

ATHEXCLEAR

Εκκαθάριση Συναλλαγών

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

**ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ Α
Τεχνικές Προδιαγραφές Υπηρεσίας
EMIR - TR**

Έκδοση 1.22

Ιούνιος 2024

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 παλαιών συναλλαγών-Μετάβαση στον Καν. EMIR REFIT 6	
3. Υπηρεσία EMIR - TR	7
3.1. Περιγραφή της υπηρεσίας	7
4. Περιγραφή των πεδίων που θα περιλαμβάνονται στα δεδομένα των αναφορών για συναλλαγές που εκκαθαρίζονται από την ET.EK.	8
4.1. Περιγραφή του κωδικού UTI.....	8
4.1.1. Περιγραφή του κωδικού UTI για αναφορά συναλλαγών.....	9
4.1.2. Περιγραφή του κωδικού UTI για αναφορά θέσεων.....	9
4.2. Περιγραφή του κωδικού RTN (Report Tracking Number)	10
4.3. Περιγραφή του πεδίου Subsequent position UTI	10
4.4. Περιγραφή των προϊόντων	10
4.5. Κωδικός LEI της ET.EK.....	11
4.6. Delta	11
4.7. Περιγραφή Πεδίων για τις αναφορές της ET.EK	11
4.8. Περιγραφή Πεδίων που αφορούν το περιθώριο ασφάλισης	18
5. Στοιχεία που απαιτούνται από τα Εκκαθαριστικά Μέλη για την παροχή της υπηρεσίας EMIR-TR για συναλλαγές που εκκαθαρίζονται από την ET.EK.	23
5.1. Γραμμογράφηση στοιχείων Πελατών για συναλλαγές που εκκαθαρίζονται από την ET.EK. (ETD Supplementary Trade & Position Data File)	24
5.2. Γραμμογράφηση ασφαλειών ανά Πελάτη (Λογαριασμό Θέσης) για συναλλαγές που εκκαθαρίζονται από την ET.EK. (ETD Supplementary Margin Data File)	27
6. Στοιχεία για την παροχή της υπηρεσίας EMIR-TR για συναλλαγές που δεν εκκαθαρίζονται από την ET.EK.	28
7. Γραμμογράφηση αρχείου εξουσιοδότησης με LEI πελατών για συναλλαγές εντός & εκτός ET.EK. (Delegation File)	28
8. Αίτηση για τη συμμετοχή Εκκαθαριστικού Μέλους στην Υπηρεσία	29

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»
1.19	24 Ιανουαρίου 2024	Προσαρμογές σύμφωνα με τον νέο Κανονισμό EMIR-REFIT
1.20	1 Φεβρουαρίου 2024	Αλλαγές στην Παράγραφο 5 λόγω: - Τροποποίησης στη γραμμογράφιση στοιχείων Πελατών για συναλλαγές που εκκαθαρίζονται από την ΕΤ.ΕΚ., ώστε να επιτρέπονται μόνο Νομικά Πρόσωπα
1.21	18 Απριλίου 2024	Αλλαγές στην Παράγραφο «4.7.Περιγραφή Πεδίων για τις αναφορές της ΕΤ.ΕΚ.» λόγω διευκρίνσης για τις τιμές του πεδίου 1.17 όταν γίνεται αναφορά μηδενικής θέσης σε επίπεδο PSTN Αλλαγές στην Παράγραφο «4.8.Περιγραφή Πεδίων που αφορούν το περιθώριο ασφάλισης» λόγω τροποποίησης στις τιμές των πεδίων 3.15 και 3.23
1.22	19 Ιουνίου 2024	Αλλαγή στο πεδίο 2.30 «Clearing Obligation» με έναρξη εφαρμογής 25/06/2024

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) όπως εκάστοτε ισχύει.

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

Επίσης περιγράφει την υπηρεσία που προσφέρει η ΕΤ.ΕΚ. στα Εκκαθαριστικά Μέλη της αλλά και τους Πελάτες τους που υπόκεινται στην υποχρέωση αναφοράς.

2. Υποχρεώσεις αναφοράς με βάση τον Κανονισμό EMIR

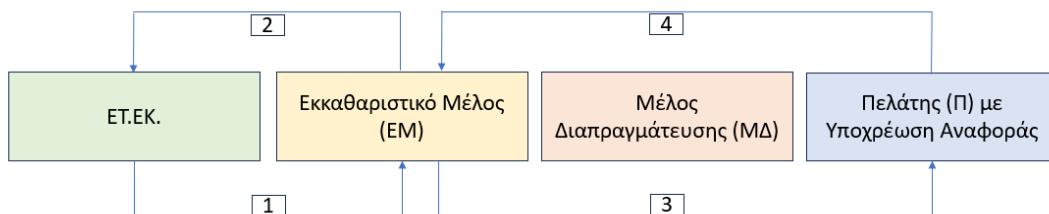
2.1. Εύρος Εφαρμογής

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 ΕΤ.ΕΚ. ως Κεντρικός Αντισυμβαλλόμενος κάθε συναλλαγή που πραγματοποιείται έχει σαν αντισυμβαλλόμενους, για τις ανάγκες της αναφοράς συναλλαγών, τα Εκκαθαριστικά Μέλη, την ΕΤ.ΕΚ. και τους Πελάτες.

Στο επόμενο σχήμα παρουσιάζεται η γενική περίπτωση συναλλαγής καθώς και οι τέσσερις αναφορές που θα πρέπει να καταχωρηθούν, όπως φαίνεται και στον επόμενο πίνακα. Τα σκέλη (Legs) των αναφορών αντικατοπτρίζονται με τους αριθμούς 1 έως 4.



Legs	UTI	Report Tracking Number	Counterparty 1 (Reporting Counterparty)	Counterparty 2	Clearing Member	Venue of Execution	Central Counterparty
1	UTI1	RTN	ET.EK.	EM	EM	XADE/HEDE	ET.EK.
2	UTI1	RTN	EM	ET.EK.	EM	XADE/HEDE	ET.EK.
3	UTI2	RTN	EM	Π	EM	XADE/HEDE	ET.EK.
4	UTI2	RTN	Π	EM	EM	XADE/HEDE	ET.EK.

Στις παραπάνω αναφορές χρησιμοποιείται κοινό Unique Trade Identifier (UTI) για τις συναλλαγές μεταξύ δύο αντισυμβαλλομένων. Το Report Tracking Number (RTN) των αναφορών θα είναι μοναδικό για όλα τα σκέλη 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. 1855/2022.

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 ενσωματώνονται 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. Cascading), 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 (PUTI) το οποίο θα διατηρείται σταθερό μέχρι τη λήξη του προϊόντος που αφορά (βλέπε παράγραφο 4.1.2).

2.4. Υποχρέωση αναφοράς παλαιών συναλλαγών-Μετάβαση στον Καν. EMIR REFIT

Οι συναλλαγές που ήταν ανοιχτές στις 26 Απριλίου 2024 πρέπει να αναφερθούν εντός 180 ημερών από την ημερομηνία έναρξης της υποχρέωσης αναφοράς (29 Απριλίου 2024), εφόσον είναι ακόμα ανοιχτές κατά την ημερομηνία αυτή. Η αναφορά των ανοιχτών

συναλλαγών κατά την περίοδο μετάβασης, πρέπει να πραγματοποιηθεί σύμφωνα με τις προδιαγραφές ESMA.

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 ΕΤ.ΕΚ. για τις συναλλαγές που εκκαθαρίζει, παρέχει προς τα Εκκαθαριστικά Μέλη της την υπηρεσία EMIR- TR προκειμένου να διευκολύνει τα Εκκαθαριστικά 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 ΕΤ.ΕΚ. 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:

- i. Αναφορά για κάθε συναλλαγή που συνάπτει το Εκκαθαριστικό Μέλος στην Αγορά Παραγώγων του Χρηματιστηρίου Αθηνών (ΧΑ) ή του Ελληνικού Χρηματιστηρίου Ενέργειας (ΕΧΕ) με την ΕΤ.ΕΚ. και με τους Πελάτες του, για την οποία υπόχρεος αναφοράς είναι το Εκκαθαριστικό Μέλος.
- ii. Αναφορά για κάθε συναλλαγή που συνάπτουν οι Εξουσιοδοτούντες Πελάτες του Εκκαθαριστικού Μέλους, με το Εκκαθαριστικό Μέλος στην Αγορά Παραγώγων του Χρηματιστηρίου Αθηνών (ΧΑ) ή του Ελληνικού Χρηματιστηρίου Ενέργειας (ΕΧΕ), για την οποία υπόχρεοι αναφοράς είναι οι Εξουσιοδοτούντες Πελάτες.
- iii. Αναφορά για συναλλαγή επί παραγώγων που συνάπτει εξωχρηματιστηριακά ή σε άλλες οργανωμένες/ρυθμιζόμενες αγορές, το Εκκαθαριστικό Μέλος ή οι Εξουσιοδοτούντες Πελάτες του για την οποία υπόχρεος αναφοράς είναι το Εκκαθαριστικό Μέλος ή οι Εξουσιοδοτούντες Πελάτες του αντίστοιχα.

Οι παραπάνω δυνατότητες δίνονται ως επιλογή στα Εκκαθαριστικά Μέλη και αφορούν την αναφορά συναλλαγών και την αναφορά θέσεων. Σημειώνεται ότι δεν δίνεται η δυνατότητα στα Εκκαθαριστικά Μέλη να επιλέξουν την αποστολή αναφορών που περιγράφεται στα (ii) ή (iii) παραπάνω, χωρίς να έχουν επιλέξει την αποστολή αναφορών που περιγράφεται στο (i).

Η ΕΤ.ΕΚ. σε κάθε περίπτωση, ακόμα και εάν ένα Εκκαθαριστικό 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 Εκκαθαριστικά Μέλη για αρχειοθέτηση

Σε περίπτωση λάθους κατά την δημιουργία και αποστολή των αναφορών, θα πραγματοποιείται η απαιτούμενη διόρθωση από την ET.EK. ή και σε συνεργασία με το Εκκαθαριστικό Μέλος, αν απαιτείται.

Η καθημερινή ροή των αρχείων τα οποία αποστέλλονται από την ET.EK. στο συνεργαζόμενο Trade Repository και θα είναι διαθέσιμα στο Εκκαθαριστικό Μέλος – Πελάτη της υπηρεσίας, μέσω της εφαρμογής του AMP-EMIR TR, θα περιλαμβάνει:

- Αρχείο xml (ISO 20022) με τις συναλλαγές που πραγματοποιήθηκαν από το Εκκαθαριστικό Μέλος και τους Πελάτες του τη συγκεκριμένη ημερομηνία συναλλαγών καθώς και τις θέσεις στις οποίες ενσωματώνονται οι συναλλαγές αυτές (auth.030)
- Αρχείο xml (ISO 20022) με την αναφορά του margin του Εκκαθαριστικού Μέλους ή / και των Πελατών του, όπως αυτό διαμορφώθηκε για την θέση της συγκεκριμένης ημερομηνίας αναφοράς (auth.108)

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 ET.EK. η παρακολούθηση των θέσεων και των συναλλαγών (αφού δεν έχει τα συγκεκριμένα στοιχεία) και επομένως δεν μπορεί να προσφέρει στα Εκκαθαριστικά Μέλη την υπηρεσία δημιουργίας και αποστολής των αναφορών.

Για συναλλαγές που δεν εκκαθαρίζονται από την ET.EK. ή εμπίπτουν στην περίπτωση της παραπάνω παραγράφου, η υπηρεσία θα προσφέρεται στα Εκκαθαριστικά Μέλη με περιορισμένη λειτουργικότητα. Συγκεκριμένα θα δίνεται η δυνατότητα στα Εκκαθαριστικά Μέλη, να καταχωρούν τις αναφορές τους, οι οποίες θα προώθουνται από την ET.EK. προς το Trade Repository. Στοιχεία για την παροχή της υπηρεσίας για συναλλαγές που δεν εκκαθαρίζονται από την ET.EK., περιγράφονται στην Παράγραφο 6.

4. Περιγραφή των πεδίων που θα περιλαμβάνονται στα δεδομένα των αναφορών για συναλλαγές που εκκαθαρίζονται από την ET.EK.

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

4.1. Περιγραφή του κωδικού UTI

Κάθε αναφορά συναλλαγής, ή θέσης που αποστέλλεται σε Trade Repository 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 το UTI θα δημιουργείται σύμφωνα με τον παρακάτω πίνακα:

Πεδίο	Μήκος	Τιμή	Παρατηρήσεις
LEI	20	Legal Entity Identifier	Το LEI της ET.EK. για LEG 1-2 και το LEI του Clearing Member για LEG 3-4
MIC αγοράς	4	XADE, HEDE	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	
Αριθμός Συναλλαγής Εκκαθάρισης Στο Σύστημα Εκκαθάρισης	max 10	Ο αριθμός της συναλλαγής προς εκκαθάριση (πεδίο SN, κωδικός έως δέκα ψηφία που είναι μοναδικός μέσα σε μία ημέρα)	

4.1.2. Περιγραφή του κωδικού UTI για αναφορά θέσεων

Όταν πρόκειται για αναφορά θέσης και συγκεκριμένα για τα Leg 1-2 το UTI θα δημιουργείται σύμφωνα με τον παρακάτω πίνακα:

Πεδίο	Μήκος	Τιμή	Παρατηρήσεις
LEI	20	Legal Entity Identifier	Το LEI της ET.EK. για LEG 1-2
MIC αγοράς	4	XADE, HEDE	Σταθερή τιμή. Είναι το MIC της αγοράς
Τύπος Αναφοράς	1	P	Σταθερή τιμή για όλες τις αναφορές θέσεων
Κωδικός Εκκαθαριστικού Μέλους	10	Ο κωδικός Εκκαθαριστικού Μέλους στο Σύστημα Εκκαθάρισης	
Κωδικός προϊόντος	max 15	Ο κωδικός σειράς του προϊόντος	Εάν στην σειρά υπάρχει ο χαρακτήρας «.», αυτός θα αντικαθίσταται με τον χαρακτήρα «D»

Όταν πρόκειται για αναφορά θέσης και συγκεκριμένα για τα Leg 3-4 το UTI θα δημιουργείται σύμφωνα με τον παρακάτω πίνακα:

Πεδίο	Μήκος	Τιμή	Παρατηρήσεις
LEI	20	Legal Entity Identifier	Το LEI του Clearing Member για LEG 3-4
Τύπος Αναφοράς	1	P	Σταθερή τιμή για όλες τις αναφορές θέσεων
Λογαριασμός Θέσης	max 16	Ο κωδικός αναφοράς του Λογαριασμού Θέσης	Εάν στον Λογαριασμό Θέσης υπάρχει ο χαρακτήρας «_» ή «-», αυτοί θα αντικαθίσταται με τον χαρακτήρα «Z»
Κωδικός προϊόντος	max 15	Ο κωδικός σειράς του προϊόντος	Εάν στην σειρά υπάρχει ο χαρακτήρας «.», αυτός θα αντικαθίσταται με τον χαρακτήρα «D»

Σημείωση: Ο Λογαριασμός Θέσης, χρησιμοποιείται μόνο στα UTI θέσεων μεταξύ Εκκαθαριστικού Μέλους - Πελάτη και αντίστροφα, και όχι στα UTI θέσεων μεταξύ ET.EK. - Εκκαθαριστικού Μέλους και αντίστροφα.

4.2. Περιγραφή του κωδικού RTN (Report Tracking Number)

Σε επίπεδο συναλλαγής, το RTN θα ταυτίζεται με τον αριθμό συναλλαγής στο Σύστημα Διαπραγμάτευσης (OASIS Trade Number). Σε επίπεδο θέσης θα είναι KENO.

4.3. Περιγραφή του πεδίου Subsequent position UTI

Σε επίπεδο συναλλαγής, θα δηλώνεται το UTI της θέσης (PUTI) στην οποία θα ενσωματωθεί η συναλλαγή. Σε επίπεδο θέσης, θα είναι KENO.

4.4. Περιγραφή των προϊόντων

Για τον καθορισμό των προϊόντων, στις αναφορές χρησιμοποιούνται από την ET.EK. οι κωδικοί CFI και ISIN στα πεδία αναγνώρισης του προϊόντος. Αναλυτικότερη περιγραφή ακολουθεί στην παράγραφο 4.7.

Το CFI των προϊόντων καταγράφεται στον επόμενο πίνακα:

Προϊόντα	Product Classification (CFI)
Index Futures	FFICSX
Stock Futures	FFSPSX
Call Index Options (European)	OCEICS

Put Index Options (European)	OPEICS
Call Stock Option (American)	OCASPS
Put Stock Option (American)	OPASPS
Energy Futures	FCHCSX

4.5. Κωδικός LEI της ET.EK.

Ο κωδικός LEI της ET.EK. είναι ο **213800IW53U9JMJ4QR40**.

4.6. Delta

Το delta παρουσιάζει το πόσο αναμένεται να μεταβληθεί η τιμή ενός Δικαιώματος Προαίρεσης (Option) σε σχέση με την μεταβολή στην τιμή του υποκείμενου. Για παράδειγμα, ένα Delta ίσο με 0,40 σημαίνει ότι η τιμή του Option θα κινείται θεωρητικά 0,40 € για κάθε μεταβολή κατά 1 € στην τιμή του υποκείμενου. Ο τύπος για τον υπολογισμό του Delta, απεικονίζεται στην ενότητα **4.7** και συγκεκριμένα στο πεδίο **2.25 «Delta»**.

Το Delta σαν μετρικό, υπολογίζεται μόνο στην περίπτωση των Options, είτε το συμβόλαιο είναι **Call Option** είτε **Put Option**. Ισχύουν τα ακόλουθα:

- Για τα Call Options, το Delta θα κυμαίνεται μεταξύ του **0** και του **1**, δηλαδή **Delta ∈ [0, 1]**
- Για τα Put Options, το Delta θα κυμαίνεται μεταξύ του **-1** και του **0**, δηλαδή **Delta ∈ [-1, 0]**

Η τιμή του Delta σε κάποιες περιπτώσεις δύνανται να βγει εκτός των ενδεδειγμένων ορίων. Όταν συμβαίνει αυτό θα χρησιμοποιείται αντιστοίχως η τιμή του άνω ή κάτω ορίου του αντίστοιχου διαστήματος.

Σύμφωνα με τον Κανονισμό EMIR REFIT και τον τρόπο με τον οποίο η ET.EK. αναφέρει τις συναλλαγές της, το πεδίο Delta θα συμπληρώνεται κατά την αποστολή του Valuation Update. Το Valuation Update αποστέλλεται καθημερινά, και συνεπώς το Delta θα αναπροσαρμόζεται κάθε ημέρα με βάση τις τρέχουσες συνθήκες της αγοράς, δηλαδή τις τιμές που ισχύουν για το Option Fixing και το Underlying Price, κατά την T και T-1, όπου T η τρέχουσα ημέρα συναλλαγών.

4.7. Περιγραφή Πεδίων για τις αναφορές της ET.EK.

Στον επόμενο πίνακα παρουσιάζονται τα πεδία των αναφορών όπως θα συμπληρώνονται από την ET.EK.

Πεδίο Κανονισμού*	Πεδίο	Τρόπος συμπλήρωσης
1.1	Reporting timestamp	Ημερομηνία και ώρα κατά την οποία δημιουργείται το αρχείο αναφοράς ISO 8601 UTC time format YYYY-MM-DDThh:MM:SSZ
1.2	Report submitting entity ID	ET.EK. LEI 213800IW53U9JMJ4QR40
1.3	Entity responsible for reporting	KENO
1.4	Counterparty 1 (Reporting counterparty)	Leg1: LEI ET.EK. Leg2: LEI Εκκαθαριστικού Μέλους Leg3: LEI Εκκαθαριστικού Μέλους Leg4: LEI Πελάτη Εκκαθαριστικού Μέλους, σε περίπτωση Νομικού προσώπου
1.5	Nature of the counterparty 1	F = Financial Counterparty N = Non-Financial Counterparty C = Central Counterparty O = Other
1.6	Corporate sector of the counterparty 1	Εάν το πεδίο 1.5 είναι C ή O : KENO Εάν το πεδίο 1.5 είναι F : INVF/CDTI/INUN/UCIT/ORPI/AIFD/CSDS Εάν το πεδίο 1.5 είναι N : A/B/C/D/E/F/G/H/I/J/K/L/M/N/O/P/Q/R/S/T/U
1.7	Clearing threshold of counterparty 1	Εάν το πεδίο 1.5 είναι C ή O : KENO Εάν το πεδίο 1.5 είναι F ή N : TRUE / FALSE
1.8	Counterparty 2 identifier type	Εάν ο Counterparty 2 είναι Legal Entity: TRUE Εάν ο Counterparty 2 είναι Natural Person: FALSE
1.9	Counterparty 2	Εάν ο Counterparty 2 είναι Legal Entity: LEI Εάν ο Counterparty 2 είναι Natural Person: LEI Εκκαθαριστικού Μέλους + Λογαριασμός Θέσης
1.10	Country of the counterparty 2	Εάν το πεδίο 1.8 είναι FALSE : Χώρα Φορολογικής Κατοικίας Εάν το πεδίο 1.8 είναι TRUE : KENO
1.11	Nature of the counterparty 2	F = Financial Counterparty N = Non-Financial Counterparty C = Central Counterparty O = Other
1.12	Corporate sector of the counterparty 2	Εάν το πεδίο 1.11 είναι C ή O : KENO Εάν το πεδίο 1.11 είναι F : INVF/CDTI/INUN/UCIT/ORPI/AIFD/CSDS Εάν το πεδίο 1.11 είναι N : A/B/C/D/E/F/G/H/I/J/K/L/M/N/O/P/Q/R/S/T/U
1.13	Clearing threshold of counterparty	Εάν το πεδίο 1.11 είναι C ή O : KENO Εάν το πεδίο 1.11 είναι F ή N : TRUE / FALSE

1.14	Reporting obligation of the counterparty 2	Εάν το πεδίο 1.8 είναι FALSE: FALSE αλλιώς TRUE
1.15	Broker ID	KENO
1.16	Clearing Member	LEI του Εκκαθαριστικού Μέλους, εάν υπάρχει
1.17*	Direction	Εάν ο Reporting counterparty είναι αγοραστής : BYER Εάν ο Reporting counterparty είναι πωλητής : SLLR
1.18	Direction of leg 1	KENO
1.19	Direction of leg 2	KENO
1.20	Directly linked to commercial activity or treasury financing	Για PSTN Level ή εάν το πεδίο 1.5 συμπληρώνεται με F ή C ή O : KENO Για TCTN Level και εάν το πεδίο 1.5 είναι N : TRUE / FALSE
2.1	Unique Trade Identifier (UTI)	Βλέπε παράγραφο 4.1
2.2	Report tracking number	Για αναφορά θέσεων (PSTN Level): KENO Για αναφορά συναλλαγών (TCTN Level): Oasis Trade Number
2.3	Prior UTI	KENO
2.4	Subsequent position UTI	Το UTI της θέσης (PUTI) όπου ενσωματώνεται μια συναλλαγή. Συμπληρώνεται μόνο σε TCTN Level και Action Type POSC <i>Στις υπόλοιπες περιπτώσεις είναι KENO</i>
2.5	PTRR ID	KENO
2.6	Package identifier	KENO
2.7	ISIN	ISO 6166 ISIN κωδικός αλφαριθμητικός κωδικός 12 χαρακτήρων
2.8	Unique product identifier (UPI)	KENO
2.9	Product classification	ISO 10962 CFI κωδικός αλφαριθμητικός κωδικός 6 χαρακτήρων
2.10	Contract type	FUTR για Futures OPTN για Options
2.11	Asset class	EQUI για XADE (ATHEX) COMM για HEDE (HEEX)
2.12	Derivative based on crypto-assets	FALSE
2.13	Underlying identification type	Για EQUI : I για Stock Futures / Stock Options X για Index Futures / Index Options Για COMM : KENO
2.14	Underlying identification	Για I ή X στο πεδίο 2.13 ISO 6166 ISIN κωδικός αλφαριθμητικός κωδικός 12 χαρακτήρων

2.15	Indicator of the underlying index	KENO
2.16	Name of the underlying index	Για X στο πεδίο 2.13 Το όνομα του υποκείμενου δείκτη αλλιώς KENO
2.17	Custom basket code	KENO
2.18	Identifier of the basket's constituents	KENO
2.19	Settlement currency 1	EUR για Cash Settlement αλλιώς KENO
2.20	Settlement currency 2	KENO
2.21	Valuation amount	<p>Για options: Τιμή Εκκαθάρισης * Πολλαπλασιαστή * Αριθμό συμβολαίων</p> <p>Για futures: Το ποσό διακανονισμού την T+1</p> <p><u>Για τις παλιές θέσεις:</u> (Τιμή Εκκαθάρισης - Τιμή Εκκαθάρισης προηγούμενης ημέρας) * Πολλαπλασιαστή * Αριθμό Συμβολαίων</p> <p><u>Για τις θέσεις που ανοίξαν σήμερα:</u> (Τιμή Εκκαθάρισης - Τιμή Πράξης) * Πολλαπλασιαστή * Αριθμό συμβολαίων</p> <p><i>Η τιμή του πεδίου μπορεί να πάρει και αρνητικές τιμές</i></p>
2.22	Valuation currency	EUR
2.23	Valuation timestamp	H 20:59:59 σε UTC της ημέρας που αποτιμήθηκε η θέση ISO 8601 UTC time format YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ
2.24	Valuation method	CCPV
2.25	Delta	<p>Σε TCTN Level: KENO</p> <p>Σε PSTN Level: $\frac{Option\ Fixing_T - Option\ Fixing_{T-1}}{Underlying\ Stock\ Price_T - Underlying\ Stock\ Price_{T-1}}$</p>
2.26	Collateral portfolio indicator	TRUE
2.27	Collateral portfolio code	<ol style="list-style-type: none"> Για τις αναφορές της ET.EK. με αντισυμβαλλόμενο το Εκκαθαριστικό Μέλος (Leg 1): <ul style="list-style-type: none"> ➤ Κωδικός Εκκαθαριστικού Μέλους (10-ψήφιος κωδικός στο Σύστημα Εκκαθάρισης) Για τις αναφορές του Εκκαθαριστικού Μέλους με αντισυμβαλλόμενη την ET.EK. (Leg 2): <ul style="list-style-type: none"> ➤ Κωδικός Εκκαθαριστικού Μέλους (10-ψήφιος κωδικός στο Σύστημα Εκκαθάρισης) Για τις αναφορές του Εκκαθαριστικού Μέλους με αντισυμβαλλόμενο τον Επενδυτή (Leg 3): <ul style="list-style-type: none"> ➤ Λογαριασμός Θέσης Πελάτη Για τις αναφορές του Επενδυτή με αντισυμβαλλόμενο το Εκκαθαριστικό Μέλος (Leg 4): <ul style="list-style-type: none"> ➤ Λογαριασμός Θέσης Πελάτη
2.28	Confirmation timestamp	KENO
2.29	Confirmed	KENO

2.30	Clearing Obligation	UKWN KENO
2.31	Cleared	Y
2.32	Clearing timestamp	Ημερομηνία και ώρα εκτέλεσης της συναλλαγής ή το τέλος της ημέρας για αναφορά θέσεων με ώρα 20:59:59 σε UTC ISO 8601 date in the UTC time format YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ
2.33	Central counterparty	To LEI της ET.EK. 213800IW53U9JMJ4QR40
2.34	Master Agreement type	OTHR
2.35	Other master agreement type	CCPClearingConditions
2.36	Master Agreement version	KENO
2.37	Intragroup	KENO
2.38	PTRR	Σε TCTN Level και ActionType POSC : FALSE Σε PSTN Level: KENO
2.39	Type of PTRR technique	KENO
2.40	PTRR service provider	KENO
2.41	Venue of execution	XADE, HEDE
2.42	Execution timestamp	Ημερομηνία και ώρα εκτέλεσης της συναλλαγής για αναφορά συναλλαγών ή η ημερομηνία ανοίγματος της θέσης για αναφορά θέσεων με ώρα 20:59:59 σε UTC ISO 8601 date in the UTC time format YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ
2.43	Effective date	Συμπληρώνεται με την ημερομηνία του πεδίου 2.42 Execution timestamp ISO 8601 (UTC) format YYYY-MM-DD
2.44	Expiration date	Ημερομηνία λήξης της σειράς του παραγώγου ISO 8601 (UTC) format YYYY-MM-DD
2.45	Early termination date	Ημερομηνία πρόωρης λήξης της σειράς του παραγώγου ISO 8601 (UTC) format YYYY-MM-DD
2.46	Final contractual settlement date	Ημερομηνία διακανονισμού Σε Stock Future / Option: T + 2, T = Expiration Date (πεδίο 2.44) Σε Index Future / Option και Ενεργειακά Παράγωγα: T + 1, T = Expiration Date (πεδίο 2.44) ISO 8601 (UTC) format YYYY-MM-DD
2.47	Delivery type	CASH για ATHEX Index Derivatives PHYS για ATHEX Stock Derivatives
2.48	Price	Για Futures : Σε TCTN Level: Τιμή Συναλλαγής Σε PSTN Level: Τιμή Εκκαθάρισης Για Options : KENO

2.49	Price currency	EUR
2.50-2.54	Unadjusted effective date of the price/ Package transaction price currency	KENO
2.55	Notional amount of leg 1	Για Futures : Σε TCTN Level: Τιμή Συναλλαγής * Πολλαπλασιαστική * Αριθμό Συμβολαίων Σε PSTN Level: Τιμή Εκκαθάρισης * abs(long - short) * Πολλαπλασιαστική Για Options : Σε TCTN Level: Τιμή Εξάσκησης * Πολλαπλασιαστική * Αριθμό Συμβολαίων Σε PSTN Level: Τιμή Εξάσκησης * abs(long - short) * Πολλαπλασιαστική
2.56	Notional currency 1	EUR
2.57-2.59	Effective date of the notional amount of leg 1 - Notional amount in effect on associated effective date of leg 1	KENO
2.60	Total notional quantity of leg 1	Σε TCTN Level: Μέγεθος Συμβολαίου * Αριθμό Συμβολαίων Σε PSTN Level: Μέγεθος Συμβολαίου * abs(long - short)
2.61-2.115	Effective date of the notional quantity of leg 1 - Exchange rate basis	KENO
2.116	Base product	NRGY
2.117	Sub-product	ELEC
2.118	Further sub-product	Για Baseload : BSLD Για Peakload : PKLD
2.119	Delivery point or zone	10YGR-HTSO-----Y
2.120	Interconnection Point	10YGR-HTSO-----Y
2.121	Load type	Για Baseload : BSLD Για Peakload : PKLD
2.122	Delivery interval start time	Για BSLD : 23:00:00Z Για PKLD : 07:00:00Z
2.123	Delivery interval end time	Για BSLD : 22:59:59Z Για PKLD : 18:59:59Z
2.124	Delivery start date	Η ημερομηνία έναρξης παράδοσης ανά σειρά ενεργειακού παραγωγού ISO 8601 (UTC) format YYYY-MM-DD
2.125	Delivery end date	Η ημερομηνία λήξης παράδοσης ανά σειρά ενεργειακού παραγωγού

		ISO 8601 (UTC) format YYYY-MM-DD
2.126	Duration	MNTH
2.127	Days of the week	Για Baseload : WDAY, WEND Για Peakload : WDAY
2.128	Delivery capacity	Ποσότητα σε MWH/H
2.129	Quantity Unit	Μονάδα μέτρησης MWHH
2.130	Price - time interval quantity	Τιμή ανά MWh € / MWH Σε TCTN Level: Τιμή Συναλλαγής Σε PSTN Level: Τιμή Εκκαθάρισης
2.131	Currency of the price - time interval quantity	EUR
2.132	Option type	Εάν το πεδίο 2.10 είναι OPTN: PUTO για Put CALL για Call
2.133	Option style	Εάν το πεδίο 2.10 είναι OPTN: AMER για Stock Options EURO για Index Options
2.134	Strike price	Εάν το πεδίο 2.10 είναι OPTN: Τιμή άσκησης για τα δικαιώματα
2.135-2.137	Effective date of the strike price - Strike price in effect on associated effective date	KENO
2.138	Strike price currency - currency pair	EUR
2.139	Option premium amount	Εάν το πεδίο 2.10 είναι OPTN: Για την πλευρά του πωλητή συμπληρώνεται με μηδέν Για την πλευρά του αγοραστή συμπληρώνεται: Σε TCTN Level: Τιμή Συναλλαγής * Πολλαπλασιαστική * Αριθμό Συμβολαίων Σε PSTN Level: Άθροισμα όλων των Premiums που καταβλήθηκαν
2.140	Option premium currency	EUR
2.141	Option premium payment date	Εάν το πεδίο 2.10 είναι OPTN: T+1 , T = Ημερομηνία Συναλλαγής ISO 8601 (UTC) format YYYY-MM-DD
2.142	Maturity date of the underlying	KENO
2.143-2.150	Seniority - CDS index detachment point	KENO
2.151	Action Type	Για συναλλαγές (TCTN Level): POSC Για Θέσεις (PSTN Level):

		NEWT, MODI, VALU, CORR, TERM, EROR, REVI
2.152	Event Type	<p>Για συναλλαγές (TCTN Level): N/A</p> <p>Για θέσεις (PSTN Level) και Action Type NEWT: INCP / CORP Action Type MODI: INCP / EXER Action Type TERM: CORP / ETRM / EXER</p> <p><u>Σε περίπτωση εταιρικής πράξης:</u> Κλείνει η παλιά θέση με:</p> <ul style="list-style-type: none"> Action Type TERM και Event Type CORP <p>Ανοίγει νέα θέση μετά την εφαρμογή της εταιρικής πράξης με:</p> <ul style="list-style-type: none"> Action Type NEWT και Event Type CORP <p>Κάθε επόμενη τροποποίηση της θέσης θα γίνεται με:</p> <ul style="list-style-type: none"> Action Type MODI και Event Type INCP
2.153	Event Date	<ol style="list-style-type: none"> Για Action Type NEWT σε PSTN Level και Action Type POSC σε TCTN Level: <ul style="list-style-type: none"> ➤ Ίδιο με την ημερομηνία του πεδίου 2.42 Execution timestamp Για Action Type MODI και CORR σε PSTN Level: <ul style="list-style-type: none"> ➤ Ίδιο με την ημερομηνία του πεδίου 2.42 Execution timestamp Για Action Type VALU σε PSTN Level: <ul style="list-style-type: none"> ➤ Ίδιο με την ημερομηνία του πεδίου 2.23 Valuation timestamp Για Action Type TERM σε PSTN Level: <ul style="list-style-type: none"> ➤ Ίδιο με το πεδίο 2.45 Early termination date Για Action Type EROR και REVI σε PSTN Level: <ul style="list-style-type: none"> ➤ Ίδιο με την ημερομηνία του πεδίου 1.1 Reporting timestamp
2.154	Level	<p>TCTN για αναφορά Συναλλαγής PSTN για αναφορά Θέσης</p>

*Σε **PSTN Level** για αναφορά μηδενικής θέσης το πεδίο **Direction** συμπληρώνεται με την τιμή **SLLR** για τα **Leg1-Leg3** και **BYER** για τα **Leg2-Leg4**.

4.8. Περιγραφή Πεδίων που αφορούν το περιθώριο ασφάλισης

Στη συνέχεια παρουσιάζεται ο τρόπος που συμπληρώνει η ΕΤ.ΕΚ. τα πεδία που αφορούν την αποτίμηση του περιθωρίου ασφάλισης, τόσο για τις δικές της αναφορές όσο και για τις αναφορές που στέλνει εκ μέρους των Εκκαθαριστικών Μελών της και των Πελατών τους που την έχουν εξουσιοδοτήσει σχετικά.

Σημειώνεται ότι:

- η ΕΤ.ΕΚ. συμπληρώνει τα συγκεκριμένα πεδία συνολικά για το χαρτοφυλάκιο του αντισυμβαλλόμενου και όχι για συγκεκριμένη θέση σύμφωνα με το auth.108
- θεωρείται ότι σαν ασφάλεια έναντι της θέσης του Εκκαθαριστικού Μέλους ως προς την ΕΤ.ΕΚ., χρησιμοποιείται το σύνολο των ασφαλειών των Λογαριασμών Εκκαθάρισης του Εκκαθαριστικού Μέλους
- **Θεωρείται ότι οι Πελάτες των Εκκαθαριστικών Μελών δεν έχουν παράσχει ως ασφάλεια οτιδήποτε άλλο πέρα από ότι έχει υπολογισθεί στο σύστημα της ΕΤ.ΕΚ. ως απαιτούμενο margin για το συγκεκριμένο Λογαριασμό Θέσης. Σε αντίθετη περίπτωση θα πρέπει να καταχωρείται σε καθημερινή βάση και το**

αργότερο έως τις 10:00 π.μ. της επόμενης εργάσιμης ημέρας, 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*	Πεδίο	Τρόπος συμπλήρωσης
3.1	Reporting timestamp	Ημερομηνία και ώρα κατά την οποία δημιουργείται το αρχείο αναφοράς ISO 8601 UTC time format YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ
3.2	Report submitting entity ID	ET.EK. LEI 213800IW53U9JMJ4QR40
3.3	Entity responsible for reporting	KENO
3.4	Counterparty 1 (Reporting counterparty)	Leg1: LEI ET.EK. Leg2: LEI Εκκαθαριστικού Μέλους Leg3: LEI Εκκαθαριστικού Μέλους Leg4: LEI Πελάτη Εκκαθαριστικού Μέλους, σε περίπτωση Νομικού προσώπου
3.5	Counterparty 2 identifier type	Εάν ο Counterparty 2 είναι Legal Entity: TRUE Εάν ο Counterparty 2 είναι Natural Person: FALSE
3.6	Counterparty 2	Εάν ο Counterparty 2 είναι Legal Entity: LEI Εάν ο Counterparty 2 είναι Natural Person: LEI Εκκαθαριστικού Μέλους + Λογαριασμός Θέσης
3.7	Collateral timestamp	Ημερομηνία Εκκαθάρισης Συναλλαγών και ώρα 20:59:59 σε UTC ISO 8601 (UTC) time format YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ
3.8	Collateral portfolio indicator	TRUE
3.9	Collateral portfolio code	<ol style="list-style-type: none"> Για τις αναφορές της ET.EK. με αντισυμβαλλόμενο το Εκκαθαριστικό Μέλος (Leg 1): <ul style="list-style-type: none"> ➤ Κωδικός Εκκαθαριστικού Μέλους (10-ψήφιος κωδικός στο Σύστημα Εκκαθάρισης) Για τις αναφορές του Εκκαθαριστικού Μέλους με αντισυμβαλλόμενη την ET.EK. (Leg 2): <ul style="list-style-type: none"> ➤ Κωδικός Εκκαθαριστικού Μέλους (10-ψήφιος κωδικός στο Σύστημα Εκκαθάρισης) Για τις αναφορές του Εκκαθαριστικού Μέλους με αντισυμβαλλόμενο τον Επενδυτή (Leg 3): <ul style="list-style-type: none"> ➤ Λογαριασμός Θέσης Πελάτη Για τις αναφορές του Επενδυτή με αντισυμβαλλόμενο το Εκκαθαριστικό Μέλος (Leg 4): <ul style="list-style-type: none"> ➤ Λογαριασμός Θέσης Πελάτη
3.10	UTI	KENO
3.11	Collateralisation category	Leg1, 3: OWP2

		<p><i>Ο counterparty 2 αναρτά initial margin και συχνά αναρτά variation margin και ο reporting counterparty συχνά αναρτά μόνο variation margin</i></p> <p>Leg2, 4: OWP1</p> <p><i>Ο reporting counterparty αναρτά initial margin και συχνά αναρτά variation margin και ο counterparty 2 συχνά αναρτά μόνο variation margin</i></p>
3.12	Initial margin posted by the counterparty 1 (pre-haircut):	<ol style="list-style-type: none"> 1. Για τις αναφορές της ΕΤ.ΕΚ. με αντισυμβαλλόμενο το Εκκαθαριστικό Μέλος (Leg 1): <ul style="list-style-type: none"> ➤ KENO 2. Για τις αναφορές του Εκκαθαριστικού Μέλους με αντισυμβαλλόμενη την ΕΤ.ΕΚ. (Leg 2): <ul style="list-style-type: none"> ➤ Άθροισμα των Περιθωρίων Ασφαλείας (Margin) όλων των Λογαριασμών Εκκαθάρισης 3. Για τις αναφορές του Εκκαθαριστικού Μέλους με αντισυμβαλλόμενο τον Επενδυτή (Leg 3): <ul style="list-style-type: none"> ➤ KENO 4. Για τις αναφορές του Επενδυτή με αντισυμβαλλόμενο το Εκκαθαριστικό Μέλος (Leg 4): <ul style="list-style-type: none"> ➤ Υπολογισμένο margin για τον Λογαριασμό Θέσης (ή η τιμή που έχει δηλώσει το μέλος μέσω αρχείου)
3.13	Initial margin posted by the counterparty 1 (post-haircut)	Ίδιο με το πεδίο 3.12
3.14	Currency of the initial margin posted	<p>Για Leg1, Leg3: KENO</p> <p>Για Leg2, Leg4: EUR</p>
3.15	Variation margin posted by the counterparty 1 (pre-haircut)	<ol style="list-style-type: none"> 1. Για τις αναφορές της ΕΤ.ΕΚ. με αντισυμβαλλόμενο το Εκκαθαριστικό Μέλος (Leg 1): <ol style="list-style-type: none"> i. KENO "0" (μηδέν) αν το Εκκαθαριστικό Μέλος είναι χρεωστικό ii. Το συνολικό ποσό διακανονισμού αν το Εκκαθαριστικό Μέλος είναι πιστωτικό τη συγκεκριμένη ημέρα 2. Για τις αναφορές του Εκκαθαριστικού Μέλους με αντισυμβαλλόμενη την ΕΤ.ΕΚ. (Leg 2): <ol style="list-style-type: none"> i. KENO "0" (μηδέν) αν το Εκκαθαριστικό Μέλος είναι πιστωτικό ii. Το συνολικό ποσό διακανονισμού αν το Εκκαθαριστικό Μέλος είναι χρεωστικό τη συγκεκριμένη ημέρα 3. Για τις αναφορές του Εκκαθαριστικού Μέλους με αντισυμβαλλόμενο τον Επενδυτή (Leg 3): <ol style="list-style-type: none"> i. KENO "0" (μηδέν) αν ο Επενδυτής είναι χρεωστικός ii. Το ποσό διακανονισμού του Λογαριασμού Θέσης αν ο συγκεκριμένος Επενδυτής είναι πιστωτικός τη συγκεκριμένη ημέρα 4. Για τις αναφορές του Επενδυτή με αντισυμβαλλόμενο το Εκκαθαριστικό Μέλος (Leg 4): <ol style="list-style-type: none"> i. KENO "0" (μηδέν) αν ο Επενδυτής είναι πιστωτικός

		<p>ii. Το συνολικό ποσό διακανονισμού του Λογαριασμού Θέσης αν ο Επενδυτής είναι χρεωστικός τη συγκεκριμένη ημέρα</p> <p><i>Το ποσό του διακανονισμού αφορά μόνο τα παράγωγα προϊόντα και όχι τα προϊόντα δανεισμού τίτλων του Χ.Α.</i></p>
3.16	Variation margin posted by the counterparty 1 (post-haircut)	Ίδιο με το πεδίο 3.15
3.17	Currency of the variation margins posted	EUR εάν συμπληρωθούν τα πεδία 3.15, 3.16 KENO εάν συμπληρωθούν τα πεδία 3.23, 3.24
3.18	Excess collateral posted by the counterparty 1	<ol style="list-style-type: none"> Για τις αναφορές της ΕΤ.ΕΚ. με αντισυμβαλλόμενο το Εκκαθαριστικό Μέλος (Leg 1): <ul style="list-style-type: none"> ➤ KENO Για τις αναφορές του Εκκαθαριστικού Μέλους με αντισυμβαλλόμενη την ΕΤ.ΕΚ. (Leg 2): <ul style="list-style-type: none"> ➤ Άθροισμα των Ασφαλειών (collateral) όλων των Λογαριασμών Εκκαθάρισης μείον το άθροισμα των υπολογιζόμενων περιθωρίων ασφάλισης για όλους τους Λογαριασμούς Εκκαθάρισης Για τις αναφορές του Εκκαθαριστικού Μέλους με αντισυμβαλλόμενο τον Επενδυτή (Leg 3): <ul style="list-style-type: none"> ➤ KENO Για τις αναφορές του Επενδυτή με αντισυμβαλλόμενο το Εκκαθαριστικό Μέλος (Leg 4): <ul style="list-style-type: none"> ➤ Πλεονάζουσες Ασφάλειες που έχει δηλώσει το Εκκαθαριστικό Μέλος μέσω του αρχείου για το Λογαριασμό Θέσης του Επενδυτή, ή μηδέν αν δεν έχουν δηλωθεί
3.19	Currency of the excess collateral posted	EUR εάν συμπληρωθεί το πεδίο 3.18 αλλιώς KENO
3.20	Initial margin collected by the counterparty 1 (pre-haircut)	<ol style="list-style-type: none"> Για τις αναφορές της ΕΤ.ΕΚ. με αντισυμβαλλόμενο το Εκκαθαριστικό Μέλος (Leg 1): <ul style="list-style-type: none"> ➤ Άθροισμα των Περιθωρίων Ασφάλειας (Margin) όλων των Λογαριασμών Εκκαθάρισης Για τις αναφορές του Εκκαθαριστικού Μέλους με αντισυμβαλλόμενη την ΕΤ.ΕΚ. (Leg 2): <ul style="list-style-type: none"> ➤ KENO Για τις αναφορές του Εκκαθαριστικού Μέλους με αντισυμβαλλόμενο τον Επενδυτή (Leg 3): <ul style="list-style-type: none"> ➤ Υπολογισμένο margin για τον Λογαριασμό Θέσης (ή η τιμή που έχει δηλώσει το μέλος μέσω αρχείου) Για τις αναφορές του Επενδυτή με αντισυμβαλλόμενο το Εκκαθαριστικό Μέλος (Leg 4): <ul style="list-style-type: none"> ➤ KENO
3.21	Initial margin collected by the counterparty 1 (post-haircut)	Ίδιο με το πεδίο 3.20
3.22	Currency of initial margin collected	Για Leg1, Leg3: EUR Για Leg2, Leg4: KENO
3.23	Variation margin collected by the	1. Για τις αναφορές της ΕΤ.ΕΚ. με αντισυμβαλλόμενο το Εκκαθαριστικό Μέλος (Leg 1):

	counterparty 1 (pre-haircut)	<ul style="list-style-type: none"> i. ΚΕΝΟ "0" (μηδέν) αν το Εκκαθαριστικό Μέλος είναι πιστωτικό ii. Το συνολικό ποσό διακανονισμού αν το Εκκαθαριστικό Μέλος είναι χρεωστικό τη συγκεκριμένη ημέρα <p>2. Για τις αναφορές του Εκκαθαριστικού Μέλους με αντισυμβαλλόμενη την ΕΤ.ΕΚ. (Leg 2):</p> <ul style="list-style-type: none"> i. ΚΕΝΟ "0" (μηδέν) αν το Εκκαθαριστικό Μέλος είναι χρεωστικό ii. Το συνολικό ποσό διακανονισμού αν το Εκκαθαριστικό Μέλος είναι πιστωτικό τη συγκεκριμένη ημέρα <p>4. Για τις αναφορές του Εκκαθαριστικού Μέλους με αντισυμβαλλόμενο τον Επενδυτή (Leg 3):</p> <ul style="list-style-type: none"> i. ΚΕΝΟ "0" (μηδέν) αν ο Επενδυτής είναι πιστωτικός ii. Το ποσό διακανονισμού του Λογαριασμού Θέσης αν ο συγκεκριμένος Επενδυτής είναι χρεωστικός τη συγκεκριμένη ημέρα <p>5. Για τις αναφορές του Επενδυτή με αντισυμβαλλόμενο το Εκκαθαριστικό Μέλος (Leg 4):</p> <ul style="list-style-type: none"> i. ΚΕΝΟ "0" (μηδέν) αν ο Επενδυτής είναι χρεωστικός ii. Το συνολικό ποσό διακανονισμού του Λογαριασμού Θέσης αν ο Επενδυτής είναι πιστωτικός τη συγκεκριμένη ημέρα <p><i>Το ποσό του διακανονισμού αφορά μόνο τα παράγωγα προϊόντα και όχι τα προϊόντα δανεισμού τίτλων του Χ.Α.</i></p>
3.24	Variation margin collected by the counterparty 1 (post-haircut):	Ίδιο με το πεδίο 3.23
3.25	Currency of variation margin collected	EUR εάν συμπληρωθούν τα πεδία 3.23, 3.24 ΚΕΝΟ εάν συμπληρωθούν τα πεδία 3.15, 3.16
3.26	Excess collateral collected by the counterparty 1	<p>1. Για τις αναφορές της ΕΤ.ΕΚ. με αντισυμβαλλόμενο το Εκκαθαριστικό Μέλος (Leg 1):</p> <ul style="list-style-type: none"> ➤ Άθροισμα των Ασφαλειών (collateral) όλων των Λογαριασμών Εκκαθάρισης μείον το άθροισμα των υπολογιζόμενων περιθωρίων ασφάλισης για όλους τους Λογαριασμούς Εκκαθάρισης <p>2. Για τις αναφορές του Εκκαθαριστικού Μέλους με αντισυμβαλλόμενη την ΕΤ.ΕΚ. (Leg 2):</p> <ul style="list-style-type: none"> ➤ ΚΕΝΟ <p>3. Για τις αναφορές του Εκκαθαριστικού Μέλους με αντισυμβαλλόμενο τον Επενδυτή (Leg 3):</p> <ul style="list-style-type: none"> ➤ Πλεονάζουσες Ασφάλειες που έχει δηλώσει το Εκκαθαριστικό Μέλος μέσω του αρχείου για το Λογαριασμό Θέσης του Επενδυτή, ή μηδέν αν δεν έχουν δηλωθεί <p>4. Για τις αναφορές του Επενδυτή με αντισυμβαλλόμενο το Εκκαθαριστικό Μέλος (Leg 4):</p> <ul style="list-style-type: none"> ➤ ΚΕΝΟ
3.27	Currency of excess collateral collected	EUR εάν συμπληρωθεί το πεδίο 3.26 αλλιώς ΚΕΝΟ
3.28	Action type	MARU

		Για νέες αναφορές περιθωρίων ασφάλισης καθώς και για τροποποιήσεις των υφιστάμενων CORR Για διορθώσεις υφιστάμενων αναφορών περιθωρίου ασφάλισης
3.29	Event date	Ημερομηνία Εκκαθάρισης Συναλλαγών ISO 8601 (UTC) format YYYY-MM-DD

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

Σε περίπτωση που το Εκκαθαριστικό Μέλος επιλέξει να αναθέσει στην ΕΤ.ΕΚ. την αναφορά των συναλλαγών του, θα πρέπει εκτός από την αίτηση/σύμβαση (βλέπε παράγραφο 8) που θα πρέπει να συμπληρώσει, να ενημερώσει την ΕΤ.ΕΚ. για τα παρακάτω στοιχεία των Πελατών του, συμπεριλαμβανομένων και των Ίδιων Λογαριασμών Θέσης του Εκκαθαριστικού Μέλους:

- Λογαριασμός Θέσης (Position Account) του Πελάτη
- Αν ο Πελάτης είναι Φυσικό ή Νομικό πρόσωπο
- LEI που αντιστοιχεί στον Πελάτη (Νομικό πρόσωπο)
- Τη χώρα προέλευσης του Πελάτη

Σημειώνεται ότι στις αναφορές που θα αποστέλλονται για τα Εκκαθαριστικά Μέλη θα χρησιμοποιείται ο κωδικός LEI των Πελατών τους με την προϋπόθεση ότι έχει δηλωθεί. Τα Εκκαθαριστικά Μέλη/Πελάτες της υπηρεσίας, θα πρέπει να **δηλώνουν** ~~έσθ~~ μόνο τα **Νομικά** Πρόσωπα ~~έσθ και τα Φυσικά Πρόσωπα~~, μέσω του Supplementary Trade & Position Data File.

Το Εκκαθαριστικό Μέλος είτε αιτηθεί να αναφέρονται οι συναλλαγές εκ μέρους κάποιων Πελατών του είτε όχι, θα πρέπει **υποχρεωτικά** να ενημερώσει την ΕΤ.ΕΚ. και για τα παρακάτω επιπλέον πεδία για τους Πελάτες αυτούς:

- Χρηματοοικονομικός ή μη χαρακτήρας του Πελάτη (πίνακας 1 - πεδίο 5 & 11 του ΕΕ 2022/1860)
- Εταιρικός τομέας Πελάτη (πίνακας 1 - πεδίο 6 & 12 του ΕΕ 2022/1860)
- Κατώφλι εκκαθάρισης (πίνακας 1 - πεδίο 7 & 13 του ΕΕ 2022/1860)
- Αν οι συναλλαγές είναι άμεσα συνδεδεμένες με εμπορική ή χρηματοοικονομική δραστηριότητα του Πελάτη (πίνακας 1 - πεδίο 20 του ΕΕ 2022/1860). Αφορά μόνο τα Νομικά πρόσωπα που είναι Μη - Χρηματοοικονομικοί Αντισυμβαλλόμενοι

Για τις περιπτώσεις που το Εκκαθαριστικό Μέλος επιθυμεί να προσθέσει διαφορετικό ποσό περιθωρίου ασφάλισης για Επενδυτή/Λογαριασμό Θέσης σε σύγκριση με το

υπολογιζόμενο περιθώριο ασφάλισης της ET.EK. ή έχει πλεονάζουσες εγγυήσεις, τότε θα μπορεί να ανεβάσει αρχείο στην εφαρμογή AMP-EMIR TR με τα στοιχεία αυτά, προκειμένου να ενημερωθούν σωστά τα πεδία της παραγράφου 0 για τις αναφορές του Πελάτη. Η καταχώρηση αυτή θα πρέπει να γίνεται την επόμενη εργάσιμη της ημερομηνίας που έγινε η συναλλαγή και πριν τις 10:00 π.μ.

Αν δεν έχει καταχωρηθεί σχετικό αρχείο θα χρησιμοποιείται το υπολογιζόμενο από την ET.EK. 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 ET.EK. (ETD Supplementary Trade & Position Data File)

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

A/A Πεδίου	Πεδίο	Περιγραφή
1	Action	A: Add, Προσθήκη νέου Πελάτη U: Update, Αλλαγή στοιχείων Πελάτη
2	Clearing Member DSS Code	Ο 10-ψήφιος Κωδικός του Εκκαθαριστικού Μέλους στο Σύστημα Εκκαθάρισης
3	Position Account Reference Code	Ο Λογαριασμός Θέσης (Position Account Reference Code) του Πελάτη ή του ίδιου του Εκκαθαριστικού Μέλους αν πρόκειται για Ίδιο Λογαριασμό
4	Legal Entity or Natural Person	L: Για Νομικά πρόσωπα N: Για Φυσικά πρόσωπα
5	Client LEI	Το LEI του δικαιούχου του Λογαριασμού Θέσης, αν ο δικαιούχος είναι Νομικό πρόσωπο, αλλιώς ΚΕΝΟ
6	Reporting Leg 4	Y: Αν η ET.EK. εξουσιοδοτείται να αναφέρει τις συναλλαγές εκ μέρους του Πελάτη N: Αλλιώς Για Φυσικά Πρόσωπα συμπληρώνεται υποχρεωτικά με « N »
7	Nature of Activity	Αφορά το πεδίο 5 & 11 του ΕΕ 2022/1860 F: Χρηματοοικονομικός Αντισυμβαλλόμενος N: Μη Χρηματοοικονομικός Αντισυμβαλλόμενος C: Κεντρικός Αντισυμβαλλόμενος O: Άλλο
8	Corporate Sector	Αφορά το πεδίο 6 & 12 του ΕΕ 2022/1860 Στην περίπτωση που το πεδίο 7 έχει συμπληρωθεί με F: « INVF » – Επιχείρηση επενδύσεων που έχει άδεια λειτουργίας σύμφωνα με την οδηγία 2014/65/ΕΕ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου

Α/Α Πεδίου	Πεδίο	Περιγραφή
		<p>«CDTI» – Πιστωτικό ίδρυμα που έχει άδεια λειτουργίας σύμφωνα με την οδηγία 2013/36/ΕΕ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου</p> <p>«INUN» – Ασφαλιστική επιχείρηση ή αντασφαλιστική επιχείρηση που έχει άδεια λειτουργίας σύμφωνα με την οδηγία 2009/138/ΕΚ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου</p> <p>«UCIT» – ΟΣΕΚΑ και, κατά περίπτωση, η εταιρεία διαχείρισής του, που έχουν άδεια λειτουργίας σύμφωνα με την οδηγία 2009/ 65/ΕΚ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου (4), εκτός εάν ο εν λόγω ΟΣΕΚΑ έχει συσταθεί αποκλειστικά για την εξυπηρέτηση ενός ή περισσότερων προγραμμάτων αγοράς μετοχών από εργαζομένους</p> <p>«ORPI» – Ίδρυμα επαγγελματικών συνταξιοδοτικών παροχών (ΙΕΣΠ), όπως ορίζεται στο άρθρο 6 σημείο 1) της οδηγίας (ΕΕ) 2016/2341 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου</p> <p>«AIFD» – Οργανισμός εναλλακτικών επενδύσεων (ΟΕΕ), όπως ορίζεται στο άρθρο 4 παράγραφος 1 στοιχείο α) της οδηγίας 2011/61/ΕΕ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου (6), ο οποίος είτε είναι εγκατεστημένος στην Ένωση είτε τελεί υπό τη διαχείριση διαχειριστή οργανισμών εναλλακτικών επενδύσεων (ΔΟΕΕ) που έχει άδεια λειτουργίας ή έχει καταχωριστεί σύμφωνα με την εν λόγω οδηγία, εκτός εάν ο ΟΕΕ έχει συσταθεί αποκλειστικά για την εξυπηρέτηση ενός ή περισσότερων προγραμμάτων αγοράς μετοχών από εργαζομένους ή εκτός εάν ο εν λόγω ΟΕΕ είναι οντότητα ειδικού σκοπού τιτλοποίησης όπως αναφέρεται στο άρθρο 2 παράγραφος 3 στοιχείο ζ) της οδηγίας 2011/61/ΕΕ, και, κατά περίπτωση, ο ΔΟΕΕ του που είναι εγκατεστημένος στην Ένωση</p> <p>«CSDS» – Κεντρικό αποθετήριο τίτλων που έχει άδεια λειτουργίας σύμφωνα με τον κανονισμό (ΕΕ) αριθ. 909/2014 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου</p> <p>Στην περίπτωση που το πεδίο 7 έχει συμπληρωθεί με N:</p> <p>«A» = Γεωργία, δασοκομία και αλιεία</p> <p>«B» = Ορυχεία και λατομεία</p> <p>«C» = Μεταποίηση</p> <p>«D» = Παροχή ηλεκτρικού ρεύματος, φυσικού αερίου, ατμού και κλιματισμού</p> <p>«E» = Παροχή νερού, επεξεργασία λυμάτων, διαχείριση αποβλήτων και δραστηριότητες εξυγίανσης</p> <p>«F» = Κατασκευές</p> <p>«G» = Χονδρικό και λιανικό εμπόριο, επισκευή μηχανοκίνητων οχημάτων και μοτοσικλετών</p> <p>«H» = Μεταφορά και αποθήκευση</p> <p>«I» = Δραστηριότητες υπηρεσιών παροχής καταλύματος και υπηρεσιών εστίασης</p> <p>«J» = Ενημέρωση και επικοινωνία</p>

A/A Πεδίου	Πεδίο	Περιγραφή
		<p>«K» = Χρηματοπιστωτικές και ασφαλιστικές δραστηριότητες</p> <p>«L» = Διαχείριση ακίνητης περιουσίας</p> <p>«M» = Επαγγελματικές, επιστημονικές και τεχνικές δραστηριότητες</p> <p>«N» = Διοικητικές και υποστηρικτικές δραστηριότητες</p> <p>«O» = Δημόσια διοίκηση και άμυνα · υποχρεωτική κοινωνική ασφάλιση</p> <p>«P» = Εκπαίδευση</p> <p>«Q» = Δραστηριότητες σχετικές με την ανθρώπινη υγεία και την κοινωνική μέριμνα</p> <p>«R» = Τέχνες, διασκέδαση και ψυχαγωγία</p> <p>«S» = Άλλες δραστηριότητες παροχής υπηρεσιών</p> <p>«T» = Δραστηριότητες νοικοκυριών ως εργοδοτών· μη διαφοροποιημένες δραστηριότητες νοικοκυριών, που αφορούν την παραγωγή αγαθών - και υπηρεσιών - για ίδια χρήση</p> <p>«U» = Δραστηριότητες ετερόδικων οργανισμών και φορέων</p> <p>KENO: Για Κεντρικούς Αντισυμβαλλόμενους (C) και Άλλους Αντισυμβαλλόμενους (O)</p>
9	Linked to Commercial Activity	<p>Αφορά το πεδίο 20 του ΕΕ 2022/1860</p> <p>Στην περίπτωση που το πεδίο 7 έχει συμπληρωθεί με N:</p> <p>Y: Αν οι συναλλαγές είναι άμεσες συνδεδεμένες με εμπορική ή χρηματοοικονομική δραστηριότητα του Πελάτη</p> <p>N: Αλλιώς</p> <p>KENO: Για Χρηματοοικονομικούς Αντισυμβαλλόμενους (F), Κεντρικούς Αντισυμβαλλόμενους (C) και για Άλλους Αντισυμβαλλόμενους (O)</p>
10	Clearing Threshold	<p>Αφορά το πεδίο 7 & 13 του ΕΕ 2022/1860</p> <p>Στην περίπτωση που το πεδίο 7 έχει συμπληρωθεί με F ή N:</p> <p>Y: Αν ο υπόχρεος υπερβαίνει το κατώφλι εκκαθάρισης όπως αναφέρεται στο Άρθρο 10 παρ. 3 του Κανονισμού ΕΕ 648/2012</p> <p>N: Αλλιώς</p> <p>KENO: Για Κεντρικούς Αντισυμβαλλόμενους (C) και Άλλους Αντισυμβαλλόμενους (O)</p>
11	Country of Origin*	<p>Συμπληρώνεται υποχρεωτικά για Νομικά Πρόσωπα και για Φυσικά Πρόσωπα με τον διψήφιο λατινικό κωδικό που δηλώνει τη χώρα προέλευσης του δικαιούχου</p>

* Τα πεδία **1-6 & 11** είναι **πάντοτε υποχρεωτικά** και συμπληρώνονται σύμφωνα με τις προδιαγραφές που αναφέρονται στην στήλη «**Περιγραφή**». Τα πεδία **7-10** είναι **υποχρεωτικά KENO** για **Φυσικά Πρόσωπα**

* Για τα Φυσικά Πρόσωπα, η χώρα φορολογικής κατοικίας θα συμπληρώνεται αυτοματοποιημένα σύμφωνα με τα στοιχεία που έχουν δηλωθεί στον συνδεδεμένο Λογαριασμό Αξιολογίων του Λογαριασμού Θέσης του Πελάτη

Το παραπάνω αρχείο θα πρέπει να χρησιμοποιείται κάθε φορά που υπάρχει μεταβολή στα στοιχεία των πελατών του Εκκαθαριστικού Μέλους ώστε να παράγονται σωστά οι αναφορές. Επιπλέον, σε περίπτωση που το πεδίο «Reporting» είναι «Y» το Εκκαθαριστικό Μέλος δηλώνει ότι έχει την απαιτούμενη εξουσιοδότηση για την αναφορά των συναλλαγών του Πελάτη και παράλληλα παρέχει την αντίστοιχη εξουσιοδότηση στην ET.EK.

Σημείωση: Το Εκκαθαριστικό Μέλος θα πρέπει να καταχωρεί στην εφαρμογή της υπηρεσίας EMIR - TR το αρχείο πελατών τουλάχιστον μια εργάσιμη ημέρα πριν την πραγματοποίηση συναλλαγής. Τα αρχεία πελατών που αφορούν Position Accounts που άνοιξαν την τρέχουσα ημερομηνία στο Σύστημα Εκκαθάρισης θα πρέπει να καταχωρηθούν στην εφαρμογή AMP EMIR-TR από την επόμενη εργάσιμη ημέρα το πρωί.

Στο αρχείο μπορεί 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 Εκκαθαριστικού Μέλους στη σχετική web εφαρμογή στη διεύθυνση: <https://amp.athexgroup.gr/apex>.

5.2. Γραμμογράφηση ασφαλειών ανά Πελάτη (Λογαριασμό Θέσης) για συναλλαγές που εκκαθαρίζονται από την ET.EK. (ETD Supplementary Margin Data File)

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

A/A Πεδίου	Πεδίο	Περιγραφή
1	Action	A: Add, Προσθήκη νέου Πελάτη U: Update, Αλλαγή στοιχείων Πελάτη D: Deactivation, Απενεργοποίηση στοιχείων Πελάτη
2	Clearing Member DSS Code	Ο 10-ψήφιος κωδικός του Εκκαθαριστικού Μέλους στο Σύστημα Εκκαθάρισης
3	Position Account Reference Code	Ο Λογαριασμός Θέσης (Position Account Reference Code) του Πελάτη ή του Εκκαθαριστικού Μέλους αν πρόκειται για Ίδιο Λογαριασμό
4	Trade Date	Η ημερομηνία συναλλαγών σύμφωνα με το πρότυπο ISO 8601 (μορφή YYYY-MM-DD)
5	Initial Margin	Αριθμός με έως και πέντε (5) δεκαδικά ψηφία. Αν υπάρχει υποδιαστολή πρέπει να χρησιμοποιείται η τελεία «.»
6	Currency of the Initial Margin	Ο ISO 4217 κωδικός του νομίσματος (EUR για το Ευρώ)
7	Excess Collaterals	Αριθμός με έως και πέντε (5) δεκαδικά ψηφία. Αν υπάρχει υποδιαστολή πρέπει να χρησιμοποιείται η τελεία «.»
8	Currency of the Excess Collaterals	Ο ISO 4217 κωδικός του νομίσματος (EUR για το Ευρώ)

Σημείωση: Στο αρχείο μπορεί 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://amp.athexgroup.gr/apex>.

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

Για τα Εκκαθαριστικά Μέλη που θέλουν μέσω της υπηρεσίας της ET.EK. 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 ET.EK. Trade Repository, οι οποίες και θα τους διατεθούν από την τελευταία.

7. Γραμμογράφηση αρχείου εξουσιοδότησης με LEI πελατών για συναλλαγές εντός & εκτός ET.EK. (Delegation File)

Το βασικό στοιχείο που απαιτείται είναι το LEI του Πελάτη, ώστε να προστεθεί στη λίστα με τα LEI των Πελατών που έχουν αιτηθεί εξουσιοδότηση. Αυτό είναι απαραίτητο για τις υποβολές των αναφορών σε συναλλαγές που εκκαθαρίζονται από την ET.EK., ενώ για τις συναλλαγές εκτός ET.EK., απαιτείται ώστε να υπάρχει η δυνατότητα αποστολής αναφορών μέσω της ET.EK.

Προκειμένου να αναφερθούν στην ET.EK. τα LEIs των Πελατών αυτών, θα πρέπει να δημιουργηθεί από τα Εκκαθαριστικά Μέλη ένα αρχείο τύπου "CSV" όπου τα πεδία θα διαχωρίζονται με «;» και θα έχει την εξής γραμμογράφηση:

A/A Πεδίου	Πεδίο	Περιγραφή
1	Clearing Member DSS Code *	Ο 10-ψήφιος Κωδικός του Εκκαθαριστικού Μέλους στο Σύστημα Εκκαθάρισης
2	Client LEI	Το LEI του Πελάτη του Εκκαθαριστικού Μέλους

** Για τους Πελάτες της υπηρεσίας που είναι Μη Εκκαθαριστικά Μέλη, το πεδίο 1 «Clearing Member DSS Code» θα συμπληρώνεται με την ένδειξη «N/A»*

Σημείωση: Το Εκκαθαριστικό Μέλος θα πρέπει να καταχωρεί στην εφαρμογή της υπηρεσίας AMP EMIR - TR το αρχείο εξουσιοδότησης τουλάχιστον μια εργάσιμη ημέρα πριν την πραγματοποίηση συναλλαγής.

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

8. Αίτηση για τη συμμετοχή Εκκαθαριστικού Μέλους στην Υπηρεσία

Στον ιστότοπο της υπηρεσίας στο web site της EXAE:

[EMIR.TR | ATHEX](#)

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