12:30	Δυνατότητα δέσμευσης μετοχών υπέρ ΕΤ.ΕΚ
10:00	12:30	Δυνατότητα αποδέσμευσης των μετοχών υπέρ ΕΤΕΚ
10:00	14:00	Δυνατότητα δέσμευσης Κινητών Αξιών προς δανεισμό Οι εντολές δέσμευσης οι οποίες θα καταχωρηθούν έως τις 10:45, θα συμμετέχουν στον υπολογισμό των εντολών Δανειοδοσίας για την ίδια μέρα
11:00	12:00	Λήξη δυνατότητας καταχώρισης ειδικής σήμανσης για real time διακανονισμό σε προϊόντα δανεισμού τίτλων

11:00	12:00	Ενδοημερήσιος υπολογισμός κινδύνου ανά Λογαριασμό Εκκαθάρισης Κύκλοι υπολογισμού κινδύνου εκτελούνται ανά 5 λεπτά.
12:00	12:10	Επιβεβαίωση της φόρτωσης των συναλλαγών από το ΟΑΣΗΣ στο Σύστημα Εκκαθάρισης
12:00	12:15	Δυνατότητα πρότασης για διάρθρωση συναλλαγών από Μέλη Διαπραγμάτευσης προς Εκκαθαριστικά Μέλη.
11:00	12:30	Δυνατότητα εξασκήσεως σε δικαιώματα προαίρεσης επί μετοχών καθώς και ακυρώσεις των αιτήσεων εξάσκησης.
11:00	12:30	Δυνατότητα εξασκήσεως από δανειζόμενο καθώς και ακυρώσεις των αιτήσεων εξάσκησης.
12:00	12:30	Δυνατότητα μετάθεσης εκκαθάρισης και αποδοχή μετάθεσης από Εκκαθαριστικά Μέλη.
12:00	12:30	Δυνατότητα για διάρθρωση συναλλαγών από τα Εκκαθαριστικά Μέλη.
11:00	12:30	Δυνατότητα αίτησης μεταφοράς θέσεων από ένα ΕΜ σε ένα άλλο καθώς και αποδοχή των αιτήσεων μεταφοράς από άλλα Εκκαθαριστικά Μέλη.
11:00	12:30	Δυνατότητα μεταφοράς θέσεων από ένα Υπολογαριασμό Εκκαθάρισης σε έναν άλλο του ίδιου του ΕΜ που αιτήθηκε τη μεταφορά θέσης.
	12:30	Οριστικοποίηση των μεταφορών θέσεων
	12:30	Οριστικοποίηση των συναλλαγών
12:30	12:45	Υπολογισμός τιμών εκκαθάρισης
12:30	12:45	Υπολογισμός ημερήσιου χρηματικού διακανονισμού και προμηθειών (Υπολογισμός του Mark To Market)
12:30	12:45	<ul style="list-style-type: none"> Αποτίμηση των collaterals που έχουν κατατεθεί για το ΛΕ Υπολογισμός Κινδύνου (margin)
		<ul style="list-style-type: none"> Δεν θα γίνει αποστολή αρχείων από την ET.EK

The schedule of clearing and settlement procedures will be as follows:

Start	Finish	Actions
10:00	10:00	DSS sends the initial daily credit limits to OASIS
11:00	11:00	AthexClear is entering borrowing orders to the Trading System.
11:00	12:00	Real time loading of transactions from OASIS to DSS
10:00	12:30	Collateral Pledge
10:00	12:30	Collateral Unpledge

10:00	14:00	Stock lending pledge possibility
11:00	12:00	Expiration option flag registration for real time settlement in securities lending products
11:00	12:00	Intraday margin calculation per clearing account Intraday margin calculation per clearing account every 5 minutes
12:00	12:10	Confirmations of loading transactions to DSS from OASIS
12:00	12:15	Time period for any changes on the structure of transactions' file by trading member to clearing member.
11:00	12:30	Time period for options exercises and cancelations of exercises
11:00	12:30	Time period for borrower exercises and cancelations of exercises.
12:00	12:30	Time period for Give Up /Take Up
12:00	12:30	Time period for any changes on the structure of transactions' file by clearing member.
11:00	12:30	Time period for completing of position transfers between two Clearing Members.
11:00	12:30	Time period for completing position transfers between two Sub Accounts of the same Clearing Member.
	12:30	Finalization of Position Transfer
	12:30	Finalization of Positions
12:30	12:45	Fixing Values Calculation
12:30	12:45	Calculation of daily settlement and fees (Mark To Market)
12:30	12:45	<ul style="list-style-type: none"> • Collateral valuation • Margin Calculation
		• Athex Clear will not sent any files through FTP server.

2.3.3. Αγορά Παραγώγων SIBEX/ Derivatives market SIBEX

Ο χρονισμός των ενεργειών που θα πραγματοποιηθούν από την ΕΤ.ΕΚ και αφορούν την εκκαθάριση παραγώγων, είναι ο παρακάτω:

Έναρξη	Λήξη	Ενέργειες
9:00	09:30	<ul style="list-style-type: none"> • Οριστικοποίηση των συναλλαγών 06/03/2015 • Υπολογισμός τιμών εκκαθάρισης • Υπολογισμός ημερήσιου χρηματικού διακανονισμού και προμηθειών (Υπολογισμός του Mark To Market) • Αποτίμηση των collaterals που έχουν κατατεθεί για το

<p>ΛΕ</p> <ul style="list-style-type: none"> Υπολογισμός Κινδύνου (margin) <p>Δεν θα γίνει αποστολή αρχείων από την ΕΤ.ΕΚ</p>		
10:00	10:00	Αποστολή αρχικών ορίων από το Σύστημα Εκκαθάρισης (Σ.Ε.) στο ΟΑΣΗΣ
11:00	12:00	Φόρτωση συναλλαγών από το Σύστημα Διαπραγμάτευσης στο Σ.Ε. σε πραγματικό χρόνο
11:00	12:00	Ενδοημερήσιος υπολογισμός κινδύνου ανά Λογαριασμό Εκκαθάρισης Κύκλοι υπολογισμού κινδύνου εκτελούνται ανά 5 λεπτά.
12:00	12:10	Επιβεβαίωση της φόρτωσης των συναλλαγών από το ΟΑΣΗΣ στο Σύστημα Εκκαθάρισης
12:00	12:15	Δυνατότητα πρότασης για διάρθρωση συναλλαγών από Μέλη Διαπραγμάτευσης προς Εκκαθαριστικά Μέλη.
12:00	12:30	Δυνατότητα μετάθεσης εκκαθάρισης και αποδοχή μετάθεσης από Εκκαθαριστικά Μέλη.
12:00	12:30	Δυνατότητα για διάρθρωση συναλλαγών από τα Εκκαθαριστικά Μέλη.
11:00	12:30	Δυνατότητα αίτησης μεταφοράς θέσεων από ένα ΕΜ σε ένα άλλο καθώς και αποδοχή των αιτήσεων μεταφοράς από άλλα Εκκαθαριστικά Μέλη.
11:00	12:30	Δυνατότητα μεταφοράς θέσεων από ένα Υπολογιστικό Εκκαθάρισης σε έναν άλλο του ίδιου του ΕΜ που αιτήθηκε τη μεταφορά θέσης.
	12:30	Οριστικοποίηση των μεταφορών θέσεων
	12:30	Οριστικοποίηση των συναλλαγών
12:30	12:45	Υπολογισμός τιμών εκκαθάρισης
12:30	12:45	Υπολογισμός ημερήσιου χρηματικού διακανονισμού και προμηθειών (Υπολογισμός του Mark To Market)
12:30	12:45	<ul style="list-style-type: none"> Αποτίμηση των collaterals που έχουν κατατεθεί για το ΛΕ Υπολογισμός Κινδύνου (margin)
		Δεν θα γίνει αποστολή αρχείων από την ΕΤ.ΕΚ

The schedule of clearing and settlement procedures will be as follows:

Start	Finish	Actions
9:00	9:30	<ul style="list-style-type: none"> Finalization of Positions 06/03/2015 Fixing Values Calculation Calculation of daily settlement and fees (Mark To

		Market)
		<ul style="list-style-type: none"> • Collateral valuation • Margin Calculation
		Athex Clear will not sent any files through FTP server.
10:00	10:00	DSS sends the initial daily credit limits to OASIS
11:00	12:00	Real time loading of transactions from OASIS to DSS
11:00	12:00	Intraday margin calculation per clearing account Intraday margin calculation per clearing account every 5 minutes
12:00	12:10	Confirmations of loading transactions to DSS from OASIS
12:00	12:15	Time period for any changes on the structure of transactions' file by trading member to clearing member.
12:00	12:30	Time period for Give Up /Take Up
12:00	12:30	Time period for any changes on the structure of transactions' file by clearing member.
11:00	12:30	Time period for completing of position transfers between two Clearing Members.
11:00	12:30	Time period for completing position transfers between two Sub Accounts of the same Clearing Member.
	12:30	Finalization of Position Transfer
	12:30	Finalization of Positions
12:30	12:45	Fixing Values Calculation
12:30	12:45	Calculation of daily settlement and fees (Mark To Market)
12:30	12:45	<ul style="list-style-type: none"> • Collateral valuation • Margin Calculation
		Athex Clear will not sent any files through FTP server.

2.4. Αναμεταδότες Πληροφορίας / Data Vendors

Η πρόσβαση των Αναμεταδοτών Πληροφορίας θα είναι επιτρεπτή μέσω:

- Σύνδεσης στο Internet
- του υπάρχοντος backup κυκλώματος – μισθωμένης γραμμής (για όσους διαθέτουν)
- του Extranet (εφόσον ο Data Vendor λαμβάνει πληροφορία μέσω Extranet)
- του ATHEX London Hub (εφόσον ο Data Vendor διαθέτει μόνιμη σύνδεση στο ATHEX London Hub)

The ATHEX Data Vendors will connect to the Disaster Site through:

-
- a) Internet connection*
 - b) the existing backup connection – leased line (if available)*
 - c) Extranet (if the Data Vendor receives the information through Extranet)*
 - d) ATHEX London Hub (If the Data Vendor has a permanent connection to ATHEX London Hub)*

3. Πρόσβαση στο Σύστημα Διαπραγμάτευσης / Access to Trading System

3.1. Εφαρμογή ORAMA / ORAMA application

Το όνομα χρήστη των Windows, οι κωδικοί καθώς και τα συνθηματικά (passwords) των χρηστών στο ORAMA που θα χρησιμοποιηθούν, θα είναι τα ίδια με αυτά που χρησιμοποιούνται στο σύστημα παραγωγής.

Ξεκινήστε την εφαρμογή ORAMA (Start → Programs → Oasis ORAMA → ORAMA) ή με χρήση του σχετικού εικονιδίου (shortcut) που βρίσκεται στην κεντρική επιφάνεια εργασίας (desktop).

Χρησιμοποιείτε τον προσωπικό σας **Κωδικό Χρήστη (User ID)** και το **συνθηματικό (password)** όπως ισχύει και στο **σύστημα παραγωγής**.

The ORAMA users will use the production username and password.

Login to the ORAMA application via the menu: Start → Programs → Oasis ORAMA → ORAMA or via the relevant shortcut on your desktop.

Users IDs and passwords in ORAMA application will be the same with the ones used in the production environment.

3.2. Υπηρεσία ATHEX G/W (ODL) /ATHEX G/W (ODL) Service

Τα Μέλη Διαπραγμάτευσης, θα πρέπει να ελέγξουν τη σύνδεση και τη λειτουργικότητα του ATHEX GW που τυχόν διαθέτουν.

Επιπλέον, θα πρέπει να έχουν φροντίσει για τις απαιτούμενες ρυθμίσεις στο εσωτερικό τους δίκτυο ώστε **να μην επηρεαστεί το περιβάλλον παραγωγής** των εφαρμογών τους κατά τη διάρκεια της εικονικής συνεδρίασης.

Για την σύνδεση του ATHEX GW, οι μηχανογράφοι των Μελών θα πρέπει να ακολουθήσουν τα επόμενα βήματα:

Πριν την εκκίνηση της Εικονικής Συνεδρίασης:

1. Εκκίνηση του service

Μετά τον τερματισμό της Εικονικής Συνεδρίασης:

1. Τερματισμός του service
2. Διαγραφή ή μετονομασία των log αρχείων

*The trading members should check their connectivity and operation of the ATHEX GW and ensure that their **production environment will not be affected** from the General Mock session.*

The following steps should be executed in order to establish a connection between the Members' Gateway and the Disaster Site:

Before the start of Mock Trading session:

1. *Start the service*

After the end of Mock trading session:

1. *Stop the service*
2. *Delete or rename the log files*

4. Πρόσβαση στο ΣΑΤ / Access to DSS

Για την πραγματοποίηση των δοκιμών θα πρέπει να χρησιμοποιήσετε την επιλογή (εικονίδιο) του **ΣΑΤ παραγωγής** και να συμπληρώσετε τα παρακάτω πεδία ως εξής:

«Όνομα Χρήστη»:	θα χρησιμοποιήσετε το user name της παραγωγής
«Κωδικός Πρόσβασης»:	θα χρησιμοποιήσετε το password της παραγωγής
«Σύστημα Σύνδεσης»:	satp1.athexnet.gr

Να σημειωθεί ότι **όλοι** οι χρήστες θα πρέπει να συνδεθούν στο **satp1.athexnet.gr** και μόνο.

The DSS production icon should be used for your connection.

The following fields should be completed accordingly:

"User name":	<i>fill in the production's user name</i>
"Password":	<i>fill in the production's password</i>
"Connection System":	<i>satp1.athexnet.gr</i>

*Please mention that **all** the users should connect to **satp1.athexnet.gr**.*

5. Πρόσβαση στο Δίκτυο XNET / Access to XNET

Το όνομα χρήστη των Windows, οι κωδικοί καθώς και τα συνθηματικά (passwords) των χρηστών της εφαρμογής XOrder Client που θα χρησιμοποιηθούν, θα είναι τα ίδια με αυτά που χρησιμοποιούνται στο σύστημα παραγωγής.

The username and the password of XOrder Client users will be the same with the ones used in the production environment.

6. Σενάρια Εκκαθάρισης στην αγορά Αξιών/*Clearing Scenarios Cash market*

Προκειμένου να εξασφαλιστεί η επιτυχής ολοκλήρωση της δοκιμής παρακαλούνται όλοι οι χειριστές του ΣΑΤ να συμμετάσχουν ακολουθώντας τις παρακάτω οδηγίες.

Ημερομηνία/Ωρα	Οθόνες	Σενάριο
9/3/2015 10:00 – 12:00	Risk Management→ Functions→CM Limits→Manage Trading Limits	Μεταβολή ορίων ΜΔ (κατά τη διάρκεια της συνεδρίασης, για αύξηση Πιστωτικού Ορίου και Μείωση Πιστωτικού Ορίου).
9/3/2015 10:00 – 14:00	Risk Management→ Reports	Έκδοση Καταστάσεων Ελέγχου
9/3/2015 10:00-14:00	Custody→ Functions → Inv. Shares Sec. Accounts→ Investor Trading Codes at Trading Member	Συσχέτιση κωδικού πελάτη με Μ.Δ.
9/3/2015 10:00-14:00	Custody →Files → Import → Import Inv Trading Codes file	Συσχέτιση κωδικού πελάτη με Μ.Δ. μέσω αρχείου.
9/3/2015 10:00-14:00	Custody →Files → Export → Clients' Trading Codes file	Εξαγωγή αρχείου Καταχωρημένων Κωδικών Πελατών σε ΜΔ.
9/3/2015 10:00-14:00	Clearing →Files → Export→ Export Aggregated Trades file	Το αρχείο αυτό παράγεται μετά τη φόρτωση των συναλλαγών από το ΟΑΣΗΣ στο ΣΑΤ.
9/3/2015 10:00 - 14:00	Clearing → Functions → Aggregated Trade Shaping Clearing → File→ Import → Import Shaping file	Διάρθρωση Συναλλαγών από οθόνη και αρχείο.

9/3/2015 10:00-14:00	Clearing → Functions → Intradays Managment	Δήλωση πράξεων Intraday
9/3/2015 10:00-14:00	Clearing → Reports	Έκδοση Καταστάσεων Ελέγχου
9/3/2015 10:00-14:00	Clearing → Reports → Custodian relation with Clearing Member	Σχέση Θεματοφύλακα με EM
9/3/2015 10:00-14:00	Clearing → Functions → Aggregated Trade Management	Από την οθόνη αυτή δίδεται η δυνατότητα να γίνει αναζήτηση καθώς και ενημέρωση κάποιων πεδίων.
9/3/2015 10:00-14:00	Clearing → Functions → Search Shifted Trades	Από την οθόνη αυτή δίδεται η δυνατότητα να γίνει μόνο αναζήτηση από τους Θεματοφύλακες.
9/3/2015 10:00-14:00	Clearing → Functions → Sell/Buys Trade Allocation	Ανάλυση Αγορών και Ανάλυση Πωλήσεων.
9/3/2015 10:00-14:00	Clearing → Files → Import → Import Allocation File	Εισαγωγή αρχείου για Ανάλυση Αγορών και Ανάλυση Πωλήσεων.
9/3/2015 10:00-14:00	Clearing → Functions → Buy/Sell Trade Shifting Clearing → Files → Import → Import Shifting File	Μεταθέσεις αγορών και πωλήσεων σε Θεματοφύλακες από οθόνη και αρχείο
9/3/2015 10:00-14:00	OTC Managment → Functions → OTC Transactions Managment	Εισαγωγή εντολών OTC από οθόνη και αρχείο με «Trade Type» → STOCK EX και OTC
CUT OF TIME για εντολές OTC και Ειδικές οδηγίες εντολών διακανονισμού STOCK_EX με ημερομηνία διακανονισμού την ίδια ημέρα (SD), 12:15		
9/3/2015 10:00-14:00	OTC Managment → Report → OTC Trades Detailed Report	Έκδοση Καταστάσεων Ελέγχου / Εξαγωγή Αρχείων (βλέπε εγχειρίδιο OTC)

9/3/2015 10:00-14:00	Clearing→ Reports	Έκδοση Καταστάσεων Ελέγχου για τον πολυμερή / διμερή διακανονισμό.
9/3/2015 10:00-14:00	Invoicing → Files → Export → Fees File	Εξαγωγή αρχείων αναλυτικών χρεώσεων Εξαγωγή Αρχείων OTC (βλέπε εγχειρίδιο OTC)

Επίσης, οι χειριστές μπορούν να προβούν σε οποιαδήποτε άλλη ενέργεια επιθυμούν όπως ενδεικτικά αναφέρονται:

- άνοιγμα μερίδας επενδυτή & Δήλωση χρήσης
- εκτύπωση στοιχείων μερίδας και λογαριασμού
- μεταφορά ποσότητας, χρεογράφου, λογαριασμού
- εκτυπώσεις ημερολογίου κινήσεων
- παραγωγή αρχείου ημερολογίου κινήσεων
- κ.λ.π.

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

<i>Date/Time</i>	<i>Screens</i>	<i>Scenario</i>
9/3/2015 10:00 – 12:00	Risk Management → Functions → CM Limits → Manage Trading Limits	Change of Trading Members' credit limits.
9/3/2015 10:00 – 14:00	Risk Management → Reports	Print out of risk related reports
9/3/2015 10:00-14:00	Custody → Functions → Inv. Shares Sec. Accounts → Investor Trading Codes at Trading Member	Definition of Investor code and Trading Member relation
9/3/2015 10:00-14:00	Custody → Files → Import → Import Inv Trading Codes file	Definition of Investor code and Trading Member relation
9/3/2015 10:00-14:00	Custody → Files → Export → Clients' Trading Codes file	"Registered clients' accounts on trading member" file export
9/3/2015 10:00-14:00	Clearing → Files → Export → Export Aggregated Trades file	Transactions file export

9/3/2015 10:00 - 14:00	Clearing → Functions → Aggregated Trade Shaping Clearing → File → Import → Import Shaping file	Transaction Edits using file import or DSS application.
9/3/2015 10:00-14:00	Clearing → Functions → Intradays Managment	Intraday transactions declaration
9/3/2015 10:00-14:00	Clearing → Reports	Clearing Reports print out
9/3/2015 10:00-14:00	Clearing → Reports → Custodian relation with Clearing Member	Definition of Custodian and Clearing Member relation
9/3/2015 10:00-14:00	Clearing → Functions → Aggregated Trade Management	Transaction Management
9/3/2015 10:00-14:00	Clearing → Functions → Search Shifted Trades	Transaction Search
9/3/2015 10:00-14:00	Clearing → Functions → Sell/Buys Trade Allocation	Allocation of Buys and Sells.
9/3/2015 10:00-14:00	Clearing → Files → Import → Import Allocation File	Allocation of Buys and Sells.
9/3/2015 10:00-14:00	Clearing → Functions → Buy/Sell Trade Shifting Clearing → Files → Import → Import Shifting File	Shifting of Buys and Sells to the custodians.
9/3/2015	OTC Managment →	OTC Registration

10:00-14:00	Functions → OTC Transactions Management	
CUT OF TIME for OTC & STOCK_EX orders with SD: same day at 12:15		
9/3/2015 10:00-14:00	OTC Management → Report → OTC Trades Detailed Report	OTC printouts
9/3/2015 10:00-14:00	Clearing → Reports	Cash settlement printouts
9/3/2015 10:00-14:00	Invoicing → Files → Export → Fees File	Fees' details file export OTC file export

The DSS Operators may also try any DSS function, like:

- Creation of Investor Share & Activations of Accounts.
- Printout of the Share and Account information.
- Transfer of securities between Sub-Accounts of the same Share.
- Printout of the daily registrations and bookings.
- File export of the daily registrations and bookings.
- e.t.c.

7. Σενάρια Εκκαθάρισης στην αγορά Παραγώγων / *Clearing Scenarios Derivatives market*

Προκειμένου να εξασφαλιστεί η επιτυχής ολοκλήρωση της δοκιμής παρακαλούνται όλοι οι χειριστές του ΣΑΤ 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.

7.1. Διαχείριση Κινδύνου / *Risk Management*

Στον παρακάτω πίνακα, υπάρχει μια σειρά από δοκιμές όπως εμφανίζονται παρακάτω:

Ημερομηνία/Ωρα	Οθόνες	Σενάριο
9/3/2015 10:00 – 12:00	Risk Management → Functions → C.M. Limits → Change Trading Member Limits	Μεταβολή ορίων ΜΔ (κατά τη διάρκεια της συνεδρίασης, για αύξηση Πιστωτικού Ορίου και Μείωση Πιστωτικού Ορίου).
9/3/2015 10:00 – 14:00	Risk Management → Reports	Έκδοση Καταστάσεων Ελέγχου

In the table below, there is a set of tests:

Date/Time	Screens	Scenario
9/3/2015 10:00 – 12:00	Risk Management → Functions → C.M. Limits → Manage Trading Limits	Change of Trading Members' credit limits.

7.2. Λογαριασμοί Θέσης / *Position Accounts*

Στον παρακάτω πίνακα, υπάρχει μια σειρά από δοκιμές όπως εμφανίζονται παρακάτω:

Ημερομηνία/Ωρα	Οθόνες	Σενάριο
9/3/2015 10:00 – 14:00	Derivatives Clearing → Environment → Position Accounts	Καταχώρηση νέου λογαριασμού θέσης & επαναχρησιμοποίηση από το EM του ίδιου reference code
9/3/2015 10:00 – 14:00	System Administration → CSV files: Derivatives → Position	Παραγωγή αρχείου λογαριασμών θέσης για <ul style="list-style-type: none"> • ΑΕΜ, αφήνοντας κενά τα πεδία clearing & trading member

	accounts	<ul style="list-style-type: none"> ΓΕΜ, αφήνοντας κενά τα πεδία clearing & trading member ή συμπληρώνοντας συγκεκριμένο κωδικό ΜΔ
9/3/2015 10:00 – 14:00	Derivatives Clearing →Environment → Position Accounts	Δυνατότητα εξαγωγής στοιχείων σε αρχείο, βάσει των κριτηρίων αναζήτησης
9/3/2015 10:00 – 14:00	Derivatives Clearing →Reports → Positions	Παραγωγή αναφοράς με συγκεκριμένα κριτήρια ή επιλέγοντας % σε όλες τις παραμέτρους για παραγωγή όλων των positions

In the table below, there is a set of tests:

Date/Time	Screens	Scenario
9/3/2015 10:00 – 14:00	Derivatives Clearing →Environment → Position Accounts	New position account registration & reuse of the same reference code by the clearing member
9/3/2015 10:00 – 14:00	System Administration →CSV files: Derivatives →Position accounts	Export position account file for: - DCM, without filling in the clearing & trading member fields - GCM, without filling in the clearing & trading member fields, or filling in a specific trading member code
9/3/2015 10:00 – 14:00	Derivatives Clearing →Environment → Position Accounts	Export data file based on specific query criteria
9/3/2015 10:00 – 14:00	Derivatives Clearing →Reports → Positions	Export report using specific criteria or choosing % in order to produce reports with all the positions.

7.3. Διαχείριση Ασφαλειών / *Collaterals management*

Στον παρακάτω πίνακα, υπάρχει μια σειρά από δοκιμές όπως εμφανίζονται παρακάτω:

Ημερομηνία/Ωρα	Οθόνες	Σενάριο
9/3/2015 10:00 – 12:30	Custody →Functions →Transfers → Transfer to/ from Customer Collateral Account	Εκτελείται η μεταφορά Κινητών Αξιών από το Λογαριασμό Αξιών του επενδυτή προς τον Λογαριασμό Ασφαλειών Πελατείας του Εκκαθαριστικού Μέλους και το αντίστροφο.

9/3/2015 10:00 – 12:30	Stock Derivatives →Functions →Collateral for AthexClear	Δέσμευση αξιών για ίδιο λογαριασμό
		Δέσμευση αξιών για λογαριασμό πελατείας
9/3/2015 10:00 – 14:00	System Administration→CSV files: Derivatives→ Margin Collateral Analysis	Margin Collateral Analysis

In the table below, there is a set of tests:

Date/Time	Screens	Scenario
9/3/2015 10:00 – 12:30	Custody →Functions →Transfers → Transfer to/ from Customer Collateral Account	The transfer of securities from the investor's securities account to the clientele collateral securities account and vice versa is executed.
9/3/2015 10:00 – 12:30	Stock Derivatives →Functions →Collateral for AthexClear	Pledge of securities for own account
		Pledge of securities for clientele
9/3/2015 10:00 – 14:00	System Administration→CSV files: Derivatives→ Margin Collateral Analysis	Margin Collateral Analysis

7.4. Εξασκήσεις / Exercise

Στον παρακάτω πίνακα, υπάρχει μια σειρά από δοκιμές όπως εμφανίζονται παρακάτω:

Ημερομηνία/Ωρα	Οθόνες	Σενάριο
9/3/2015 11:00 – 12:30	Derivatives Clearing →Actions → Exercise	Εξάσκηση σε δικαιώματα προαίρεσης επί μετοχών. Εκτέλεση αναζήτησης με τα παρακάτω κριτήρια: <ul style="list-style-type: none"> Position account (λογαριασμός θέσης) Series tr. Code (Σειρά)
9/3/2015 11:00 – 12:30	Derivatives Clearing →Actions → Cancel Exercise	Ακύρωση Εξάσκησης σε δικαιώματα προαίρεσης επί μετοχών.

9/3/2015 11:00 – 12:30	Derivatives Clearing →Actions → Exercise	Εξάσκηση σε SB & RA Εκτέλεση αναζήτησης με τα παρακάτω κριτήρια: <ul style="list-style-type: none"> • Position account (λογαριασμός θέσης) • Series tr. Code (Σειρά)
---------------------------	--	---

In the table below, there is a set of tests:

Date/Time	Screens	Scenario
9/3/2015 11:00 – 12:30	Derivatives Clearing →Actions → Exercise	Exercise of Stock Options. Run query with the following criteria: <ul style="list-style-type: none"> • Position account • Series tr. Code
9/3/2015 11:00 – 12:30	Derivatives Clearing →Actions → Cancel Exercise	Cancel of Stock Options Exercise.
9/3/2015 11:00 – 12:30	Derivatives Clearing →Actions → Exercise	Exercise of SB & RA. Run query with the following criteria: <ul style="list-style-type: none"> • Position account • Series tr. Code

7.5. Μεταφορές/ Transfers

Στον παρακάτω πίνακα, υπάρχει μια σειρά από δοκιμές όπως εμφανίζονται παρακάτω:

Ημερομηνία/Ωρα	Οθόνες	Σενάριο
9/3/2015 11:00 – 12:30	Derivatives Clearing →Actions → Transfer Application	Μεταφορά θέσης από έναν λογαριασμό σε άλλον (για τον ίδιο πελάτη) και αλλαγή υπολογαρισμού εκκαθάρισης.
9/3/2015 11:00 – 12:30	Derivatives Clearing →reports→ Transfer Applications	Παραγωγή αναφοράς με συγκεκριμένα κριτήρια όπως: <ul style="list-style-type: none"> - SN - Insert Date - Status ή επιλέγοντας % σε όλες τις παραμέτρους για παραγωγή όλων των μεταφορών

In the table below, there is a set of tests:

Date/Time	Screens	Scenario
-----------	---------	----------

9/3/2015 11:00 – 12:30	Derivatives Clearing →Actions → Transfer Application	Position transfer from one account to another (same owner) and sub-account change
9/3/2015 11:00 – 12:30	Derivatives Clearing →reports → Transfer Applications	Export report using specific criteria such as: - SN - Insert Date - Status or choosing % in order to produce reports with all the transfers.

7.6. Παρακολούθηση συναλλαγών / *Clearing Instructions monitoring*

Στον παρακάτω πίνακα, υπάρχει μια σειρά από αναζητήσεις που μπορούν να εκτελεστούν αναφορικά με την παρακολούθηση των συναλλαγών:

Ημερομηνία/Ωρα	Οθόνες	Σενάριο
9/3/2015 10:00 – 14:00	Derivatives Clearing →Environment → Clearing Instructions Information	Εκτέλεση αναζήτησης χρησιμοποιώντας συνδυασμούς από τα παρακάτω κριτήρια: - Trade date - position account - Series Tr. Code - Instruction type - Trading member - Status
9/3/2015 11:00 – 12:30	Derivatives Clearing →Environment → Clearing Instructions on line	Παρακολούθηση των clearing instructions On Line
9/3/2015 10:00 – 14:00	Derivatives Clearing →Environment → Positions	Παρακολούθηση των θέσεων χρησιμοποιώντας συγκεκριμένα φίλτρα , με δυνατότητα auto refresh και εξαγωγής στοιχείων σε αρχείο
9/3/2015 10:00 – 14:00	System Administration→CSV files: Derivatives	Παραγωγή σχετικών αναφορών

In the table below, there is a set of queries that can be performed regarding the transactions monitoring:

Date/Time	Screens	Scenario
-----------	---------	----------

9/3/2015 10:00 – 14:00	Derivatives Clearing →Environment → Clearing Instructions Information	Run query using combinations of the following criteria: - Trade date - position account - Series Tr. Code - Instruction type - Trading member - Status
9/3/2015 11:00 – 12:30	Derivatives Clearing →Environment → Clearing Instructions on line	Monitoring of clearing instructions On Line
9/3/2015 10:00 – 14:00	Derivatives Clearing →Environment → Positions	Monitoring of positions, using specific filters, with auto refresh and ability to export data
9/3/2015 10:00 – 14:00	System Administration →CSV files: Derivatives	Export of relevant files

7.7. Διαχείριση Συναλλαγών / *Clearing Instructions Management*

Στον παρακάτω πίνακα, υπάρχει μια σειρά από δοκιμές όπως εμφανίζονται παρακάτω:

Ημερομηνία/Ωρα	Οθόνες	Σενάριο
9/3/2015 12:00 – 12:15	Derivatives Clearing →Actions → Clearing Instruction Trade Management	Μέλος Διαπραγμάτευσης Τα Μέλη Διαπραγμάτευσης δύνανται να διορθώσουν τον Κωδικό Διαπραγμάτευσης σε περίπτωση λανθασμένης καταχώρησης στο σύστημα διαπραγμάτευσης. Η αλλαγή κωδικού διαπραγμάτευσης μπορεί να συνεπάγεται και αλλαγή Λογαριασμού Θέσης.
9/3/2015 12:00 – 12:30		Εκκαθαριστικό Μέλος Τα ΕΜ με τη διαδικασία της διάρθρωσης μπορούν να διορθώσουν τον Λογαριασμό Θέσης. Η διόρθωση αφορά περιπτώσεις λαθών όπου το ΜΔ κατά τη διαπραγμάτευση καταχώρισε λάθος κωδικό διαπραγμάτευσης.

9/3/2015 12:00 – 12:15	Derivatives Clearing →Actions → Clearing Instruction Split	Μέλος Διαπραγμάτευσης Δύναται να διασπάσει και να καταχωρίσει τους κωδικούς διαπραγμάτευσης των τελικών πελατών και ποσοτήτων στις συναλλαγές που έχουν γίνει σε Λογαριασμό Διαχειριστή
9/3/2015 12:00 – 12:30		Εκκαθαριστικό Μέλος Δύναται να διασπάσει και να καταχωρίσει τους ορθούς Λογαριασμούς Θέσης και ποσοτήτων στις συναλλαγές που έχουν γίνει σε Λογαριασμό Διαχειριστή/ Διαμεσολαβητή.
9/3/2015 10:00 – 14:00	Derivatives Clearing →reports→ transaction structure	Παραγωγή αναφοράς με συγκεκριμένα κριτήρια όπως: - Trading Date ή Trade SN
9/3/2015 11:00 – 12:00	Δυνατότητα καταχώρησης ειδικής σήμανσης για real time διακανονισμό	<ul style="list-style-type: none"> • Εκτέλεση της συναλλαγής • Εκκαθαριστικό μέλος: Αναζήτηση του clearing instruction από Clearing Instruction Trade Management • Μεταβολή του Indicator σε immediate • Έλεγχος της δημιουργίας θέσης (από account positions) • Πίστωση κινητών αξιών στον επενδυτή

In the table below, there is a set of tests:

Date/Time	Screens	Scenario
9/3/2015 12:00 – 12:15	Derivatives Clearing →Actions → Clearing Instruction Trade Management	Trading Member <i>Is used from Trading Members in order to change Trading Code or Clearing Sub Account.</i>
9/3/2015 12:00 – 12:30		Clearing Member <i>The Clearing Members using the shaping procedure can modify the position account.</i>
9/3/2015 12:00 – 12:15	Derivatives Clearing →Actions → Clearing Instruction Split	Trading Member <i>Is used from trading member in order to split and register the trading codes of end clients, as well as the quantities of transactions that have</i>

9/3/2015 12:00 – 12:30		<i>been executed in administrator account</i>
		<i>Clearing Member</i> <i>CM is able to split and register the correct position accounts , as well as the quantities of transactions that have been executed in administrator account</i>
9/3/2015 10:00 – 14:00	<i>Derivatives Clearing →reports → transaction structure</i>	<i>Export report using specific criteria such as:</i> <i>- Trading Date or Trade SN</i>
9/3/2015 11:00 – 12:00	<i>Real time settlement</i>	<ul style="list-style-type: none"> • <i>Execution of trade</i> • <i>Clearing member: Perform a query through the Clearing Instruction Trade Management and find the specific clearing instruction</i> • <i>Change the Indicator to immediate</i> • <i>Check that the account positions has been created</i>

7.8. Μετάθεση Εκκαθάρισης / *Clearing Give-up*

Στον παρακάτω πίνακα, υπάρχει μια σειρά από δοκιμές όπως εμφανίζονται παρακάτω:

Ημερομηνία/Ωρα	Οθόνες	Σενάριο
9/3/2015 12:00 – 12:30	Derivatives Clearing →Actions → Giveup / Takeup	Διαδικασία μεταφοράς συναλλαγών μεταξύ Υπολογαριασμών / Λογαριασμών Εκκαθάρισης διαφορετικών Εκκαθαριστικών Μέλων.
9/3/2015 10:00 – 14:00	Derivatives Clearing →reports→ GiveUp/takeUp	Παραγωγή αναφοράς με συγκεκριμένα κριτήρια όπως: - Trading Date ή Clearing System

In the table below, there is a set of tests:

Date/Time	Screens	Scenario
9/3/2015 12:00 – 12:30	Derivatives Clearing →Actions → Giveup / Takeup	Procedure regarding the transfer of trades between the subaccount/accounts of different Clearing members.
9/3/2015 10:00 – 14:00	Derivatives Clearing →reports →	Export report using specific criteria such as: - Trading Date or Clearing System

	GiveUp/takeUp	
--	---------------	--

7.9. Ημερήσιος Διακανονισμός / *Settlement*

Στον παρακάτω πίνακα, υπάρχει μια σειρά από δοκιμές όπως εμφανίζονται παρακάτω:

Ημερομηνία/Ωρα	Οθόνες	Σενάριο
9/3/2015 13:00 – 14:00	Derivatives Clearing → reports→ Settlement	Παραγωγή αναφοράς για τον ημερήσιο διακανονισμό.
9/3/2015 13:00 – 14:00	System Administration→CSV files: Derivatives	Εξαγωγή αρχείου «cash settlement»

In the table below, there is a set of tests:

Date/Time	Screens	Scenario
9/3/2015 13:00 – 14:00	Derivatives Clearing → reports→ Settlement	Export report for Settlement
9/3/2015 13:00 – 14:00	System Administration→CSV files: Derivatives	Export the file «cash settlement»

7.10. Δανεισμός Μετοχών / *Stock Lending*

Στον παρακάτω πίνακα, υπάρχει μια σειρά από δοκιμές όπως εμφανίζονται παρακάτω:

Ημερομηνία/Ωρα	Οθόνες	Σενάριο
9/3/2015 10:00 – 14:00	Custody →functions→stock lending	Προετοιμασία μετοχών για δανεισμό Ο θεματοφύλακας μπορεί να προβεί στις σχετικές ενέργειες προκειμένου να δηλώσει την πρόθεση του πελάτη του να δανείσει διαθέσιμες μετοχές
9/3/2015 10:00 – 14:00	Stock lending Report	Παραγωγή αναφοράς με συγκεκριμένα κριτήρια όπως: - SN - Registration Date From-To - Account - Security - Action

		ή επιλέγοντας μόνο το Registration Date From-To και δηλώνοντας % στις υπόλοιπες παραμέτρους
--	--	---

In the table below, there is a set of tests:

Date/Time	Screens	Scenario
9/3/2015 10:00 – 14:00	Custody →functions →stock lending	Preparation for Stock lending The custodian can proceed to the relevant actions in order to declare the clients intention to lend his stocks
9/3/2015 10:00 – 14:00	Stock lending Report	Export report using specific criteria such as:- SN - Registration Date From-To - Account - Security - Action Or choosing only the Registration Date From-To and % to the other parameters

8. Σενάρια Συστήματος Διαπραγμάτευσης / *Trading System Scenarios*

Σκοπός των σεναρίων αυτού του κεφαλαίου είναι να αποτελέσουν έναν οδηγό για τα μέλη Διαπραγμάτευσης στην αγορά Αξιών και Παραγώγων προκειμένου να δοκιμάσουν την σύνδεση των συστημάτων τους και να πιστοποιήσουν την ορθή λειτουργικότητά τους στο σύνολό τους.

The scope of this section is to guide the Trading Members of Cash and Derivatives Markets in order to ensure that their systems will fully operate from the Disaster Site.

8.1. Εισαγωγή εντολών/ *Order entering*

- Εισάγετε εντολές κατά τη διάρκεια της συνεδρίασης.
- Παρατηρήστε την απεικόνιση της Υπολογιζόμενης Τιμής και Όγκου Ανοίγματος (Projected Opening Price/Volume) κατά τη διάρκεια της προσυνεδρίασης.
- Διαπιστώστε ότι στην επιλογή “Πληροφορίες Μετοχής” και στην σχετική στήλη στις σελίδες τιμών, εμφανίζεται η Τιμή και ο Όγκος Ανοίγματος.
- Παρατηρήστε ότι λαμβάνετε όλα τα μηνύματα που αφορούν τις αγορές, τα πακέτα, τις πράξεις σας και μηνύματα από άλλο χρήστη ή από το Χρηματιστήριο.
- *Enter orders during the trading.*
- *Check the calculated Projected Opening Price / Volume during the pre-call phase.*
- *Check that the options “Open price” and “Open volume” appear in the Security Information window*
- *Note that you receive all the messages regarding the market phases, the pre-agreed trades, the trades and the ATHEX messages.*

8.2. Προ-συμφωνημένες συναλλαγές/ *Pre-Agreed Trades*

- Εισάγετε προσυμφωνημένες συναλλαγές και παρατηρήστε την σελίδα «Συναλλαγές».
- Επιβεβαιώστε ότι τα πακέτα επηρεάζουν το διαθέσιμο πιστωτικό όριο ή όχι με βάση τον Κανονισμό και τις Αποφάσεις του ΧΑ.
- *Execute pre-agreed trades and check the page with your trades*
- *Ensure that all the pre-agreed trades consume your available Credit Limit, or no according to ATHEX Rulebook and Resolutions*

8.3. Στατιστικές Πληροφορίες/ *Statistical Information*

- Επιλέξτε να δείτε το πιστωτικό όριο του μέλους (Shift + F7)
- Επιλέξτε να δείτε τις πληροφορίες για μια συγκεκριμένη μετοχή.
- Επιλέξτε να δείτε τις Στατιστικές Πληροφορίες
- *Check the Member's Credit Limit from the shortcut key (Shift + F7)*
- *Check the Security Information for a specific stock*
- *Select the page of Securities Activity and check the information*

8.4. Αρχείο Συναλλαγών/ *Transaction file*

Μετά την ολοκλήρωση της συνεδρίασης τα Μέλη μπορούν να κατεβάσουν το αρχείο συναλλαγών από το ORAMA (με Managing Director – View all χρήση).

After the completion of the trading session, members will be able to download the reconciliation file from the ORAMA application.

9. Σενάρια δικτύου XNET / XNET Scenarios

Σκοπός των σεναρίων αυτού του κεφαλαίου είναι να αποτελέσουν έναν οδηγό για τα μέλη που έχουν πρόσβαση στη διαπραγμάτευση σε αλλοδαπές αξίες μέσω του δικτύου XNET προκειμένου να δοκιμάσουν την συνδεσιμότητα των συστημάτων τους.

The scope of this section is to guide the Trading Members of XNET in order to ensure that their systems will connect and operate from the Disaster Site.

9.1. Έλεγχος πρόσβασης στην εφαρμογή XOrder Client / Access to XOrder Client

Για την είσοδο στην εφαρμογή πληκτρολογείτε στον Internet Explorer την ηλεκτρονική διεύθυνση <http://xnet.athexnet.gr> και στο παράθυρο που εμφανίζεται επιλέξτε “Είσοδος”.

Επιβεβαιώστε ότι είστε συνδεδεμένοι επιτυχώς στο σύστημα βλέποντας την ένδειξη «Καλωσήλθατε» και το «Όνομα Χρήστη» που συμπληρώσατε, στην πάνω δεξιά γωνία της κεντρικής σελίδας της εφαρμογής X-Order Client.

Type the url: <http://xnet.athexnet.gr> and select the button “Login” in order to connect to X-order Client.

Ensure that you are successfully logged in.

9.2. Έλεγχος Πιστωτικών Ορίων / Credit Limits' Check

Ελέγξτε μέσω της οθόνης «Θέσεις Πελάτη», όπου δίνεται η δυνατότητα παρακολούθησης του ημερήσιου διαθέσιμου και καταναλωθέντος πιστωτικού ορίου, ότι έχουν φορτωθεί επιτυχώς τα Πιστωτικά Όρια για το XNET.

Check your Credit Limits in XNET and ensure that the credit limits are successfully uploaded from the DSS.

10. Αναφορά Προβλημάτων / *Problem Report*

Κατά την Γενική Εικονική Συνεδρίαση και εφόσον τα Μέλη αντιμετωπίσουν οποιοδήποτε πρόβλημα (τεχνικό ή άλλο), θα πρέπει να επικοινωνήσουν τηλεφωνικά, μέσω FAX, ή e-mail ως εξής:

During the General Mock Trading session and in case that the Members face any problem (technical or other), they should contact through tel. fax, or e-mail the following:

- Για τις Αγορές του ΧΑ και για θέματα συστήματος ΟΑΣΗΣ/

For ATHEX Markets & other OASIS issues

Τμήμα Εξυπηρέτησης Μελών / Members' Support Department

Τηλ./Tel: + 30 - 210 - 33.66.385 & 33.66.393

Fax.: + 30 - 210 - 33.66.286

E-mail: Members-Support@helex.gr

- Για τις Αγορές του ΧΑΚ/

For CSE Markets & other OASIS issues

Τμήμα Συναλλαγών / Trading Department

Τηλ./Tel: +357 22 712.455,

Fax.: +357 22 570.308

E-mail: info@cse.com.cy

Οι συμμετέχοντες θα πρέπει να συμπληρώσουν τη «Φόρμα Αναφοράς Προβλήματος» που επισυνάπτεται και να τη στείλουν μετά το πέρας της Γενικής Εικονικής Συνεδρίασης στα παραπάνω σημεία επαφής.

Η μη παράδοση ή αποστολή «Φόρμας Αναφοράς Προβλήματος» από την πλευρά των συμμετεχόντων θα εκληφθεί ως έλλειψη προβλημάτων.

Moreover, in case of a problem, all participants should complete the "Problems Report Form" and send it attached to the above contact points, after the end of the Final Mock Trading session.

Non delivery of the "Problems Report Form" will be considered as the lack of any problem on behalf of the participants.

ΧΡΗΜΑΤΙΣΤΗΡΙΟ ΑΘΗΝΩΝ Α.Ε./ **ATHEX**

Φόρμα Αναφοράς Προβλήματος / *Problems Report Form*

Ημερομηνία / **Date** **07/03/2015**

Επωνυμία Μέλους / *Member's Name:*

Όνομα Υπευθύνου / *Contact person:*

Τηλ. / *Tel:*

Fax:

E-mail:

Επιλέξτε την Αγορά στην οποία αντιμετωπίσατε πρόβλημα /

Select the Market where the problem appears:



Χρηματιστήριο Αθηνών / **ATHEX**



Χρηματιστήριο Κύπρου / **CSE**

A/A	Τερματικό Workstation	Κωδ. Χρήστη User's ID	Ώρα Time	Περιγραφή προβλήματος Problem Description

Παρακαλούμε αποστείλατε τη φόρμα μέσω e-mail ή FAX στη διεύθυνση που αφορά:

Please, send this form via email or fax to the relevant address:

XA / **ATHEX**: e-mail: Members-Support@helex.gr fax: + 30 - 210 - 33.66. 286

XAK / **CSE**: e-mail: info@cse.com.cy fax: +357 22 570.308

(Όνομα – Υπογραφή)