

ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ

**ΚΑΝΟΝΙΣΜΟΣ ΛΕΙΤΟΥΡΓΙΑΣ
ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ ΠΑΡΑΚΟΛΟΥΘΗΣΗΣ
ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ ΕΠΙ ΤΙΤΛΩΝ
ΜΕ ΛΟΓΙΣΤΙΚΗ ΜΟΡΦΗ
(ΑΨΛΟΙ ΤΙΤΛΟΙ)**

**ΑΘΗΝΑ
Φεβρουάριος 2010**

(Η ενημέρωση του Κανονισμού έγινε τον Φεβρουάριο 2010
και περιλαμβάνει όλες τις προηγούμενες συμπληρώσεις - τροποποιήσεις
μέχρι και την τελευταία τροποποίηση τον Φεβρουάριο 2009)

ΠΕΡΙΕΧΟΜΕΝΑ

	Σελίς
1. ΓΕΝΙΚΑ	8
2. ΠΕΔΙΟ ΕΦΑΡΜΟΓΗΣ	8
3. ΦΟΡΕΙΣ ΠΟΥ ΣΥΜΜΕΤΕΧΟΥΝ ΣΤΟ ΣΥΣΤΗΜΑ	10
4. ΚΑΤΗΓΟΡΙΕΣ ΤΗΡΟΥΜΕΝΩΝ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΩΝ	12
5. ΑΡΜΟΔΙΟΤΗΤΕΣ ΚΑΙ ΕΥΘΥΝΕΣ ΤΟΥ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΤΗ ΤΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ	15
5.1 ΑΡΜΟΔΙΟΤΗΤΕΣ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΤΗ	15
5.2 ΕΥΘΥΝΕΣ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΤΗ	15
6. ΣΥΝΑΛΛΑΓΕΣ	17
6.1 ΓΕΝΙΚΑ ΠΕΡΙ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ	17
6.2 ΣΥΝΑΛΛΑΓΕΣ ΣΤΗΝ ΠΡΩΤΟΓΕΝΗ ΑΓΟΡΑ	17
6.2.1 Αρχική διάθεση τίτλων	17
6.2.2 Εξόφληση τίτλων στη λήξη και πληρωμή τοκομεριδίων	18
6.3 ΣΥΝΑΛΛΑΓΕΣ ΣΤΗ ΔΕΥΤΕΡΟΓΕΝΗ ΑΓΟΡΑ	18
6.4 ΑΠΟΚΤΗΣΗ, ΔΙΑΘΕΣΗ ΚΑΙ ΤΗΡΗΣΗ ΤΙΤΛΩΝ	19
7. ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΤΩΝ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΕΩΝ ΚΑΙ ΕΙΔΗ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ	20
7.1 ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΤΩΝ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΕΩΝ	20
7.1.1 ΟΝΟΜΑ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ	20
7.1.2 ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ	20
7.1.3 ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ	20
7.1.4 ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΣΥΜΦΩΝΙΑΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ	20
7.1.5 ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ	20
7.1.6 ΣΧΕΤΙΚΟ	20
7.1.7 ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΑΠΟΚΤΗΣΗΣ ΤΩΝ ΤΙΤΛΩΝ (στην Πρωτογενή Αγορά)	21
7.1.8 ΚΩΔΙΚΟΣ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ	21
7.1.9 ΘΕΣΗ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ	21
7.1.10 ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΚΑΙ ΩΡΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ (VALEUR) ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ	21
7.1.11 ΟΝΟΜΑ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ	22
7.1.12 ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ	22
7.1.13 ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΤΩΝ ΤΙΤΛΩΝ	22

7.1.14	ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΛΗΞΗΣ ΤΩΝ ΤΙΤΛΩΝ	22
7.1.15	ΚΩΔΙΚΟΣ ISIN ΤΩΝ ΤΙΤΛΩΝ	22
7.1.16	ΟΝΟΜΑΣΤΙΚΗ ΑΞΙΑ	22
7.1.17	ΑΞΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ	22
7.1.18	ΑΞΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ ΣΤΗΝ ΕΝΑΡΞΗ (για repos, για περιθώριο πράξης repos, για Buy/Sell Back)	22
7.1.19	ΑΞΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ ΣΤΗ ΛΗΞΗ (για repos, για περιθώριο πράξης repos, για Buy/Sell Back)	22
7.1.20	ΚΑΤΕΥΘΥΝΣΗ ΛΟΓΙΣΤΙΚΟΠΟΙΗΣΗΣ (για περιθώριο πράξης repos)	22
7.1.21	ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΚΑΙ ΩΡΑ ΛΗΞΗΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ (για προθεσμιακές πράξεις)	22
7.1.22	ΚΑΤΑΒΑΛΛΟΜΕΝΟΣ ΤΟΚΟΣ	23
7.1.23	ΚΑΤΑΒΛΗΤΕΟ ΠΟΣΟ και ΔΙΚΑΙΟΥΧΟΣ (για swap επί τίτλων)	23
7.1.24	ΔΙΚΑΙΟΥΧΟΣ	23
7.1.25	ΕΤΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ ΤΗΣ ΑΡΧΙΚΗΣ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΗΣ	23
7.1.26	ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ ΤΗΣ ΑΡΧΙΚΗΣ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΗΣ	23
7.2	ΕΙΔΗ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ ΣΤΗ ΔΕΥΤΕΡΟΓΕΝΗ ΑΓΟΡΑ ΚΑΙ ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΤΩΝ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΕΩΝ ΚΑΤΑ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗ	23
7.2.1	Αγοραπωλησία τίτλων	23
7.2.2	Μεταβίβαση τίτλων χωρίς ταμειακή κίνηση	24
7.2.3	Εσωτερική μεταβίβαση	24
7.2.4	“Repos” επί τίτλων	25
7.2.5	“Buy/Sell Back” τίτλων	26
7.2.6	Πράξη περιθωρίου στο πλαίσιο προθεσμιακής πράξης επί τίτλων	26
7.2.7	“Swap” επί τίτλων	27
7.2.8	Δανεισμός τίτλων	28
7.2.8.1	Απλό δάνειο τίτλων	28
7.2.8.2	Λήξη δανείου αόριστης διάρκειας	28
7.2.8.3	Δάνειο τίτλων έναντι ενεχύρου	29
7.2.9	Ενεχύραση τίτλων	30
7.2.9.1	Ενεχύραση τίτλων για συναλλαγές εκτός Συστήματος	30
7.2.9.2	Αντικατάσταση ή μερική αποδέσμευση ενεχύρου τίτλων	30
7.2.9.3	Ολική αποδέσμευση ενεχύρου τίτλων	31
7.2.9.4	Λήξη ενεχυρασθέντων τίτλων	32
7.2.10	Άλλες συναλλαγές	32

7.2.10.1	Ακυρώσεις ή τροποποιήσεις ειδοποιήσεων	32
7.2.10.2	Μετατροπή φυσικών τίτλων σε τίτλους με λογιστική μορφή (άυλους τίτλους)	32
7.2.10.3	Αποσύνδεση – Επανασύνδεση τοκομεριδίων ομολόγων (STRIPPING)	33
8.	ΑΠΟΣΥΝΔΕΣΗ – ΕΠΑΝΑΣΥΝΔΕΣΗ ΤΟΚΟΜΕΡΙΔΙΩΝ ΟΜΟΛΟΓΩΝ ΚΑΙ ΣΥΝΑΛΛΑΓΕΣ ΕΠΙ ΑΥΤΩΝ	34
8.1	ΕΙΣΑΓΩΓΗ	34
8.2	ΑΠΟΣΥΝΔΕΣΗ ΤΟΚΟΜΕΡΙΔΙΩΝ ΟΜΟΛΟΓΩΝ	35
8.2.1	Γενικά περί αποσύνδεσης τοκομεριδίων ομολόγων	35
8.2.1.1	Περίπτώσεις αποσύνδεσης	36
8.2.1.1.1	Αποσύνδεση τοκομεριδίου τρέχουσας τοκοφόρου περιόδου (περίπτωση (α))	43
8.2.1.1.1.1	Ομόλογο σε ευρώ σταθερού ή κυμαινομένου επιτοκίου	43
8.2.1.1.1.2	Ομόλογο «παραμετρικού» επιτοκίου	44
8.2.1.1.2	Αποσύνδεση όλων των τοκομεριδίων (περίπτωση (β))	46
8.2.1.1.2.1	Ομόλογο σε ευρώ σταθερού επιτοκίου	46
8.2.1.1.2.2	Ομόλογο σε ευρώ κυμαινομένου επιτοκίου	47
8.2.1.1.2.3	Ομόλογο «παραμετρικού» επιτοκίου	48
8.3	ΣΥΝΑΛΛΑΓΕΣ ΜΕ ΤΟΥΣ ΠΑΡΑΓΩΓΟΥΣ ΤΙΤΛΟΥΣ	50
8.3.1	Γενικά περί συναλλαγών επί παράγωγων τίτλων	50
8.3.1.1	Συναλλαγές του συμμετέχοντα φορέα επί των παράγωγων τίτλων	50
8.3.1.2	Συναλλαγές του «θυγατρικού» φορέα επί των παράγωγων τίτλων	51
8.4	ΕΠΑΝΑΣΥΝΔΕΣΗ ΤΟΚΟΜΕΡΙΔΙΩΝ ΟΜΟΛΟΓΩΝ	51
8.4.1	Επανασύνδεση τοκομεριδίου της τρέχουσας τοκοφόρου περιόδου ομολόγου σε ευρώ σταθερού ή κυμαινόμενου επιτοκίου	51
8.4.2	Επανασύνδεση όλων των τοκομεριδίων ομολόγου σε ευρώ σταθερού επιτοκίου	51
8.4.3	Γενικά περί επανασύνδεσης τοκομεριδίων ομολόγων	52
8.5	ΕΠΑΝΕΝΩΣΗ ΟΜΟΛΟΓΩΝ ΑΠΟ ΤΟ ΣΥΣΤΗΜΑ	53
8.6	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑ ΠΡΟΘΕΣΜΙΑ ΛΗΨΗΣ (cut-off time) ΤΩΝ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΕΩΝ ΓΙΑ ΑΠΟΣΥΝΔΕΣΗ – ΕΠΑΝΑΣΥΝΔΕΣΗ ΤΟΚΟΜΕΡΙΔΙΩΝ ΟΜΟΛΟΓΩΝ ΑΠΟ ΤΟ ΣΥΣΤΗΜΑ	53
8.6.1	Ειδοποιήσεις αποσύνδεσης - επανασύνδεσης	53
8.6.2	Ειδοποιήσεις ακύρωσης της αποσύνδεσης - επανασύνδεσης	53
8.7	ΤΕΛΗ ΤΩΝ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΕΩΝ ΑΠΟΣΥΝΔΕΣΗΣ – ΕΠΑΝΑΣΥΝΔΕΣΗΣ	53

ΤΟΚΟΜΕΡΙΔΙΩΝ ΟΜΟΛΟΓΩΝ

9.	ΤΡΟΠΟΙ ΜΕΤΑΔΟΣΗΣ ΤΩΝ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΕΩΝ ΠΡΟΣ ΤΟ ΣΥΣΤΗΜΑ	54
10.	ΩΡΑΡΙΟ ΛΕΙΤΟΥΡΓΙΑΣ ΤΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ	55
11.	ΕΠΕΞΕΡΓΑΣΙΑ ΤΩΝ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΕΩΝ (ΤΑΥΤΟΠΟΙΗΣΗ)	56
11.1	ΚΟΙΝΑ ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΤΩΝ ΔΙΠΛΩΝ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΕΩΝ	56
11.2	ΙΔΙΑΙΤΕΡΑ ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΑΝΑ ΤΥΠΟ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ	56
11.2.1	Αγορά / πώληση τίτλων	56
11.2.2	Repos επί τίτλων	56
11.2.3	Buy/Sell back τίτλων	56
11.2.4	Πράξεις περιθωρίου	56
11.2.5	Swap επί τίτλων	57
11.2.6	Απλό δάνειο τίτλων	57
11.2.7	Δάνειο τίτλων έναντι ενεχύρου	57
11.2.8	Ειδικές περιπτώσεις ειδοποιήσεων	57
11.3	ΣΥΝΑΛΛΑΓΕΣ ΤΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ	57
11.3.1	Συναλλαγές του Συστήματος προς διακανονισμό	57
11.3.2	Συναλλαγές του Συστήματος σε «κατάσταση αναμονής προς διακανονισμό»	58
11.3.3	Συναλλαγές του Συστήματος σε εκκρεμότητα	58
11.3.4	Συναλλαγές με μελλοντικές ημερομηνίες (και ώρες) διακανονισμού	58
11.3.5	Κριτήρια προτεραιότητας	58
12.	ΗΜΕΡΗΣΙΑ ΔΙΑΔΙΚΑΣΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ ΤΩΝ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ ΤΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ	59
12.1	ΓΕΝΙΚΑ	59
12.1.1	ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΣ ΤΩΝ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ ΤΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ ΜΕ ΤΡΕΧΟΥΣΑ ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ (VALEUR) ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ	59
12.1.2	ΤΡΟΠΟΣ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ ΤΩΝ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ	59
12.2	ΕΝΕΡΓΕΙΕΣ ΠΟΥ ΠΡΑΓΜΑΤΟΠΟΙΟΥΝΤΑΙ ΑΥΤΟΜΑΤΑ ΚΑΙ ΑΜΕΣΑ ΜΕ ΤΟ ΑΝΟΙΓΜΑ ΤΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ	60
12.3	ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΣ ΤΩΝ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ ΤΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ ΜΙΑ ΠΡΟΣ ΜΙΑ ΣΕ ΣΥΝΕΧΗ ΧΡΟΝΟ	60
12.4	ΑΛΛΟΙ ΤΡΟΠΟΙ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ ΤΩΝ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ ΤΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ	61
12.4.1	Κύκλος πολυμερούς συμφηφιστικού διακανονισμού κατά τη διάρκεια της ημέρας	62

12.4.2	Συμψηφιστικός κύκλος πολυμερούς διακανονισμού στο τέλος της ημέρας	63
12.5	ΓΕΝΙΚΟΙ ΚΑΝΟΝΕΣ ΠΟΥ ΙΣΧΥΟΥΝ ΚΑΤΑ ΤΟ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟ ΤΩΝ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ	65
12.6	ΕΝΗΜΕΡΩΣΗ ΤΩΝ ΣΥΜΜΕΤΕΧΟΝΤΩΝ ΦΟΡΕΩΝ ΓΙΑ ΤΙΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΕΣ ΚΑΙ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΥΣ ΤΩΝ	66
12.7	ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ ΓΙΑ ΤΙΣ ΟΠΟΙΕΣ ΙΣΧΥΟΥΝ ΙΔΙΑΙΤΕΡΑ ΩΡΑΡΙΑ ΛΗΨΗΣ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΕΩΝ	66
12.8	ΚΛΕΙΣΙΜΟ ΤΗΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ	66
13.	ΚΥΡΩΣΕΙΣ	67
14.	ΤΙΜΟΛΟΓΗΣΗ	68
14.1	Τέλη επί των ειδοποιήσεων	68
14.2	Προμήθειες εκ της συνδέσεως του Συστήματος με το σύστημα πληρωμών TARGET2-GR	68
14.3	Αναπροσαρμογή τελών και λοιπών επιβαρύνσεων	69
15.	ΛΗΞΗ ΤΗΣ ΣΥΜΜΕΤΟΧΗΣ ΣΤΟ ΣΥΣΤΗΜΑ	70
16.	ΑΣΦΑΛΕΙΕΣ ΥΠΕΡ ΤΟΥ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΤΗ ΤΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ	73
17.	ΤΡΟΠΟΠΟΙΗΣΗ ΤΟΥ ΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ	74
18.	ΕΦΑΡΜΟΣΤΕΟ ΔΙΚΑΙΟ - ΔΙΚΑΙΟΔΟΣΙΑ	75

ΥΠΟΔΕΙΓΜΑΤΑ

- Υπόδειγμα 1
ΣΥΜΒΑΣΗ ΠΡΟΣΧΩΡΗΣΗΣ ΣΤΟ “ΣΥΣΤΗΜΑ ΠΑΡΑΚΟΛΟΥΘΗΣΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ ΕΠΙ ΤΙΤΛΩΝ ΜΕ ΛΟΓΙΣΤΙΚΗ ΜΟΡΦΗ (ΑΨΛΟΙ ΤΙΤΛΟΙ)”
(Συνημμένα 2)
- Υπόδειγμα 2
ΔΗΛΩΣΗ ΑΝΑΛΗΨΗΣ ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΩΣ ΓΙΑ ΤΗΝ ΥΠΟ ΟΡΟΥΣ ΤΗΡΗΣΗ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΥ ΚΑΤΑΘΕΣΕΩΝ ΣΕ ΕΥΡΩ ΣΤΗΝ ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ
- Υποδείγματα 3,4,5,6,7,8,9,10
ΑΝΑΓΓΕΛΙΕΣ ΠΡΑΞΕΩΝ

ΠΑΡΑΡΤΗΜΑΤΑ

- Παράρτημα 1
ΥΠΟΛΟΓΙΣΜΟΣ ΚΩΔΙΚΩΝ ΕΛΕΓΧΟΥ
- Παράρτημα 2
ΚΩΔΙΚΟΙ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ
- Παράρτημα 3
ΟΔΗΓΙΕΣ ΓΙΑ ΤΗΝ ΑΠΟΣΤΟΛΗ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΕΩΝ ΜΕΣΩ SWIFT ΠΡΟΣ ΤΟ ΣΥΣΤΗΜΑ ΠΑΡΑΚΟΛΟΥΘΗΣΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ ΕΠΙ ΤΙΤΛΩΝ ΜΕ ΛΟΓΙΣΤΙΚΗ ΜΟΡΦΗ (ΑΨΛΩΝ ΤΙΤΛΩΝ)

ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ

ΚΑΝΟΝΙΣΜΟΣ ΛΕΙΤΟΥΡΓΙΑΣ ΤΟΥ "ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ ΠΑΡΑΚΟΛΟΥΘΗΣΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ ΕΠΙ ΤΙΤΛΩΝ ΜΕ ΛΟΓΙΣΤΙΚΗ ΜΟΡΦΗ (ΑΨΛΟΙ ΤΙΤΛΟΙ)"

1. ΓΕΝΙΚΑ

Η Τράπεζα της Ελλάδος με το Ν. 2198/94 Κεφ. Β (ΦΕΚ 43/Α/22.3.94) ορίστηκε Διαχειριστής του "Συστήματος Παρακολούθησης Συναλλαγών επί Τίτλων με Λογιστική Μορφή" (στο εξής: το «Σύστημα»). Μέσω του Συστήματος πραγματοποιείται η εκκαθάριση και ο διακανονισμός των συναλλαγών με αντικείμενο άυλους τίτλους που είναι καταχωρημένοι σε λογαριασμούς φορέων στο Σύστημα, βάσει των διατάξεων του ν. 2198/1994 (άρθρα 5 – 12). Το Σύστημα διασφαλίζει στους συμμετέχοντες ότι η **διάθεση** και η **πληρωμή** των τίτλων θα πραγματοποιούνται **ταυτόχρονα (delivery versus payment)**. Η ταυτοποίηση των συναλλαγών που εκκαθαρίζονται μέσω του Συστήματος βασίζεται στην αρχή της **διπλής ειδοποίησης** του Συστήματος από τους συμβαλλομένους. **Ο διακανονισμός των συναλλαγών γίνεται για κάθε συναλλαγή χωριστά (μία προς μία συναλλαγή) σε συνεχή χρόνο*** καθόλη τη διάρκεια της ενδοημερήσιας λειτουργίας του Συστήματος.

2. ΠΕΔΙΟ ΕΦΑΡΜΟΓΗΣ

Το Σύστημα αποτελεί το μητρώο (αρχείο) στο οποίο είναι καταχωρημένοι οι τίτλοι με λογιστική μορφή του Ελληνικού Δημοσίου καθώς και λοιπών φορέων (άρθρα 5 και 11 του Ν. 2198/94), με βάση τους όρους ειδικών συμβάσεων που συνάπτονται μεταξύ των εκδοτών και της Τράπεζας της Ελλάδος και διαχειρίζεται, με την έννοια της εκκαθάρισης και διακανονισμού, τις συναλλαγές επί των τίτλων αυτών σε επίπεδο Συστήματος. Ειδικότερα, το Σύστημα εκκαθαρίζει και διακανονίζει συναλλαγές επί των παρακάτω κατηγοριών τίτλων, οποιασδήποτε διάρκειας, που εκδίδονται με λογιστική μορφή :

A. Τίτλοι του Ελληνικού Δημοσίου

α) σε ευρώ

- i) έντοκα
- ii) ομόλογα
- iii) λοιποί τίτλοι

β) σε ξένο νόμισμα

B. Τίτλοι άλλων φορέων

Γ. Προϊόντα προθεσμιακών αγορών (futures, options κλπ).

Οι άυλοι τίτλοι (κατηγορίες i), ii) και iii)) του Ελληνικού Δημοσίου που έχουν εκδοθεί μέχρι και τις 31/12/2000 έχουν ελάχιστη ονομαστική αξία διαπραγμάτευσης (lot) το 0,01 ευρώ (ένα ευρώλεπτό) ενώ αυτοί που έχουν εκδοθεί ή εκδίδονται από 2/1/2001 και μετά, έχουν ονομαστική αξία διαπραγμάτευσης (lot) τα 1.000 ευρώ και τα πολλαπλάσια αυτής.

Οι τίτλοι που προέρχονται από αποσύνδεση τοκομεριδίων ομολόγων (stripping) έχουν ελάχιστη ονομαστική αξία διαπραγμάτευσης (lot) :

* Real Time Gross Settlement / Delivery versus Payment Model 1 (RTGS/DvP model 1)

- το 0,01 ευρώ (1 ευρωλεπτό) για τα τοκομερίδια που προέρχονται από ομόλογα γνωστού επιτοκίου,
- τη 1 μονάδα τοκομεριδίου για τα τοκομερίδια που προέρχονται από ομόλογα “παραμετρικού” επιτοκίου (βλέπε κεφάλαιο 8 : ΑΠΟΣΥΝΔΕΣΗ - ΕΠΑΝΑΣΥΝΔΕΣΗ ΤΟΚΟΜΕΡΙΔΙΩΝ ΟΜΟΛΟΓΩΝ ΚΑΙ ΣΥΝΑΛΛΑΓΕΣ ΕΠΙ ΑΥΤΩΝ).

Οι όροι που διέπουν την εισαγωγή και διαχείριση από το Σύστημα των τίτλων των κατηγοριών Β. και Γ. καθορίζονται κάθε φορά από την Τράπεζα της Ελλάδος.

Σε κάθε έκδοση τίτλων που καταχωρούνται στο Σύστημα, με συνέπεια και οι συναλλαγές επί των τίτλων της εκδόσεως αυτής να παρακολουθούνται και διακανονίζονται από το Σύστημα, δίδεται ένας κωδικός αναγνώρισης σύμφωνα με το **διεθνές σύστημα κωδικοποίησης τίτλων ISIN (International Securities Identification Number)**. Ο κωδικός αυτός συμπεριλαμβάνεται στις ειδοποιήσεις (εντολές, οδηγίες / orders, instructions) που αποστέλλουν στο Σύστημα οι υπεύθυνοι για την εκκαθάριση των σχετικών συναλλαγών συμμετέχοντες φορείς για να γίνουν οι εγγραφές στους λογαριασμούς τους.

Οι εκδόσεις τίτλων που παρακολουθούνται στο Σύστημα έχουν την πιο κάτω κωδικοποίηση :

GRANANANAYYZ

όπου τα **ANANANA** είναι 7 αλφαριθμητικοί χαρακτήρες και αποτελούν τον κωδικό έκδοσης του τίτλου, ενώ τα ψηφία **YY** και **Z** αποτελούν τους κωδικούς αριθμούς ελέγχου (Κ.Α.Ε.) των οποίων ο τρόπος υπολογισμού αναλύεται στο συνημμένο παράρτημα αρ. 1.

3. ΦΟΡΕΙΣ ΠΟΥ ΣΥΜΜΕΤΕΧΟΥΝ ΣΤΟ ΣΥΣΤΗΜΑ

3.1 Φυσικό ή νομικό πρόσωπο συμμετέχει στο Σύστημα ως μέλος/φορέας κατόπιν Πράξεως του Διοικητή της Τράπεζας της Ελλάδος. Για τους φορείς που επιλέγονται, το Σύστημα ανοίγει και τηρεί λογαριασμούς τίτλων και εξουσιοδοτείται να κινεί τους τρεχούμενους λογαριασμούς ταμειακής διαχείρισης σε ευρώ ή λογαριασμούς καταθέσεων σε ευρώ, για την ταμειακή τακτοποίηση των συναλλαγών που διενεργούν οι φορείς τόσο για λογαριασμό τους όσο και για λογαριασμό των επενδυτών - πελατών τους. Η συμμετοχή φορέως στο Σύστημα θεωρείται ως ανέκκλητη – καθόλη τη διάρκεια της συμμετοχής του φορέως στο Σύστημα – εξουσιοδότηση προς την Τράπεζα της Ελλάδος, ως Διαχειρίστρια του Συστήματος, να κινεί τους ανωτέρω λογαριασμούς για σκοπούς εκκαθάρισης και διακανονισμού των συναλλαγών επί των τίτλων που εισάγονται στο Σύστημα προς εκκαθάριση. Από την έναρξη λειτουργίας του συστήματος πληρωμών TARGET2-GR, την 19η Μαΐου 2008, ως τρεχούμενοι λογαριασμοί ταμειακής διαχείρισης νοούνται οι λογαριασμοί που τηρούν οι άμεσοι συμμετέχοντες στο σύστημα πληρωμών TARGET2, σύμφωνα με την Κατευθυντήρια Γραμμή ΕΚΤ/2007/2 σχετικά με το Διευρωπαϊκό Αυτοματοποιημένο Σύστημα Ταχείας Μεταφοράς Κεφαλαίων και Διακανονισμού σε Συνεχή Χρόνο TARGET2 και τον Κανονισμό Λειτουργίας του Συστήματος Ταχείας Μεταφοράς Κεφαλαίων και Διακανονισμού σε Συνεχή Χρόνο TARGET2-GR. Από την ίδια ημερομηνία, ο διακανονισμός του ταμειακού σκέλους των συναλλαγών, πέραν των προβλεπόμενων στον παρόντα Κανονισμό, διενεργείται σύμφωνα με τις διατάξεις του Κανονισμού Λειτουργίας του Συστήματος TARGET2-GR, όπως εκάστοτε ισχύει και τυχόν εξειδικεύεται με σχετικές εγκυκλίους ή και οδηγίες της Τράπεζας της Ελλάδος. Για τους τίτλους που κατέχουν οι συμμετέχοντες φορείς για λογαριασμό επενδυτών / πελατών τους και, εν γένει, τρίτων, τηρούν αυτοί στα βιβλία τους λογαριασμούς τίτλων για λογαριασμό των επενδυτών - πελατών τους, τηρουμένων των σχετικών διατάξεων της νομοθεσίας για το διαχωρισμό των περιουσιακών στοιχείων του φορέως από εκείνα των πελατών του, καθώς και μεταξύ των κατ' ιδίαν πελατών του. Στο Σύστημα (εκτός της Τράπεζας της Ελλάδος και του Υπουργείου Οικονομικών) μπορούν να συμμετέχουν :

- τα Πιστωτικά/Χρηματοπιστωτικά Ιδρύματα της ζώνης του Ευρώ,
- οι Επιχειρήσεις Παροχής Επενδυτικών Υπηρεσιών που έχουν λάβει άδεια λειτουργίας για την παροχή τουλάχιστον των επενδυτικών υπηρεσιών της λήψης και εκτέλεσης εντολών επί χρηματοπιστωτικών μέσων και της φύλαξης και διοικητικής διαχείρισης χρηματοπιστωτικών μέσων, εφόσον είναι εγκατεστημένες στην Ελλάδα ή δικαιούνται να παρέχουν στην Ελλάδα τις εν λόγω επενδυτικές υπηρεσίες,
- το Κεντρικό Αποθετήριο Αξιών Αθηνών Α.Ε.,
- τα Κεντρικά Αποθετήρια Τίτλων και τα Συστήματα Διακανονισμού τίτλων που λειτουργούν σε χώρες της Ευρωπαϊκής Ένωσης και έχουν γίνει αποδεκτά από το Ευρωπαϊκό Σύστημα Κεντρικών Τραπεζών για τη συμμετοχή τους στις πιστωτικές λειτουργίες του,
- Διεθνή Κεντρικά Αποθετήρια τίτλων (π.χ. EUROCLEAR, CLEARSTREAM), σύμφωνα με τους ειδικότερους όρους που καθορίζονται με ΠΔ/ΤΕ και περιγράφονται στο κείμενο των σχετικών συμβάσεων και
- άλλοι φορείς που τυχόν καθορίζονται με Πράξη του Διοικητή της Τράπεζας της Ελλάδος ή εγκρίνονται ατομικώς, εφόσον αυτοί πληρούν εχέγγυα επαρκούς οργάνωσης. Σχετικώς λαμβάνεται υπόψη αν οι φορείς αυτοί υπόκεινται σε ειδικό νομικό ή κανονιστικό καθεστώς οργάνωσης και λειτουργίας, αν υπόκεινται σε ειδική εποπτεία κλπ.

3.2 Προκειμένου να συμμετάσχει φυσικό ή νομικό πρόσωπο στο Σύστημα ως φορέας, πρέπει να υποβάλει αίτηση στην Τράπεζα της Ελλάδος, Διεύθυνση Εργασιών Δημοσίου, με την οποία να ζητεί την απόκτηση αυτής της ιδιότητας, καθώς και το άνοιγμα των παρακάτω λογαριασμών:

- α) λογαριασμών τίτλων στο Σύστημα Παρακολούθησης Συναλλαγών επί Τίτλων με Λογιστική Μορφή και
- β) τρεχούμενου λογαριασμού ταμειακής διαχείρισης σε ευρώ στο πλαίσιο λειτουργίας του συστήματος πληρωμών TARGET2 ή, προκειμένου περί προσώπων ή φορέων που δεν εμπίπτουν στην κατηγορία των Πιστωτικών / Χρηματοπιστωτικών ιδρυμάτων ως ανωτέρω, λογαριασμού καταθέσεων σε ευρώ στην Τράπεζα της Ελλάδος.

Ο υποψήφιος φορέας δύναται, αντί να ανοίξει ο ίδιος επ' ονόματί του λογαριασμό στο πλαίσιο λειτουργίας του συστήματος πληρωμών TARGET2, να δηλώσει στην Τράπεζα της Ελλάδος, ως Διαχειρίστρια του Συστήματος, γνωστοποιώντας την επωνυμία και τον Κωδικό Αναγνώρισης Τράπεζας (BIC), το πιστωτικό ίδρυμα που θα ενεργεί ως τράπεζα διακανονισμού (settlement bank) κατά την έννοια του Κανονισμού Λειτουργίας του Συστήματος Ταχείας Μεταφοράς Κεφαλαίων και Διακανονισμού σε Συνεχή Χρόνο TARGET2-GR, δηλαδή το πιστωτικό ίδρυμα στο λογαριασμό TARGET2 του οποίου θα διακανονίζεται το ταμειακό σκέλος των συναλλαγών που θα διενεργεί ο φορέας στο Σύστημα. Με την επιφύλαξη διαφορετικής πρόβλεψης στις οικείες ενότητες του παρόντος Κανονισμού, όπου στον παρόντα Κανονισμό γίνεται αναφορά σε τρεχούμενους λογαριασμούς ταμειακής διαχείρισης των φορέων θα νοείται ως αναφορά στους λογαριασμούς που τηρούν στο πλαίσιο λειτουργίας του συστήματος TARGET2 είτε οι ίδιοι οι φορείς είτε τα πιστωτικά ιδρύματα που ενεργούν ως τράπεζες διακανονισμού, κατά τα ανωτέρω αναφερόμενα.

Εφόσον η αίτηση γίνει αποδεκτή, υπογράφεται σχετική σύμβαση (υπόδειγμα αρ. 1) από το φορέα (δια του νομίμου εκπροσώπου του), με την οποία αυτός δεσμεύεται για την πιστή εφαρμογή του Κανονισμού Λειτουργίας του Συστήματος. Η συμμετοχή φορέως στο Σύστημα συνιστά ανεπιφύλακτη αποδοχή του παρόντος Κανονισμού μετά των Παραρτημάτων του. Σε κάθε συμμετέχοντα φορέα δίδεται ένας κωδικός αριθμός, ο οποίος χρησιμοποιείται για την κωδικοποίηση των λογαριασμών τίτλων που θα τηρεί στο Σύστημα. Ο κωδικός αυτός αριθμός αναφέρεται σε όλες τις ειδοποιήσεις (εντολών / οδηγιών για μεταβίβαση τίτλων ή σύσταση δικαιωμάτων επ' αυτών) που αποστέλλει ο συμμετέχων φορέας στο Σύστημα.

3.3 Με Πράξη του Διοικητή της Τράπεζας της Ελλάδος δύνανται να καθορίζονται για συμμετέχοντα φορέα ή κατηγορία συμμετεχόντων φορέων ειδικοί όροι κατάρτισης συναλλαγών που εκκαθαρίζονται από το Σύστημα και διακανονισμού των, με σκοπό τη διασφάλιση του ομαλού διακανονισμού των συναλλαγών.

4. ΚΑΤΗΓΟΡΙΕΣ ΤΗΡΟΥΜΕΝΩΝ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΩΝ

Για κάθε συμμετέχοντα φορέα, το Σύστημα τηρεί λογαριασμούς τίτλων με την πιο κάτω κωδικοποίηση :

1008NN...NNX...XZZ

όπου:

τα ψηφία **NN...NN** αποτελούν τον **Κ. Α. του συμμετέχοντα φορέα**,

τα ψηφία **X...X** αποτελούν τον **Κ. Α. του λογαριασμού τίτλων** (όπως αναλύεται στην επόμενη παράγραφο) και

τα ψηφία **ZZ** αποτελούν τον **Κ. Α. ελέγχου**, ο οποίος υπολογίζεται με όμοιο τρόπο όπως και για τους τίτλους (συνημμένο παράρτημα αρ. 1).

Για όλους τους συμμετέχοντες φορείς, το Σύστημα μπορεί να τηρήσει τους παρακάτω λογαριασμούς τίτλων :

- Κ.Α. 01 : "Λογαριασμός Ιδίου Χαρτοφυλακίου"
- Κ.Α. 03¹ : "Λογαριασμός Ιδίου Χαρτοφυλακίου για πράξεις "Repos" επί τίτλων με πελατεία κατοίκους Ελλάδος"
- Κ.Α. 04¹ : "Λογαριασμός Ιδίου Χαρτοφυλακίου για πράξεις "Repos" επί τίτλων με πελατεία κατοίκους χωρών Ευρωπαϊκής Ένωσης" (πλην Ελλάδος)
- Κ.Α. 05¹ : "Λογαριασμός Ιδίου Χαρτοφυλακίου για πράξεις "Repos" επί τίτλων με πελατεία κατοίκους τρίτων χωρών" (πλην Ευρωπαϊκής Ένωσης)
- Κ.Α. 09² : "Λογαριασμός Ιδίου Χαρτοφυλακίου προς παράδοση στην Εταιρεία Εκκαθάρισης Συναλλαγών επί Παραγώγων (Ε.Τ.Ε.Σ.Ε.Π.) μέσω Κεντρικού Αποθετηρίου Αξιών (Κ.Α.Α.)"
- Κ.Α. 100 : "Λογαριασμός Χαρτοφυλακίου Πελατείας κατοίκων Ελλάδος – Χρηματοπιστωτικός Τομέας"
- Κ.Α. 101 : "Λογαριασμός Χαρτοφυλακίου Πελατείας κατοίκων Ελλάδος – Τομέας Γενικής Κυβέρνησης"
- Κ.Α. 102 : "Λογαριασμός Χαρτοφυλακίου Πελατείας κατοίκων Ελλάδος – Τομέας Εγχώριων μη Χρηματοπιστωτικών Επιχειρήσεων"
- Κ.Α. 103 : "Λογαριασμός Χαρτοφυλακίου Πελατείας κατοίκων Ελλάδος – Τομέας Νοικοκυριών και μη Κερδοσκοπικών Ιδρυμάτων που εξυπηρετούν τα Νοικοκυριά"
- Κ.Α. 11 : "Λογαριασμός Χαρτοφυλακίου Πελατείας κατοίκων χωρών Ευρωπαϊκής Ένωσης" (πλην Ελλάδος)
- Κ.Α. 12 : "Λογαριασμός Χαρτοφυλακίου Πελατείας κατοίκων τρίτων χωρών" (πλην Ευρωπαϊκής Ένωσης)

¹ Στους λογαριασμούς αυτούς θα μεταφέρονται - με συναλλαγές "Εσωτερική μεταβίβαση" (Κ.Σ. 22) – οι τίτλοι που αποτελούν αντικείμενο πράξεων "Repos" επί τίτλων των φορέων με την πελατεία τους, για τους οποίους ο φορέας διατηρεί την κυριότητα και κατά την περίοδο που διαρκεί η πράξη "Repos".

² Στο λογαριασμό αυτό θα μεταφέρονται από το λογαριασμό τίτλων Ιδίου Χαρτοφυλακίου των φορέων -με συναλλαγές "Εσωτερική Μεταβίβαση" (Κ.Σ. 22)- οι τίτλοι που πρέπει να παραδοθούν στην Ε.Τ.Ε.Σ.Ε.Π. (μέσω Κ.Α.Α.) από λήξεις Συμβολαίων Μελλοντικής Εκπλήρωσης (Σ.Μ.Ε.) τα οποία αναφέρονται σε ομόλογα του Ελληνικού Δημοσίου και διαπραγματεύονται στο Χρηματιστήριο Παραγώγων Αθηνών. Οι μεταφορές αυτές θεωρούνται οριστικές και δεν ακυρώνονται ούτε τροποποιούνται παρά μόνο με τη σύμφωνη γνώμη του φορέα και του Κ.Α.Α. Οι τίτλοι αυτοί στη συνέχεια –με ειδοποιήσεις του φορέα και του Κ.Α.Α. – συναλλαγή "Μεταβίβαση τίτλων χωρίς ταμειακή κίνηση" (Κ.Σ. 21) – θα μεταφέρονται στο λογαριασμό Πελατείας του Κ.Α.Α. προκειμένου να γίνει η εκκαθάριση των Σ.Μ.Ε., το αποτέλεσμα της οποίας, στο μέτρο που αφορά λογαριασμούς που τηρούνται στο Σύστημα Παρακολούθησης Συναλλαγών επί Τίτλων με Λογιστική Μορφή, θα ανακοινώνεται σε αυτό για την οριστική τακτοποίηση.

- Κ.Α. 130³ : "Λογαριασμός Χαρτοφυλακίου Πελατείας για πράξεις "Repos" επί τίτλων με κατοίκους Ελλάδος – Χρηματοπιστωτικός Τομέας"
- Κ.Α. 131³ : "Λογαριασμός Χαρτοφυλακίου Πελατείας για πράξεις "Repos" επί τίτλων με κατοίκους Ελλάδος – Τομέας Γενικής Κυβέρνησης"
- Κ.Α. 132³ : "Λογαριασμός Χαρτοφυλακίου Πελατείας για πράξεις "Repos" επί τίτλων με κατοίκους Ελλάδος – Τομέας Εγχώριων μη Χρηματοπιστωτικών Επιχειρήσεων"
- Κ.Α. 133³ : "Λογαριασμός Χαρτοφυλακίου Πελατείας για πράξεις "Repos" επί τίτλων με κατοίκους Ελλάδος – Τομέας Νοικοκυριών και μη Κερδοσκοπικών Ιδρυμάτων που εξυπηρετούν τα Νοικοκυριά"
- Κ.Α. 14³ : "Λογαριασμός Χαρτοφυλακίου Πελατείας για πράξεις "Repos" επί τίτλων με κατοίκους Ευρωπαϊκής Ένωσης (πλην Ελλάδος)"
- Κ.Α. 15³ : "Λογαριασμός Χαρτοφυλακίου Πελατείας για πράξεις "Repos" επί τίτλων με κατοίκους τρίτων χωρών (πλην Ευρωπαϊκής Ένωσης)"
- Κ.Α. 0150 : "Λογαριασμός ενεχύρασης για συναλλαγές εντός Συστήματος –Ιδίου Χαρτοφυλακίου"
- Κ.Α. 10050 : "Λογαριασμός ενεχύρασης για συναλλαγές εντός Συστήματος – Χρηματοπιστωτικός Τομέας"
- Κ.Α. 10150 : "Λογαριασμός ενεχύρασης για συναλλαγές εντός Συστήματος – Τομέας Γενικής Κυβέρνησης"
- Κ.Α. 10250 : "Λογαριασμός ενεχύρασης για συναλλαγές εντός Συστήματος – Τομέας Εγχώριων μη Χρηματοπιστωτικών Επιχειρήσεων"
- Κ.Α. 10350 : "Λογαριασμός ενεχύρασης για συναλλαγές εντός Συστήματος – Τομέας Νοικοκυριών και μη Κερδοσκοπικών Ιδρυμάτων που εξυπηρετούν τα Νοικοκυριά"
- Κ.Α. 1150 : "Λογαριασμός ενεχύρασης για συναλλαγές εντός Συστήματος – Εξωτερικός Τομέας / Υποτομέας Λοιπών Χωρών Ε.Ε."
- Κ.Α. 1250 : "Λογαριασμός ενεχύρασης για συναλλαγές εντός Συστήματος – Εξωτερικός Τομέας / Υποτομέας Λοιπών Χωρών εκτός Ε.Ε."
- Κ.Α. 0151 : "Λογαριασμός ενεχύρασης για συναλλαγές εκτός Συστήματος – Ιδίου Χαρτοφυλακίου"
- Κ.Α. 10051: "Λογαριασμός ενεχύρασης για συναλλαγές εκτός Συστήματος – Χρηματοπιστωτικός Τομέας"
- Κ.Α. 10151 : "Λογαριασμός ενεχύρασης για συναλλαγές εκτός Συστήματος – Τομέας Γενικής Κυβέρνησης"
- Κ.Α. 10251 : "Λογαριασμός ενεχύρασης για συναλλαγές εκτός Συστήματος – Τομέας Εγχώριων μη Χρηματοπιστωτικών Επιχειρήσεων"
- Κ.Α. 10351 : "Λογαριασμός ενεχύρασης για συναλλαγές εκτός Συστήματος – Τομέας Νοικοκυριών και μη Κερδοσκοπικών Ιδρυμάτων που εξυπηρετούν τα Νοικοκυριά"
- Κ.Α. 1151 : "Λογαριασμός ενεχύρασης για συναλλαγές εκτός Συστήματος – Εξωτερικός Τομέας / Υποτομέας Λοιπών Χωρών Ε.Ε."
- Κ.Α. 1251 : "Λογαριασμός ενεχύρασης για συναλλαγές εκτός Συστήματος – Εξωτερικός Τομέας / Υποτομέας Λοιπών Χωρών εκτός Ε.Ε."

³ Στους λογαριασμούς αυτούς θα μεταφέρονται – με "Εσωτερική μεταβίβαση" (Κ.Σ. 22) – οι τίτλοι που αποτελούν αντικείμενο πράξεων "Repos" επί τίτλων των φορέων με την πελατεία τους, εφόσον συμφωνείται η μεταβίβαση της κυριότητας κατά την περίοδο που διαρκεί η πράξη "Repos".

Με ειδική έγκριση του Διαχειριστή του Συστήματος μπορούν να ανοιχτούν και άλλοι λογαριασμοί τίτλων για την εξυπηρέτηση των συναλλαγών των συμμετεχόντων φορέων και της πελατείας τους.

Για την ταμειακή τακτοποίηση των συναλλαγών του Συστήματος χρησιμοποιούνται:

- α) για τα Πιστωτικά/Χρηματοπιστωτικά Ιδρύματα, οι τηρούμενοι στο πλαίσιο λειτουργίας του συστήματος πληρωμών TARGET2 λογαριασμοί ταμειακής διαχείρισης σε ευρώ και
- β) για τους λοιπούς συμμετέχοντες φορείς, άτοκοι λογαριασμοί καταθέσεων σε ευρώ που θα τηρούνται στην Τράπεζα της Ελλάδος και δεν θα επιτρέπεται να παρουσιάζουν χρεωστικά υπόλοιπα. Στην περίπτωση αυτή, συνάπτεται ειδική σύμβαση με την υπογραφή από τον φορέα «Δήλωσης ανάληψης υποχρεώσεως για την υπό όρους τήρηση λογαριασμού καταθέσεων σε ευρώ στην Τράπεζα της Ελλάδος» (συνημμένο υπόδειγμα αρ. 2) που καθορίζει τους όρους που θα διέπουν την κίνηση των λογαριασμών αυτών.

Οι λογιστικές εγγραφές στους λογαριασμούς τίτλων γίνονται στις ονομαστικές αξίες των τίτλων και κατά κωδικό έκδοσης τίτλων, ενώ στους τρεχούμενους λογαριασμούς ταμειακής διαχείρισης σε ευρώ ή λογαριασμούς καταθέσεων σε ευρώ, γίνονται στην αξία διακανονισμού σε ευρώ που συμφωνήθηκε από τους συμβαλλόμενους και γνωστοποιήθηκε στο Σύστημα με τις ειδοποιήσεις τους (βλ. παρακάτω, κεφάλαιο 6 : ΣΥΝΑΛΛΑΓΕΣ).

5. ΑΡΜΟΔΙΟΤΗΤΕΣ ΚΑΙ ΕΥΘΥΝΕΣ ΤΟΥ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΤΗ ΤΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

5.1 ΑΡΜΟΔΙΟΤΗΤΕΣ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΤΗ

Η Τράπεζα της Ελλάδος, ως Διαχειριστής του Συστήματος έχει τις παρακάτω κύριες αρμοδιότητες :

- α) την εξέταση αιτήσεων για τη συμμετοχή στο Σύστημα και για το άνοιγμα των σχετικών λογαριασμών,
- β) την παρακολούθηση των μεταβολών που επέρχονται στα στοιχεία και στους λογαριασμούς των συμμετεχόντων φορέων από τη λειτουργία του Συστήματος,
- γ) τη γενική εποπτεία του Συστήματος που συνίσταται ιδίως :
 - στην εξασφάλιση της απρόσκοπτης λειτουργίας του,
 - στην παρακολούθηση και ομαλή διεκπεραίωση (εκκαθάριση και διακανονισμό) των συναλλαγών που καταχωρούνται στο Σύστημα προς εκκαθάριση,
 - στην πληροφόρηση των συμμετεχόντων φορέων για τις (καταχωρημένες στο Σύστημα προς εκκαθάριση) συναλλαγές της ημέρας, καθώς και για ορισμένες (από τις καταχωρημένες στο Σύστημα προς εκκαθάριση) συναλλαγές των επόμενων ημερών,
 - στον ταχύτερο δυνατό διακανονισμό των (καταχωρημένων στο Σύστημα προς εκκαθάριση) συναλλαγών, που βρίσκονται σε εκκρεμότητα κατά τη διάρκεια της ημέρας,
- δ) τον καθορισμό της τιμολόγησης των παρεχομένων υπηρεσιών,
- ε) την αποστολή συγκεντρωτικών στατιστικών στοιχείων στους συμμετέχοντες φορείς και
- στ) τη σύνταξη μελετών για τη βελτίωση της λειτουργίας του Συστήματος.

Επιφυλασσομένων των διατάξεων του ν. 2198/1994 και του παρόντος Κανονισμού που προβλέπουν την επιβολή κυρώσεων από την Τράπεζα της Ελλάδος, η Τράπεζα της Ελλάδος, εφόσον διαπιστώσει ότι φορείς του Συστήματος, στο πλαίσιο λειτουργίας τους σε σχέση με συναλλαγές επί τίτλων που είναι καταχωρημένοι στο Σύστημα και, ιδίως, σε σχέση με τις υποχρεώσεις τους που απορρέουν από τον παρόντα Κανονισμό, παραβιάζουν διατάξεις του Κώδικα Δεοντολογίας των Ε.Π.Ε.Υ. ή άλλες διατάξεις που αφορούν την εποπτεία και τους κανόνες οργάνωσης και λειτουργίας που τους διέπουν, λαμβάνει η ίδια τα δέοντα μέτρα ή απευθύνεται στην αρμόδια εποπτική αρχή, γνωστοποιώντας της την παράβαση, για να λάβει εκείνη τα δέοντα μέτρα.

5.2 ΕΥΘΥΝΕΣ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΤΗ

Η Τράπεζα της Ελλάδος ενεργώντας ως Διαχειριστής του Συστήματος, δεν υπέχει ευθύνη, συμβατική ή εξωσυμβατική, παρά μόνο για δόλο και βαρεία αμέλεια.

Εξάλλου δεν υπέχει ευθύνη για τυχόν ζημίες που μπορεί να υποστούν οι φορείς λόγω γεγονότων που προκαλούνται από ανωτέρα βία, όπως π.χ. πόλεμο, απεργίες (συμπεριλαμβανομένων και εκείνων του προσωπικού της), ανταπεργίες, κινήματα, στάσεις, κοινωνικές αναταραχές, επιδημίες, έλλειψη ηλεκτρικής ενέργειας, καυσίμων, πρώτων υλών, ή άλλες ελλείψεις, επιτάξεις, πυρκαγιές, πλημμύρες, αδυναμία μεταφορών, μη λειτουργία και, εν γένει, βλάβη τηλεπικοινωνιακών συστημάτων, κατάρρευση συστημάτων ηλεκτρονικών

υπολογιστών (computer breakdown), άσκηση κυριαρχικής εξουσίας ή πράξεις των δημοσίων αρχών ή άλλες αιτίες ανεξάρτητες από τη θέλησή της.

Επίσης, δεν αναλαμβάνει ευθύνη για τυχόν αδυναμία των υπολογιστών της, από οποιαδήποτε αιτία, ακόμη και προσωρινή, ή για την περίπτωση απώλειας των δεδομένων που περιέχουν οι υπολογιστές της ή για οποιαδήποτε δολία χρήση των δεδομένων από τρίτους. Η Τράπεζα της Ελλάδος υποχρεούται πάντως να λαμβάνει όλα τα κατάλληλα μέτρα για την αποφυγή αδυναμιών στο σύστημα των υπολογιστών της και να επιδιώκει την επισκευή τυχόν βλαβών ή τη διόρθωση τυχόν δυσλειτουργιών το συντομότερο δυνατόν, θα λαμβάνει δε τουλάχιστον ημερησίως αντίγραφα ασφαλείας (back up) των δεδομένων του Συστήματος.

6. ΣΥΝΑΛΛΑΓΕΣ

6.1 ΓΕΝΙΚΑ ΠΕΡΙ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ

Το Σύστημα λειτουργεί τις εργάσιμες ημέρες του Ελληνικού Τραπεζικού Συστήματος. Επιπλέον το Σύστημα λειτουργεί και κατά τις ημέρες λειτουργίας του Συστήματος TARGET2 που δεν συμπίπτουν με τις εργάσιμες ημέρες του Ελληνικού Τραπεζικού Συστήματος αλλά και τις εργάσιμες ημέρες λειτουργίας του Ελληνικού Τραπεζικού Συστήματος και αργίας του Συστήματος TARGET2. Στις περιπτώσεις αυτές γίνονται δεκτές προς εκκαθάριση μόνον συναλλαγές που καθορίζονται με Πράξεις του Διοικητή της Τράπεζας της Ελλάδος. Το Σύστημα δέχεται και επεξεργάζεται ειδοποιήσεις για συναλλαγές επί τίτλων (εντολές/οδηγίες για μεταβίβαση τίτλων ή σύσταση βάρους, στο πλαίσιο εκκαθάρισης και διακανονισμού των συναλλαγών που καταχωρούνται σ' αυτό) οι οποίες έχουν ημερομηνία διακανονισμού (valeur) της συναλλαγής τρέχουσα ή μελλοντική, μέχρι και 365 ημέρες μετά την ημέρα παραλαβής της ειδοποίησης από το Σύστημα. Δεν γίνονται δεκτές ειδοποιήσεις για συναλλαγές επί τίτλων με ημερομηνία διακανονισμού (valeur) της συναλλαγής προγενέστερη της τρέχουσας ημερομηνίας (αναδρομική valeur), καθώς και με ημερομηνία ίδια ή μεταγενέστερη της ημερομηνίας λήξης των τίτλων που αποτελούν αντικείμενο της συναλλαγής. Ως προς συναλλαγές με αντικείμενο την ενεχύραση τίτλων ή τοκομερίδια ομολόγων παραμετρικού επιτοκίου¹ δε γίνονται δεκτές ειδοποιήσεις, εφόσον οι ημερομηνίες διακανονισμού (valeur) της συναλλαγής δεν απέχουν τουλάχιστον δύο (2) εργάσιμες ημέρες από την ημερομηνία λήξης των τίτλων.

Για τη διασφάλιση της ομαλής εκκαθάρισης και διακανονισμού των συναλλαγών, η αποστολή των ειδοποιήσεων από τους συμμετέχοντες φορείς προς το Σύστημα πρέπει να γίνεται το συντομότερο δυνατό μετά την κατάρτιση της μεταξύ τους συναλλαγής.

6.2 ΣΥΝΑΛΛΑΓΕΣ ΣΤΗΝ ΠΡΩΤΟΓΕΝΗ ΑΓΟΡΑ

6.2.1 Αρχική διάθεση τίτλων

Στην Πρωτογενή Αγορά πραγματοποιείται η αρχική διάθεση νεοεκδιδομένων τίτλων που εισάγονται στο Σύστημα με οποιαδήποτε διαδικασία, όπως της δημοπρασίας, της εγγραφής, κλπ. Κάθε φορέας αναγγέλει στο Σύστημα την τελική κατανομή των τίτλων που απέκτησε στην Πρωτογενή Αγορά στο Λογαριασμό Ιδίου Χαρτοφυλακίου και στο Λογαριασμό Χαρτοφυλακίου Πελατείας (Επενδυτών), καθώς και τις αντίστοιχες αξίες διακανονισμού κατά κωδικό έκδοσης τίτλων. Η αναγγελία αυτή πρέπει να προηγείται των ειδοποιήσεων (εντολών/οδηγιών για εκκαθάριση και διακανονισμό) συνεπεία πράξεων (συναλλαγών) επί των συγκεκριμένων τίτλων, οι οποίες πραγματοποιούνται στη Δευτερογενή Αγορά. Σε κάθε περίπτωση, οι συγκεκριμένες αναγγελίες κατανομής των τίτλων, κατά τα ανωτέρω, δεν ακυρώνονται ούτε τροποποιούνται εκ των υστέρων. Με βάση τα στοιχεία των αναγγελιών, το Σύστημα προβαίνει ταυτόχρονα στις εξής εγγραφές :

- χρέωση των τρεχούμενων λογαριασμών ταμειακής διαχείρισης σε ευρώ ή λογαριασμούς καταθέσεων σε ευρώ των συμμετεχόντων φορέων και πίστωση του λογαριασμού ταμειακής διαχείρισης του Εκδότη των τίτλων.

¹ Για τα τοκομερίδια παραμετρικού επιτοκίου βλέπε ΑΠΟΣΥΝΔΕΣΗ-ΕΠΑΝΑΣΥΝΔΕΣΗ ΤΟΚΟΜΕΡΙΔΙΟΥ, ΚΕΦ. 8.2.1.1.2

- πίστωση των λογαριασμών τίτλων Ιδίου Χαρτοφυλακίου ή/και Πελατείας των συμμετεχόντων φορέων κατ' απόλυτη αντιστοιχία με τους τίτλους του Εκδότη που εισάγονται στο Σύστημα και καταχωρούνται στους λογαριασμούς των φορέων, ως προς τους οποίους τηρείται ειδικός λογαριασμός παρακολούθησης και στο όνομα του εκδότη.

6.2.2 Εξόφληση τίτλων στη λήξη και πληρωμή τοκομεριδίων

Στην ημερομηνία λήξης των τίτλων ή πληρωμής των τοκομεριδίων, το Σύστημα προβαίνει αυτόματα στην εξόφλησή τους και πραγματοποιεί τις σχετικές εγγραφές στους λογαριασμούς τίτλων και στους τρεχούμενους λογαριασμούς ταμειακής διαχείρισης σε ευρώ ή λογαριασμούς καταθέσεων σε ευρώ με βάση τα υπόλοιπα των λογαριασμών τίτλων του τέλους της προηγούμενης ημέρας της λήξης των τίτλων ή της πληρωμής των τοκομεριδίων. Το Σύστημα καταβάλλει τα ποσά των τοκομεριδίων στους τρεχούμενους λογαριασμούς ταμειακής διαχείρισης σε ευρώ ή λογαριασμούς καταθέσεων σε ευρώ των συμμετεχόντων φορέων που έχουν την κυριότητα των τίτλων κατά την ημέρα πληρωμής του τοκομεριδίου. Κατ' εξαίρεση, αν κατά την ημερομηνία αυτή οι τίτλοι είναι καταχωρημένοι σε λογαριασμό άλλου φορέα λόγω προθεσμιακής πράξης, ως προς την οποία έχει σταλεί ειδοποίηση στο Σύστημα, π.χ. από δανεισμό, σύμφωνο πώλησης με επαναγορά (repos), κλπ., το Σύστημα καταβάλλει τα ποσά των τοκομεριδίων που αντιστοιχούν στην ονομαστική αξία των τίτλων που έχουν αποτελέσει αντικείμενο της εν λόγω συναλλαγής στον τρεχούμενο λογαριασμό ταμειακής διαχείρισης σε ευρώ ή λογαριασμό καταθέσεων σε ευρώ του συμμετέχοντα φορέα που είχε την κυριότητα των τίτλων αμέσως πριν από την έναρξη ισχύος της συγκεκριμένης προθεσμιακής πράξης (π.χ. τον φορέα που δάνεισε τους τίτλους ή τον πωλητή των τίτλων με σύμφωνο επαναγοράς τους, κατά περίπτωση), χωρίς παρακράτηση φόρου. Ο φόρος που αναλογεί στα ποσά των τοκομεριδίων των συναλλαγών αυτών παρακρατείται από το φορέα που είχε τους τίτλους (που απετέλεσαν αντικείμενο της ανωτέρω συναλλαγής) στα χαρτοφυλάκια του την προηγούμενη εργάσιμη ημέρα της πληρωμής του τοκομεριδίου. Κατ' εξαίρεση, για τους τίτλους που έχουν γίνει αντικείμενο συναλλαγής Buy/Sell back (Κ.Σ. 78), το προϊόν της πληρωμής των τοκομεριδίων καταβάλλεται από το Σύστημα στους τρεχούμενους λογαριασμούς ταμειακής διαχείρισης σε ευρώ ή λογαριασμούς καταθέσεων σε ευρώ του φορέα, στο λογαριασμό του οποίου ήταν καταχωρημένοι οι τίτλοι την αμέσως προηγούμενη εργάσιμη μέρα της πληρωμής του τοκομεριδίου.

Αν η ημερομηνία λήξης τίτλου ή πληρωμής τοκομεριδίων συμπίπτει με **αργία**, τότε η πίστωση των τρεχόμενων λογαριασμών ταμειακής διαχείρισης σε ευρώ ή λογαριασμών καταθέσεων σε ευρώ γίνεται την **επομένη εργάσιμη ημέρα, υπολογιζόμενη** βάσει του Ελληνικού Τραπεζικού Συστήματος, εκτός αν ορίζεται διαφορετικά στους όρους έκδοσης των τίτλων. Το προϊόν εξόφλησης τίτλων που έχουν ενεχυρασθεί και ως προς τους οποίους δεν υπάρχει μέχρι την ημερομηνία λήξης τους συμφωνία αποδέσμευσης του ενεχύρου, πιστώνεται σε ειδικό άτοκο δεσμευμένο λογαριασμό στην Τράπεζα της Ελλάδος, στο όνομα του δότη του ενεχύρου, με ενέχυρο στο λογαριασμό αυτό υπέρ του ασφαλειολήπτη.

6.3 ΣΥΝΑΛΛΑΓΕΣ ΣΤΗ ΔΕΥΤΕΡΟΓΕΝΗ ΑΓΟΡΑ

Στο Σύστημα αναγγέλλονται προς εκκαθάριση και διακανονισμό, μέσω ειδοποιήσεων, κατά κωδικό έκδοσης τίτλων, όλες οι συναλλαγές μεταξύ των συμμετεχόντων στο Σύστημα φορέων, ανεξάρτητα αν συνοδεύονται από ταυτόχρονη κίνηση τρεχόμενων λογαριασμών ταμειακής διαχείρισης σε ευρώ ή λογαριασμών καταθέσεων σε ευρώ, καθώς και η συνολική μεταβολή μεταξύ των λογαριασμών Ιδίου Χαρτοφυλακίου (Κ.Α. 01, 03, 04, 05, 09) και Πελατείας (Κ.Α. 100, 101, 102, 103, 11, 12, 130, 131, 132, 133, 14, 15) του ιδίου συμμετέχοντα φορέα. Δεν ανακοινώνονται οι συναλλαγές μεταξύ των πελατών υπό τον ίδιο λογαριασμό τίτλων του συμμετέχοντα φορέα. Η αναγγελία αυτή γίνεται ανεξάρτητα του τρόπου κατάρτισης της

συναλλαγής, π.χ. αν η συναλλαγή καταρτίστηκε ή όχι σε οργανωμένη αγορά ή άλλο σύστημα διαπραγμάτευσης (π.χ. σε πολυμερή συστήματα κατάρτισης συναλλαγών) ή εξωχρηματιστηριακώς (over the counter). Εξυπακούεται ότι οι ειδοποιήσεις εισάγονται στο Σύστημα από τους φορείς που είναι υπόχρεοι για την εκκαθάριση (διακανονισμό) των συναλλαγών.

6.4 ΑΠΟΚΤΗΣΗ, ΔΙΑΘΕΣΗ ΚΑΙ ΤΗΡΗΣΗ ΤΙΤΛΩΝ

6.4.1 Αφού ολοκληρωθεί ο διακανονισμός κατά τα οριζόμενα στο κεφάλαιο 12 : ΗΜΕΡΗΣΙΑ ΔΙΑΔΙΚΑΣΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ ΤΩΝ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ ΤΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ, με την οριστική πίστωση τίτλων σε λογαριασμό φορέα κτώνται τα εκ των τίτλων απορρέοντα δικαιώματα είτε για ίδιο λογαριασμό του φορέα είτε για λογαριασμό των επενδυτών του, μέσω του φορέα, αναλόγως του είδους του λογαριασμού στον οποίο πιστώνονται οι τίτλοι. Αντίστοιχα, με την οριστική χρέωση των τίτλων σε λογαριασμό φορέα, στο πλαίσιο του διακανονισμού συναλλαγών κατά τα οριζόμενα στο κεφάλαιο 12, επέρχεται οριστική αποξένωση του φορέα και, εμμέσως, των πελατών – επενδυτών, αναλόγως του είδους του λογαριασμού, από τα δικαιώματα επί των τίτλων αυτών. Τα ανωτέρω ισχύουν, αναλόγως, και σε περίπτωση ενεχύρασης τίτλων και, εν γένει, κτήσεως δικαιωμάτων επί τίτλων μέσω συναλλαγών που καταχωρούνται στο Σύστημα και εκκαθαρίζονται απ' αυτό.

6.4.2 Κάθε συμμετέχων φορέας του Συστήματος οφείλει ανά πάσα στιγμή να διασφαλίζει ότι οι τίτλοι που είναι καταχωρημένοι στο λογαριασμό των επενδυτών του στο Σύστημα αντιστοιχούν στους τίτλους με δικαιούχους πελάτες του, τους οποίους οφείλει να απεικονίζει ανά πάσα στιγμή στα βιβλία του, σύμφωνα με το άρθρο 6 παρ. 2 του ν. 2396/1996, τηρουμένων και των λοιπών σχετικών διατάξεων της νομοθεσίας. Για το σκοπό αυτό, οφείλει για κάθε λογαριασμό επενδυτών που τηρεί ανά είδος τίτλων στο Σύστημα, να απεικονίζει στα βιβλία του τους επενδυτές-δικαιούχους των τίτλων αυτών, με σαφή αναφορά της ποσότητας των τίτλων των οποίων είναι δικαιούχος καθένας απ' αυτούς.

7. ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΤΩΝ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΕΩΝ ΚΑΙ ΕΙΔΗ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ

7.1 ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΤΩΝ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΕΩΝ

Ανάλογα με το είδος συναλλαγής, στις ειδοποιήσεις που αποστέλλονται προς το Σύστημα (εντολές/οδηγίες προς εκκαθάριση και διακανονισμό των συναλλαγών), πρέπει να περιέχονται ορισμένα από τα παρακάτω στοιχεία :

7.1.1 ΟΝΟΜΑ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ

Επωνυμία του συμμετέχοντα στο Σύστημα φορέα, που αποστέλλει την ειδοποίηση.

7.1.2 ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ

Ο κωδικός του αποστολέα της ειδοποίησης (συμμετέχοντα φορέα, που αποστέλλει την ειδοποίηση ή αυτού που εκκαθαρίζει και διακανονίζει τη συναλλαγή για λογαριασμό του). Ο κωδικός αυτός δίδεται σε κάθε συμμετέχοντα φορέα κατά την ημέρα υπογραφής της σύμβασης προσχώρησής του στο Σύστημα. Η αναφορά του στοιχείου αυτού στις ειδοποιήσεις είναι υποχρεωτική.

7.1.3 ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ

Κωδικός της συναλλαγής που αποτελεί το αντικείμενο της ειδοποίησης. Αποτελείται από 2 αριθμητικά ψηφία, όπως αναφέρεται στο συνημμένο παράρτημα αρ. 2. Η αναφορά του στοιχείου αυτού στις ειδοποιήσεις είναι υποχρεωτική.

7.1.4 ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΣΥΜΦΩΝΙΑΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ

Η ημερομηνία κατά την οποία καταρτίστηκε η συναλλαγή πρέπει να είναι προγενέστερη ή ίδια με την ημερομηνία κατά την οποία λαμβάνεται η σχετική ειδοποίηση από το Σύστημα. Η ημερομηνία αναγράφεται με τη μορφή ΕΕΕΕΜΜΗΗ. Η αναφορά του στοιχείου αυτού στις ειδοποιήσεις είναι υποχρεωτική.

7.1.5 ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ

Ο αύξων αριθμός που δίδεται από κάθε συμμετέχοντα φορέα στις ειδοποιήσεις που αποστέλλει προς το Σύστημα (αριθμός αποστολής). Για κάθε ειδοποίησή του στο Σύστημα, ο συμμετέχων φορέας χρησιμοποιεί διαφορετικό αριθμό αποστολής, ανεξάρτητα από τον τρόπο αποστολής της ειδοποίησης στο Σύστημα. Ο αριθμός αποστολής μπορεί να έχει μέχρι 6 ψηφία και στην αρχή κάθε έτους ξεκινά από τον αριθμό 1. Σε καμία περίπτωση **δεν επιτρέπεται η επανάληψη αριθμού που έχει ήδη χρησιμοποιηθεί**. Στην τελευταία αυτή περίπτωση, η ταυτόσημη ειδοποίηση που εισάγεται δεύτερη στο Σύστημα απορρίπτεται και ενημερώνεται σχετικά ο συμμετέχων φορέας. Δεν επιτρέπεται η χρησιμοποίηση αριθμού αποστολής με στοιχεία από 90000 μέχρι 99999, διότι αυτά χρησιμοποιούνται από το Σύστημα για λογαριασμό των φορέων κατά την αποσύνδεση (stripping) και επανένωση των τοκομεριδίων των ομολόγων, καθώς επίσης και στη διάθεση και προεξόφληση ομολόγων φυσικών προσώπων (B ISIN). Επίσης, δεν επιτρέπεται η χρησιμοποίηση των αριθμών αποστολής από το διάστημα που έχει δεσμευθεί για συναλλαγές που κλείνονται μέσω ΗΔΑΤ και ΕΜΤΣ. Η αναφορά του αριθμού αποστολής στις ειδοποιήσεις είναι υποχρεωτική. Επιτρέπεται στους φορείς να χρησιμοποιούν αριθμό αποστολής από διαφορετικά αριθμητικά διαστήματα (π.χ. 201000-, 501000-, κλπ.). Στις περιπτώσεις αυτές θα πρέπει να ξεκινούν κάθε χρόνο από την αρχή του αριθμητικού διαστήματος.

7.1.6 ΣΧΕΤΙΚΟ

Πληροφοριακά στοιχεία του αποστολέα. Τα στοιχεία αυτά μπορούν να είναι μέχρι και 16 αλφαριθμητικοί χαρακτήρες και η αναφορά τους στις ειδοποιήσεις είναι προαιρετική.

7.1.7 ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΑΠΟΚΤΗΣΗΣ ΤΩΝ ΤΙΤΛΩΝ (στην Πρωτογενή Αγορά)

Η ημερομηνία κατά την οποία ο συμμετέχων φορέας απέκτησε, για λογαριασμό του Ιδίου Χαρτοφυλακίου ή της Πελατείας του, τίτλους από την πρωτογενή αγορά είτε με τη διαδικασία της εγγραφής είτε με δημοπρασία. Η ημερομηνία απόκτησης (συμφωνίας για το Σύστημα) αναγράφεται με τη μορφή ΕΕΕΕΜΜΗΗ και η αναφορά του στοιχείου αυτού στις ειδοποιήσεις είναι υποχρεωτική.

7.1.8 ΚΩΔΙΚΟΣ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ

Ο αριθμός λογαριασμού τίτλων του αποστολέα (συμμετέχοντα φορέα) στον οποίο θα χρεωθούν ή θα πιστωθούν οι τίτλοι που αποτελούν το αντικείμενο της συναλλαγής. Αποτελείται από αριθμητικά ψηφία και η κωδικοποίησή του γίνεται όπως αναφέρεται στο κεφάλαιο 4 : ΚΑΤΗΓΟΡΙΕΣ ΤΗΡΟΥΜΕΝΩΝ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΩΝ. Η αναφορά του στοιχείου αυτού στις ειδοποιήσεις είναι υποχρεωτική.

7.1.9 ΘΕΣΗ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ

Η θέση (ιδιότητα) του συμμετέχοντα φορέα στη συναλλαγή, αναλόγως του είδους και περιεχομένου της. Αποτελείται από έναν αλφαβητικό χαρακτήρα ανάλογα με τη συναλλαγή. Συγκεκριμένα, οι χαρακτήρες αυτοί, κατά είδος συναλλαγής, είναι οι εξής :

Για αγοραπωλησία τίτλων : Αγοραστής¹ = A, Πωλητής² = V

Για μεταβίβαση τίτλων χωρίς ταμειακή κίνηση : Λήπτης = A, Δότης = V

Για repos επί τίτλων : Αγοραστής = A, Πωλητής = V

Για Buy/Sell back τίτλων : Αγοραστής = A, Πωλητής = V

Για περιθώριο πράξης repos επί τίτλων : Αγοραστής = A, Πωλητής = V

Για δανεισμό τίτλων : Δανειστής = P, Δανειζόμενος = E

Για ενέχυρο τίτλων : Δικαιούχος (ασφαλειολήπτης, ενεχυρούχος δανειστής) = B, Δότης = D

Η αναφορά του στοιχείου αυτού στις ειδοποιήσεις των πιο πάνω συναλλαγών είναι υποχρεωτική.

7.1.10 ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΚΑΙ ΩΡΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ (VALEUR) ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ

Η ημερομηνία διακανονισμού (valeur) της συναλλαγής πρέπει να είναι :

- α) εργάσιμη ημέρα για το Σύστημα,
- β) ίδια με την ημερομηνία διακανονισμού (valeur) του Συστήματος, δυνάμενη να είναι και μεταγενέστερη (μέχρι και 365 ημέρες) της ημερομηνίας λήψεως της ειδοποίησης από το Σύστημα και
- γ) προγενέστερη της ημερομηνίας λήξης των τίτλων.

Ειδικότερα, για τις συναλλαγές που αφορούν σε ενεχύραση τίτλων και σε τοκομερίδια ομολόγων παραμετρικού επιτοκίου δε γίνονται δεκτές ειδοποιήσεις εφόσον οι ημερομηνίες διακανονισμού (valeur) της συναλλαγής δεν απέχουν τουλάχιστον δύο (2) εργάσιμες ημέρες από την ημερομηνία λήξης των τίτλων.

Η ημερομηνία διακανονισμού (valeur) της συναλλαγής αναγράφεται με τη μορφή ΕΕΕΕΜΜΗΗ και η αναφορά του στοιχείου αυτού στις ειδοποιήσεις είναι υποχρεωτική.

Η ώρα διακανονισμού της συναλλαγής πρέπει να είναι εντός του ωραρίου λειτουργίας του Συστήματος και η συναλλαγή θα διακανονιστεί τη συγκεκριμένη ώρα με βάση την αρχή του διακανονισμού των συναλλαγών μία προς μία σε συνεχή χρόνο, εφόσον πληρούνται οι συνθήκες διακανονισμού της. Η ώρα αναγράφεται με τη μορφή ΩΩΛΛΔΔ και η αναφορά του στοιχείου αυτού στις ειδοποιήσεις είναι προαιρετική.

¹ Για τις ανάγκες του διακανονισμού της συναλλαγής

² Για τις ανάγκες του διακανονισμού της συναλλαγής

7.1.11 ΟΝΟΜΑ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ

Όνομα του συμμετέχοντος στο Σύστημα φορέα, που αποτελεί τον αντισυμβαλλόμενο στη συναλλαγή (για σκοπούς διακανονισμού της).

7.1.12 ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ

Ο κωδικός του συμμετέχοντα φορέα που επέχει θέση αντισυμβαλλομένου στη συναλλαγή. Η αναφορά του στοιχείου αυτού στις ειδοποιήσεις είναι υποχρεωτική, εκτός από την περίπτωση εσωτερικής (δηλαδή εντός του ίδιου συμμετέχοντος φορέα, από Λογαριασμό Πελατείας σε Λογαριασμό Ιδίου Χαρτοφυλακίου ή αντιστρόφως) μεταβίβασης τίτλων.

7.1.13 ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΤΩΝ ΤΙΤΛΩΝ

Περιγραφή των στοιχείων έκδοσης των τίτλων. Οι τίτλοι, ανάλογα με το είδος της συναλλαγής, χαρακτηρίζονται ως ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΟΜΕΝΟΙ, ΠΑΡΑΔΙΔΟΜΕΝΟΙ, ΔΑΝΕΙΖΟΜΕΝΟΙ, ΠΑΡΑΛΑΜΒΑΝΟΜΕΝΟΙ, ΕΝΕΧΥΡΑΖΟΜΕΝΟΙ, ΑΝΤΙΚΑΘΙΣΤΑΜΕΝΟΙ, κλπ.

7.1.14 ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΛΗΞΗΣ ΤΩΝ ΤΙΤΛΩΝ

Η ημερομηνία λήξης των τίτλων που αποτελούν το αντικείμενο της συναλλαγής. Η ημερομηνία λήξης αναγράφεται με τη μορφή ΕΕΕΕΜΜΗΗ.

7.1.15 ΚΩΔΙΚΟΣ ISIN ΤΩΝ ΤΙΤΛΩΝ

Ο κωδικός ISIN των τίτλων που αποτελούν το αντικείμενο της συναλλαγής. Αποτελείται από 12 αλφαριθμητικούς χαρακτήρες και αρχίζει πάντα με GR. Η αναφορά του στοιχείου αυτού στις ειδοποιήσεις είναι υποχρεωτική.

7.1.16 ΟΝΟΜΑΣΤΙΚΗ ΑΞΙΑ

Η ονομαστική αξία των τίτλων. Μπορεί να είναι αριθμός μέχρι 15 ακέραιων ψηφίων και δύο δεκαδικών, η αναφορά δε του στοιχείου αυτού στις ειδοποιήσεις είναι υποχρεωτική.

7.1.17 ΑΞΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ

7.1.18 ΑΞΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ ΣΤΗΝ ΕΝΑΡΞΗ (για repos, για περιθώριο πράξης repos, για Buy/Sell Back)

7.1.19 ΑΞΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ ΣΤΗ ΛΗΞΗ (για repos, για περιθώριο πράξης repos, για Buy/Sell Back)

Ποσό που δηλώνει τη συμφωνηθείσα αξία συναλλαγής. Μπορεί να είναι αριθμός μέχρι 15 ακέραιων ψηφίων και δύο δεκαδικών, η αναφορά δε του στοιχείου αυτού στις ειδοποιήσεις είναι υποχρεωτική.

7.1.20 ΚΑΤΕΥΘΥΝΣΗ ΛΟΓΙΣΤΙΚΟΠΟΙΗΣΗΣ (για περιθώριο πράξης repos)

Υποδηλώνει τη χρέωση ή πίστωση του αποστέλλοντος την ειδοποίηση.

D για χρέωση ή C για πίστωση της αξίας διακανονισμού στην ημερομηνία διακανονισμού (valeur) ή στη λήξη της συναλλαγής του repos.

7.1.21 ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΚΑΙ ΩΡΑ ΛΗΞΗΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ (για προθεσμιακές πράξεις)

Η ημερομηνία κατά την οποία λήγει η συναλλαγή (π.χ. δάνειο τίτλων, repos, Buy/Sell back, swap κλπ). Η ημερομηνία αυτή πρέπει να είναι:

- α) εργάσιμη ημέρα για το Σύστημα
- β) μεταγενέστερη της ημερομηνίας (και ώρας) διακανονισμού (valeur) της αρχικής συναλλαγής που θα πρέπει να έχει ήδη διακανονιστεί και
- γ) προγενέστερη της ημερομηνίας λήξης των τίτλων που αποτελούν το αντικείμενο της συναλλαγής.

Η ημερομηνία λήξης της συναλλαγής αναγράφεται με τη μορφή ΕΕΕΕΜΜΗΗ και η αναφορά του στοιχείου αυτού στις ειδοποιήσεις είναι υποχρεωτική, εκτός από την περίπτωση δανείου που έχει αόριστη διάρκεια.

Η ώρα λήξης της συναλλαγής πρέπει να είναι εντός του ωραρίου λειτουργίας του Συστήματος και η συναλλαγή θα διακανονιστεί τη συγκεκριμένη ώρα με βάση την αρχή διακανονισμού των συναλλαγών μίας προς μία σε συνεχή χρόνο εφόσον πληρούνται οι συνθήκες διακανονισμού της. Η ώρα αναγράφεται με τη μορφή ΩΩΛΛΔΔ και η αναφορά του στοιχείου αυτού στις ειδοποιήσεις είναι προαιρετική.

7.1.22 ΚΑΤΑΒΑΛΛΟΜΕΝΟΣ ΤΟΚΟΣ

ΠΟΣΟ ΣΕ ΕΥΡΩ ή

ΒΑΣΗ ΥΠΟΛΟΓΙΣΜΟΥ και ΕΠΙΤΟΚΙΟ

Το ποσό σε ευρώ που θα καταβληθεί στο δικαιούχο ως τόκος για το δάνειο που χορήγησε. Αντί του ποσού μπορεί να ανακοινωθεί στο Σύστημα το επιτόκιο και η βάση υπολογισμού του τόκου (κεφάλαιο). Η βάση υπολογισμού μπορεί να είναι αριθμός μέχρι και 15 ακέραιων ψηφίων και δύο δεκαδικών ενώ το επιτόκιο μπορεί να είναι αριθμός μέχρι 3 ακέραιων ψηφίων και 4 δεκαδικών (ΑΑΑ,ΔΔΔΔ). Ο υπολογισμός του καταβαλλόμενου τόκου γίνεται με βάση τις πραγματικές ημέρες του δανείου και έτος 360 ημερών.

7.1.23 ΚΑΤΑΒΛΗΤΕΟ ΠΟΣΟ και ΔΙΚΑΙΟΥΧΟΣ (για swap επί τίτλων)

ΠΟΣΟ ΣΕ ΕΥΡΩ

Το ποσό σε ευρώ που θα καταβληθεί στον οριζόμενο ως δικαιούχο κατά τη σύναψη της συμφωνίας swap. Πρέπει να είναι αριθμός μέχρι και 15 ακέραιων ψηφίων και δύο δεκαδικών.

7.1.24 ΔΙΚΑΙΟΥΧΟΣ

Ο δικαιούχος του ποσού που συμφωνήθηκε από τους συμμετέχοντες φορείς κατά τη σύναψη της συμφωνίας swap. Αποτελείται από έναν αλφαβητικό χαρακτήρα ανάλογα με το ποιός από τους δύο αποστολείς των ειδοποιήσεων θα εισπράξει το ποσό (Αποστολέας = Ε, Αντισυμβαλλόμενος = C). Στις περιπτώσεις που έχει συμφωνηθεί από τους συμβαλλόμενους η καταβολή συγκεκριμένου ποσού ευρώ (και έχει συμπληρωθεί το στοιχείο με τη ένδειξη ποσό σε ευρώ) η αναφορά του στοιχείου αυτού στις ειδοποιήσεις είναι υποχρεωτική.

7.1.25 ΕΤΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ ΤΗΣ ΑΡΧΙΚΗΣ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΗΣ

Αναγράφεται με τη μορφή τετραψήφιου αριθμού και αφορά στο έτος αποστολής της αρχικής ειδοποίησης. Η αναφορά του στοιχείου αυτού στις ειδοποιήσεις είναι υποχρεωτική.

7.1.26 ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ ΤΗΣ ΑΡΧΙΚΗΣ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΗΣ

Αναγράφεται ο αριθμός αποστολής που είχε δοθεί από το συμμετέχοντα φορέα στην αρχική ειδοποίηση, την οποία θέλει να ακυρώσει ή ως προς την οποία θέλει να αντικαταστήσει ή να αποδεσμεύσει το ενέχυρο. Είναι αριθμός το πολύ 6 ψηφίος και η αναφορά του στοιχείου αυτού στις ειδοποιήσεις είναι υποχρεωτική.

7.2 ΕΙΔΗ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ ΣΤΗ ΔΕΥΤΕΡΟΓΕΝΗ ΑΓΟΡΑ ΚΑΙ ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΤΩΝ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΕΩΝ ΚΑΤΑ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗ

Το Σύστημα δέχεται για επεξεργασία και διεκπεραίωση (διακανονισμό) ειδοποιήσεις που αναφέρονται στις παρακάτω συναλλαγές Δευτερογενούς Αγοράς:

7.2.1 Αγοραπωλησία τίτλων

Καταγράφονται οι συναλλαγές αγοράς και πώλησης που καταρτίζονται και πρέπει να εκκαθαρισθούν μεταξύ δύο συμβαλλομένων (συμμετεχόντων φορέων για ίδιο λογαριασμό ή/και για λογαριασμό πελατών), εφόσον συνέπεια της συναλλαγής είναι η μεταφορά τίτλων μεταξύ δύο λογαριασμών που τηρούνται στο Σύστημα από δύο διαφορετικούς συμμετέχοντες φορείς και ο χρηματικός διακανονισμός της. Κάθε τέτοια συναλλαγή δημιουργεί, κίνηση τίτλων από ένα συμμετέχοντα φορέα σε έναν άλλο και χρηματική ροή προς την αντίθετη κατεύθυνση. Απαιτείται ειδοποίηση και από τους δύο συμμετέχοντες φορείς με τα εξής στοιχεία :

- ΟΝΟΜΑ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ = 10
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΣΥΜΦΩΝΙΑΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ
- ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
- ΣΧΕΤΙΚΟ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ
- ΘΕΣΗ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ (ΑΓΟΡΑΣΤΗΣ=A, ΠΩΛΗΤΗΣ=V)
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ/ΩΡΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ (VALEUR) ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ
- ΟΝΟΜΑ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ
- ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΛΗΞΗΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ISIN ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΟΝΟΜΑΣΤΙΚΗ ΑΞΙΑ
- ΑΞΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ
- ΚΛΕΙΔΑ ΔΙΑΣΦΑΛΙΣΗΣ (για telex ή fax)

7.2.2 Μεταβίβαση τίτλων χωρίς ταμειακή κίνηση

Καταγράφονται οι μεταφορές τίτλων μεταξύ λογαριασμών δύο συμμετεχόντων φορέων χωρίς ταμειακή κίνηση. Απαιτείται ειδοποίηση και από τους δύο συμμετέχοντες φορείς με τα εξής στοιχεία :

- ΟΝΟΜΑ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ = 21
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΣΥΜΦΩΝΙΑΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ
- ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
- ΣΧΕΤΙΚΟ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ
- ΘΕΣΗ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ (ΛΗΠΤΗΣ=A, ΔΟΤΗΣ=V)
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ/ΩΡΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ (VALEUR) ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ
- ΟΝΟΜΑ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ
- ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΛΗΞΗΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ISIN ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΟΝΟΜΑΣΤΙΚΗ ΑΞΙΑ
- ΚΛΕΙΔΑ ΔΙΑΣΦΑΛΙΣΗΣ (για telex ή fax)

7.2.3 Εσωτερική μεταβίβαση

Καταγράφονται στο Σύστημα οι μεταφορές τίτλων μεταξύ των λογαριασμών του ίδιου συμμετέχοντος φορέα (π.χ. από το λογαριασμό Ιδίου Χαρτοφυλακίου στο λογαριασμό

Χαρτοφυλακίου Πελατείας ή αντίστροφα), χωρίς ταμειακή κίνηση. Απαιτείται μία μόνο ειδοποίηση από το συμμετέχοντα φορέα με τα εξής στοιχεία :

- ΟΝΟΜΑ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ = 22
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΣΥΜΦΩΝΙΑΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ
- ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
- ΣΧΕΤΙΚΟ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ (Χρεούμενος λογαριασμός)
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ/ΩΡΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ (VALEUR) ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ (Πιστούμενος λογαριασμός)
- ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΛΗΞΗΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ISIN ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΟΝΟΜΑΣΤΙΚΗ ΑΞΙΑ
- ΚΛΕΙΔΑ ΔΙΑΣΦΑΛΙΣΗΣ (για telex ή fax)

7.2.4 "Repos" επί τίτλων

Καταγράφονται οι πράξεις "repos" επί τίτλων (συμβάσεις πωλήσεως με σύμφωνο επαναγοράς) που συνίστανται από δύο σκέλη α) την πώληση τίτλων, που διακανονίζεται "τοις μετρητοίς", και β) την περιεχόμενη στην αρχική σύμβαση συμφωνία επαναγοράς των τίτλων σε προσυμφωνημένη τιμή από τον αρχικό πωλητή, που διακανονίζεται (ως πώληση αντίστροφη της αρχικής σε σχέση με τα πρόσωπα των συμβαλλομένων) κατά τον προσυμφωνημένο χρόνο σε προσυμφωνημένη τιμή. Κάθε πράξη "repos" διεκπεραιώνεται με δύο συναλλαγές αγοραπωλησίας που αναγγέλλονται στο Σύστημα ταυτόχρονα. Η πρώτη συναλλαγή διακανονίζεται κατά την ημερομηνία έναρξης της ισχύος συμφωνίας (ημερομηνία διακανονισμού - valeur - της συναλλαγής) ενώ η δεύτερη διακανονίζεται από το Σύστημα αυτόματα κατά την ημερομηνία λήξης της συμφωνίας (ημέρα επαναγοράς). Οι εγγραφές που γίνονται είναι, ως προς κάθε συναλλαγή, αντίστοιχες εκείνων της αγοραπωλησίας (7.2.1.). Απαιτείται ειδοποίηση και από τους δύο συμμετέχοντες φορείς με τα εξής στοιχεία :

- ΟΝΟΜΑ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ = 70
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΣΥΜΦΩΝΙΑΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ
- ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
- ΣΧΕΤΙΚΟ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ
- ΘΕΣΗ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ (ΑΓΟΡΑΣΤΗΣ=A, ΠΩΛΗΤΗΣ=V)
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ/ΩΡΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ (VALEUR) ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ (έναρξης ισχύος της συναλλαγής)
- ΟΝΟΜΑ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ
- ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΛΗΞΗΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ISIN ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΟΝΟΜΑΣΤΙΚΗ ΑΞΙΑ
- ΑΞΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ (στην έναρξη της συναλλαγής)
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ/ΩΡΑ ΛΗΞΗΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ
- ΑΞΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ ΣΤΗ ΛΗΞΗ
- ΚΛΕΙΔΑ ΔΙΑΣΦΑΛΙΣΗΣ (για telex ή fax)

7.2.5 "Buy/sell back" τίτλων

Καταγράφονται οι πράξεις "Buy/sell back" τίτλων που αποτελούν συμβάσεις πωλήσεως τίτλων με σύμφωνο επαναγοράς και συνίστανται από δύο σκέλη : α) την πώληση τίτλων, που διακανονίζεται "τοις μετρητοίς" και β) την περιεχόμενη στην αρχική σύμβαση συμφωνία επαναγοράς των τίτλων σε προσυμφωνημένη τιμή από τον αρχικό πωλητή³, που διακανονίζεται (ως πώληση αντίστροφη της αρχικής σε σχέση με τα πρόσωπα των συμβαλλομένων) κατά τον προσυμφωνημένο χρόνο σε προσυμφωνημένη τιμή. Κατά τούτο, οι πράξεις Buy/sell back τίτλων ταυτίζονται με τις πράξεις Repos επί τίτλων. Η πράξη "Buy/sell back" τίτλων διαφέρει από την πράξη "Repos" επί τίτλων ως προς το ότι αν κατά το χρονικό διάστημα ισχύος της συναλλαγής "Buy/sell back" λήξει τοκομερίδιο του συγκεκριμένου τίτλου, το Σύστημα καταβάλλει το ποσό που αντιστοιχεί στην αξία του τοκομεριδίου στο συμμετέχοντα φορέα, στο λογαριασμό του οποίου ήταν καταχωρημένοι οι τίτλοι την προηγούμενη εργάσιμη ημέρα της πληρωμής του τοκομεριδίου (βλ.κεφ. 6.2.2). Κάθε πράξη διεκπεραιώνεται με δύο συναλλαγές αγοραπωλησίας που αναγγέλλονται στο Σύστημα ταυτόχρονα. Η πρώτη συναλλαγή διακανονίζεται κατά την ημερομηνία έναρξης ισχύος της συμφωνίας (ημερομηνία διακανονισμού - valeur - της συναλλαγής) ενώ η δεύτερη διακανονίζεται από το Σύστημα αυτόματα κατά την ημερομηνία λήξης της συμφωνίας (ημέρα επαναγοράς). Οι εγγραφές που γίνονται είναι αντίστοιχες εκείνων της αγοραπωλησίας (7.2.1). Απαιτείται ειδοποίηση και από τους δύο συμμετέχοντες φορείς με τα εξής στοιχεία :

- ΟΝΟΜΑ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ = 78
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΣΥΜΦΩΝΙΑΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ
- ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
- ΣΧΕΤΙΚΟ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ
- ΘΕΣΗ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ (ΑΓΟΡΑΣΤΗΣ = A, ΠΩΛΗΤΗΣ = V)
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ/ΩΡΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ (VALEUR) ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ (έναρξης ισχύος της συναλλαγής)
- ΟΝΟΜΑ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ
- ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ISIN ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΟΝΟΜΑΣΤΙΚΗ ΑΞΙΑ
- ΑΞΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ (στην έναρξη της συναλλαγής)
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ/ΩΡΑ ΛΗΞΗΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ
- ΑΞΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ ΣΤΗ ΛΗΞΗ
- ΚΛΕΙΔΑ ΔΙΑΣΦΑΛΙΣΗΣ (για telex ή fax)

7.2.6 Πράξη περιθωρίου στο πλαίσιο προθεσμιακής πράξης επί τίτλων

Καταγράφονται οι πράξεις, οι οποίες τροποποιούν προγενεστέρως καταρτισθείσες και αναγγελθείσες στο Σύστημα προθεσμιακές πράξεις και, συγκεκριμένα, πράξεις "repos" ή "Buy/sell back" τίτλων, στις οποίες και αναφέρονται. Με τις πράξεις περιθωρίου ενεργοποιείται δηλαδή ενδιάμεσος διακανονισμός προγενέστερης πράξης "repos" ή "Buy/sell back" τίτλων.

³ Για τις ανάγκες του διακανονισμού της συναλλαγής

Για να γίνει η τροποποίηση με την πράξη περιθωρίου, θα πρέπει η ημερομηνία διακανονισμού (valeur) της πράξης περιθωρίου να είναι μεταγενέστερη της ημερομηνίας διακανονισμού (valeur) της αρχικής πράξης "repos" ή "Buy/sell back" και προγενέστερη της ημερομηνίας λήξης αυτής. Η τροποποίηση αυτή συνίσταται στη μείωση ή αύξηση της ονομαστικής αξίας των τίτλων, με ενδεχόμενη τροποποίηση της αξίας διακανονισμού κατά τη λήξη του Repos. Απαιτείται ειδοποίηση και από τους δύο φορείς με τα παρακάτω στοιχεία:

- ΟΝΟΜΑ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ = 75
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΣΥΜΦΩΝΙΑΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ
- ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
- ΣΧΕΤΙΚΟ
- ΕΤΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ ΤΗΣ ΑΡΧΙΚΗΣ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΗΣ
- ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ ΑΡΧΙΚΗΣ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΗΣ
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ/ΩΡΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ (VALEUR) ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ
- ΟΝΟΜΑΣΤΙΚΗ ΑΞΙΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΘΕΣΗ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ (Α=ΑΓΟΡΑΣΤΗΣ ,V=ΠΩΛΗΤΗΣ)
- ΑΞΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ ΤΗΝ ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ (VALEUR)
- ΚΑΤΕΥΘΥΝΣΗ ΛΟΓΙΣΤΙΚΟΠΟΙΗΣΗΣ (D=ΧΡΕΩΣΗ,C=ΠΙΣΤΩΣΗ)
- ΑΞΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ ΣΤΗ ΛΗΞΗ
- ΚΑΤΕΥΘΥΝΣΗ ΛΟΓΙΣΤΙΚΟΠΟΙΗΣΗΣ (D=ΧΡΕΩΣΗ,C=ΠΙΣΤΩΣΗ)
- ΚΛΕΙΔΑ ΔΙΑΣΦΑΛΙΣΗΣ (για telex ή fax)

7.2.7 "Swap" επί τίτλων

Καταγράφονται οι πράξεις "swap" επί τίτλων που συνίστανται σε ανταλλαγές τίτλων διαφορετικής διάρκειας ή και απόδοσης σε συγκεκριμένη περίοδο. Κάθε πράξη "swap" διεκπεραιώνεται με δύο συναλλαγές: Στην πρώτη γίνεται χρεωπίστωση των λογαριασμών τίτλων των συναλλασσομένων κατά την ημερομηνία έναρξης ισχύος της συμφωνίας "swap" (ημερομηνία διακανονισμού -valeur- της συναλλαγής). Στη δεύτερη γίνονται αντίστροφες εγγραφές στους λογαριασμούς τίτλων, καθώς και στους τρεχούμενους λογαριασμούς ταμειακής διαχείρισης σε ευρώ ή λογαριασμούς καταθέσεων σε ευρώ κατά τη λήξη της συμφωνίας. Οι τελευταίες αυτές εγγραφές γίνονται αυτόματα από το Σύστημα. Απαιτείται ειδοποίηση από τους δύο συμμετέχοντες φορείς με τα εξής στοιχεία :

- ΟΝΟΜΑ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ = 60
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΣΥΜΦΩΝΙΑΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ
- ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
- ΣΧΕΤΙΚΟ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ/ΩΡΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ (VALEUR) ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ (έναρξης ισχύος της συναλλαγής)
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ/ΩΡΑ ΛΗΞΗΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ (του swap)
- ΟΝΟΜΑ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ
- ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΠΑΡΑΔΟΘΕΝΤΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΛΗΞΗΣ ΠΑΡΑΔΟΘΕΝΤΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ISIN ΠΑΡΑΔΟΘΕΝΤΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΟΝΟΜΑΣΤΙΚΗ ΑΞΙΑ ΠΑΡΑΔΟΘΕΝΤΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΠΑΡΑΛΗΦΘΕΝΤΩΝ ΤΙΤΛΩΝ

- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΛΗΞΗΣ ΠΑΡΑΛΗΦΘΕΝΤΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ISIN ΠΑΡΑΛΗΦΘΕΝΤΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΟΝΟΜΑΣΤΙΚΗ ΑΞΙΑ ΠΑΡΑΛΗΦΘΕΝΤΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΚΑΤΑΒΛΗΤΕΟ ΠΟΣΟ ΚΑΙ ΔΙΚΑΙΟΥΧΟΣ
ΠΟΣΟ ΣΕ ΕΥΡΩ
ΔΙΚΑΙΟΥΧΟΣ (ΥΠΕΡ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ=E ,
ΥΠΕΡ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ=C)
- ΚΛΕΙΔΑ ΔΙΑΣΦΑΛΙΣΗΣ (για telex ή fax)

7.2.8 Δανεισμός τίτλων

Καταγράφονται οι συναλλαγές δανεισμού τίτλων, που γίνονται με ή χωρίς ενεχύραση τίτλων κατόπιν συμφωνίας των δύο συμβαλλομένων. Στο Σύστημα ανακοινώνεται είτε το ποσό του τόκου του δανείου είτε η βάση υπολογισμού του τόκου και το επιτόκιο. Δανεισμός τίτλων αόριστης διάρκειας μπορεί να λήξει και με μόνη την πρωτοβουλία του δανειστή.

7.2.8.1 Απλό δάνειο τίτλων

Καταγράφονται τα δάνεια τίτλων που δεν συνδέονται με ενεχύραση τίτλων. Απαιτείται διπλή ειδοποίηση και από τους δύο συμμετέχοντες φορείς, με τα εξής στοιχεία :

- ΟΝΟΜΑ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ = 41
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΣΥΜΦΩΝΙΑΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ
- ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
- ΣΧΕΤΙΚΟ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ
- ΘΕΣΗ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ (ΔΑΝΕΙΣΤΗΣ=P, ΔΑΝΕΙΖΟΜΕΝΟΣ=E)
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ/ΩΡΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ (VALEUR) ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ (έναρξης ισχύος του δανείου)
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ/ΩΡΑ ΛΗΞΗΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ (του δανείου καθορισμένης διάρκειας)
- ΟΝΟΜΑ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ
- ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΔΑΝΕΙΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΛΗΞΗ ΔΑΝΕΙΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ISIN ΔΑΝΕΙΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΟΝΟΜΑΣΤΙΚΗ ΑΞΙΑ ΔΑΝΕΙΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΚΑΤΑΒΑΛΛΟΜΕΝΟΣ ΤΟΚΟΣ
ΠΟΣΟ ΣΕ ΕΥΡΩ ή
ΒΑΣΗ ΥΠΟΛΟΓΙΣΜΟΥ και ΕΠΙΤΟΚΙΟ
- ΚΛΕΙΔΑ ΔΙΑΣΦΑΛΙΣΗΣ (για telex ή fax)

7.2.8.2 Λήξη δανείου αόριστης διάρκειας

Δάνειο τίτλων αόριστης διάρκειας λήγει με μόνη την ειδοποίηση του δανειστή προς το Σύστημα. Η ειδοποίηση αυτή πρέπει να περιέχει τα εξής στοιχεία :

- ΟΝΟΜΑ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ = 49

- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΣΥΜΦΩΝΙΑΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ ή ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
- ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
- ΣΧΕΤΙΚΟ
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ/ΩΡΑ ΛΗΞΗΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ (λήξη του δανείου)
- ΕΤΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ ΤΗΣ ΑΡΧΙΚΗΣ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΗΣ (ΔΑΝΕΙΣΜΟΥ)
- ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ ΤΗΣ ΑΡΧΙΚΗΣ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΗΣ (ΔΑΝΕΙΣΜΟΥ)
- ΚΛΕΙΔΑ ΔΙΑΣΦΑΛΙΣΗΣ (για telex ή fax)

7.2.8.3 Δάνειο τίτλων έναντι ενεχύρου

Καταγράφονται τα δάνεια τίτλων που συνδέονται με ταυτόχρονη ενεχύραση τίτλων. Αντικείμενο του ενεχύρου είναι άλλοι διαθέσιμοι τίτλοι του δανειζόμενου και όχι αυτοί του δανείου. Η αξία του ενεχύρου ορίζεται ελεύθερα από τους συμβαλλόμενους. Το Σύστημα εγγυάται ότι οι ενεχυρασθέντες τίτλοι δεν θα αποδεσμευθούν πριν από την εξόφληση του δανείου. Το Σύστημα, ανάλογα με την περίπτωση, μεταφέρει τους ενεχυρασθέντες τίτλους από το λογαριασμό τίτλων "Ιδίου Χαρτοφυλακίου" (Κ.Α.01) ή "Χαρτοφυλακίου Πελατείας" (Κ.Α.100, 101, 102, 103, 11, 12) στο λογαριασμό "τίτλοι που ενεχυράσθηκαν για συναλλαγές εντός Συστήματος" (Κ.Α. 0150, 10050, 10150, 10250, 10350, 1150, 1250). Για δάνειο τίτλων έναντι ενεχύρου απαιτείται ειδοποίηση και από τους δύο συμμετέχοντες φορείς με τα εξής στοιχεία :

- ΟΝΟΜΑ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ = 42
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΣΥΜΦΩΝΙΑΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ
- ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
- ΣΧΕΤΙΚΟ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ
- ΘΕΣΗ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ (ΔΑΝΕΙΣΤΗΣ=P, ΔΑΝΕΙΖΟΜΕΝΟΣ=E)
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ/ΩΡΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ (VALEUR) ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ (έναρξης ισχύος του δανείου)
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ/ΩΡΑ ΛΗΞΗΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ (του δανείου καθορισμένης διάρκειας)
- ΟΝΟΜΑ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ
- ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΔΑΝΕΙΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΛΗΞΗ ΔΑΝΕΙΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ISIN ΔΑΝΕΙΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΟΝΟΜΑΣΤΙΚΗ ΑΞΙΑ ΔΑΝΕΙΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΕΝΕΧΥΡΑΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΛΗΞΗ ΕΝΕΧΥΡΑΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ISIN ΕΝΕΧΥΡΑΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΟΝΟΜΑΣΤΙΚΗ ΑΞΙΑ ΕΝΕΧΥΡΑΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΚΑΤΑΒΑΛΛΟΜΕΝΟΣ ΤΟΚΟΣ
ΠΟΣΟ ΣΕ ΕΥΡΩ ή
ΒΑΣΗ ΥΠΟΛΟΓΙΣΜΟΥ και ΕΠΙΤΟΚΙΟ
- ΚΛΕΙΔΑ ΔΙΑΣΦΑΛΙΣΗΣ (για telex ή fax)

Σε περίπτωση που κατά την ημέρα κατά την οποία έχει συμφωνηθεί η επιστροφή των δανεισθέντων τίτλων ο οφειλέτης δεν εκπληρώσει την υποχρέωσή του, εφόσον οι συμβαλλόμενοι φορείς έχουν προβλέψει την εφαρμογή του ν. 3301/2004, το Σύστημα ενεργεί αναλόγως.

7.2.9 Ενεχύραση τίτλων

7.2.9.1 Ενεχύραση τίτλων για συναλλαγές εκτός Συστήματος

α) Οι συμμετέχοντες φορείς ή οι επενδυτές πελάτες τους, μπορούν να ενεχυράσουν τίτλους που τηρούνται στο Σύστημα ως εμπράγματη ασφάλεια για την εκπλήρωση αναληφθεισών υποχρεώσεών τους σε σχέση με πραγματοποιηθείσες εκτός του Συστήματος συναλλαγές και, εν γένει, υποχρεώσεις. Το Σύστημα, ανάλογα με την περίπτωση, μεταφέρει τους ενεχυρασθέντες τίτλους από το "λογαριασμό τίτλων Ιδίου Χαρτοφυλακίου" (Κ.Α.01) ή "Χαρτοφυλακίου Πελατείας" (Κ.Α. 100, 101, 102, 103, 11, 12) στο "λογαριασμό τίτλων που ενεχυράσθηκαν για συναλλαγές εκτός Συστήματος" (Κ.Α. 0151, 10051, 10151, 10251, 10351, 1151, 1251). Το Σύστημα διασφαλίζει ότι οι ενεχυρασθέντες τίτλοι δεν θα αποδεσμευτούν χωρίς τη σύμφωνη γνώμη του ενεχυρούχου δανειστή. Το Σύστημα ενημερώνεται σχετικά από τον ενεχυράζοντα (δότη του ενεχύρου) και τον ενεχυρούχο δανειστή (δικαιούχο του ενεχύρου/ασφαλειολήπτη) με δύο ειδοποιήσεις που περιλαμβάνουν τα εξής στοιχεία :

- ΟΝΟΜΑ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ = 51
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΣΥΜΦΩΝΙΑΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ
- ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
- ΣΧΕΤΙΚΟ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ
- ΘΕΣΗ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ (ΔΟΤΗΣ=D, ΔΙΚΑΙΟΥΧΟΣ = B)
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ/ΩΡΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ (VALEUR) ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ (έναρξης ισχύος της ενεχύρασης)
- ΟΝΟΜΑ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ
- ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΕΝΕΧΥΡΑΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΛΗΞΗ ΕΝΕΧΥΡΑΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ISIN ΕΝΕΧΥΡΑΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΟΝΟΜΑΣΤΙΚΗ ΑΞΙΑ ΕΝΕΧΥΡΑΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΚΛΕΙΔΑ ΔΙΑΣΦΑΛΙΣΗΣ (για telex ή fax)

β) Εξυπακούεται ότι δεν απαιτείται η τήρηση της ως άνω διαδικασίας, εφόσον ασφαλειολήπτης είναι φορέας του Συστήματος, στο λογαριασμό επενδυτών του οποίου είναι καταχωρημένοι οι τίτλοι που αποτελούν αντικείμενο του ενεχύρου και δότης του ενεχύρου είναι πελάτης του φορέα, δικαιούχος των ενεχυραζομένων τίτλων. Στην περίπτωση αυτή, ο φορέας υποχρεούται όμως, στα βιβλία του, να τηρεί χωριστά τους εν λόγω ενεχυρασμένους τίτλους, απεικονίζοντας όλα τα στοιχεία της εν λόγω σύμβασης που είναι απαραίτητα για τον προσδιορισμό των δικαιωμάτων των μερών (όπως ενεχυρούχος οφειλέτης, σύμβαση ενεχύρου, κωδικός λογαριασμού τίτλων, κωδικός ISIN, ονομαστική αξία ενεχυραζομένων τίτλων, στοιχεία έκδοσης αυτών, διάρκεια σύμβασης κλπ.).

7.2.9.2 Αντικατάσταση ή μερική αποδέσμευση ενεχύρου τίτλων

Ο ενεχυράζων (δότης του ενεχύρου) μπορεί, με τη σύμφωνη γνώμη του ενεχυρούχου δανειστή (δικαιούχου του ενεχύρου/ασφαλειολήπτη), να τροποποιήσει τη σύνθεση του ενεχύρου που είχε καθορισθεί με προηγούμενη ειδοποίηση. Προς το Σύστημα αποστέλλονται δύο ειδοποιήσεις (από τον ενεχυράζοντα και τον ενεχυρούχο δανειστή) που περιλαμβάνουν τα εξής στοιχεία :

- ΟΝΟΜΑ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ

- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ = 58
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΣΥΜΦΩΝΙΑΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ
- ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
- ΣΧΕΤΙΚΟ
- ΕΤΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ ΤΗΣ ΑΡΧΙΚΗΣ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΗΣ ΕΝΕΧΥΡΑΣΗΣ
- ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ ΤΗΣ ΑΡΧΙΚΗΣ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΗΣ ΕΝΕΧΥΡΑΣΗΣ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ
- ΘΕΣΗ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ (ΔΟΤΗΣ=D, ΔΙΚΑΙΟΥΧΟΣ=B)
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ/ΩΡΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ (VALEUR) ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ (αντικατάσταση του ενεχύρου)
- ΟΝΟΜΑ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ
- ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΑΠΟΔΕΣΜΕΥΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΛΗΞΗ ΑΠΟΔΕΣΜΕΥΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ISIN ΑΠΟΔΕΣΜΕΥΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΟΝΟΜΑΣΤΙΚΗ ΑΞΙΑ ΑΠΟΔΕΣΜΕΥΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΕΝΕΧΥΡΑΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΛΗΞΗ ΕΝΕΧΥΡΑΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ISIN ΕΝΕΧΥΡΑΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΟΝΟΜΑΣΤΙΚΗ ΑΞΙΑ ΕΝΕΧΥΡΑΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΚΛΕΙΔΑ ΔΙΑΣΦΑΛΙΣΗΣ (για telex ή fax)

Για τη μερική αποδέσμευση τίτλων πρέπει στην ειδοποίηση να αναφέρονται η ονομαστική αξία των αποδεσμευομένων τίτλων (ονομαστική αξία των αρχικώς ενεχυρασθέντων τίτλων) και η ονομαστική αξία των τίτλων ως προς τους οποίους διατηρείται το ενέχυρο.

7.2.9.3 Ολική αποδέσμευση ενεχύρου τίτλων

Για την ολική αποδέσμευση του ενεχύρου τίτλων απαιτείται η διπλή αποστολή ειδοποίησης στο Σύστημα τόσο από τον ενεχυράζοντα (δότη του ενεχύρου), όσο και από τον ενεχυρούχο δανειστή (δικαιούχο του ενεχύρου/ασφαλειολήπτη). Οι ειδοποιήσεις περιλαμβάνουν τα εξής στοιχεία :

- ΟΝΟΜΑ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ = 59
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΣΥΜΦΩΝΙΑΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ
- ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
- ΣΧΕΤΙΚΟ
- ΕΤΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ ΤΗΣ ΑΡΧΙΚΗΣ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΗΣ ΕΝΕΧΥΡΑΣΗΣ
- ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ ΤΗΣ ΑΡΧΙΚΗΣ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΗΣ ΕΝΕΧΥΡΑΣΗΣ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ
- ΘΕΣΗ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ (ΔΟΤΗΣ=D, ΔΙΚΑΙΟΥΧΟΣ = B)
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ/ΩΡΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ (VALEUR) ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ
- ΟΝΟΜΑ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ
- ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΕΝΕΧΥΡΑΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΛΗΞΗ ΕΝΕΧΥΡΑΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ISIN ΕΝΕΧΥΡΑΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΟΝΟΜΑΣΤΙΚΗ ΑΞΙΑ ΕΝΕΧΥΡΑΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΚΛΕΙΔΑ ΔΙΑΣΦΑΛΙΣΗΣ (για telex ή fax)

7.2.9.4 Λήξη ενεχυρασθέντων τίτλων

Σε περίπτωση λήξης ενεχυρασθέντων τίτλων, αν δεν υπάρξει συμφωνία αποδέσμευσης του ενεχύρου, η αξία των τίτλων πιστώνεται σε ειδικό άτοκο δεσμευμένο λογαριασμό που τηρείται στην Τράπεζα της Ελλάδος στο όνομα του δότη του ενεχύρου, με ενέχυρο στο λογαριασμό αυτό υπέρ του ασφαλειολήπτη.

7.2.10 Άλλες συναλλαγές

7.2.10.1 Ακυρώσεις ή τροποποιήσεις ειδοποιήσεων

Οι συμμετέχοντες φορείς έχουν τη δυνατότητα να ακυρώσουν ή να τροποποιήσουν ειδοποιήσεις τους στο Σύστημα, υπαναχωρώντας από την αρχικώς καταρτισθείσα και καταχωρηθείσα στο Σύστημα προς εκκαθάριση συναλλαγή ή τροποποιώντας το περιεχόμενό της, αντιστοίχως, μόνον εφόσον οι σχετικές συναλλαγές δεν έχουν διακανονιστεί οριστικά. Στην περίπτωση αυτή απαιτούνται:

- για την **ακύρωση προηγούμενης ειδοποίησης**, να αποσταλεί σχετική **ειδοποίηση ανάκλησης** και
- για την **τροποποίησή** της να αποσταλεί **ειδοποίηση ακύρωσης** της αρχικής ειδοποίησης **και νέα ειδοποίηση** με τα στοιχεία της νέας συναλλαγής.

Αν για το διακανονισμό συναλλαγής απαιτείται ειδοποίηση από κάθε συμμετέχοντα φορέα, τότε και για την ακύρωση προηγούμενης ειδοποίησης ή την τροποποίησή της, απαιτείται επίσης ειδοποίηση ακύρωσης από κάθε συμμετέχοντα φορέα.

Η απαιτούμενη ειδοποίηση ακύρωσης πρέπει να περιλαμβάνει τα εξής στοιχεία :

- ΟΝΟΜΑ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ = 90
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΣΥΜΦΩΝΙΑΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ (ακύρωσης ή τροποποίησης)
- ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
- ΣΧΕΤΙΚΟ
- ΕΤΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ ΤΗΣ ΑΡΧΙΚΗΣ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΗΣ
- ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ ΤΗΣ ΑΡΧΙΚΗΣ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΗΣ
- ΚΛΕΙΔΑ ΔΙΑΣΦΑΛΙΣΗΣ (για telex ή fax)

7.2.10.2 Μετατροπή φυσικών τίτλων σε τίτλους με λογιστική μορφή (άυλους τίτλους)

Υπάρχει δυνατότητα μετατροπής φυσικών (ενσώματων) τίτλων σε τίτλους με λογιστική (άυλη) μορφή. Οι όροι και η διαδικασία μετατροπής καθορίζονται με αποφάσεις των αρμοδίων αρχών. Για την πραγματοποίηση της μετατροπής, απαιτείται ειδοποίηση του συμμετέχοντα φορέα με τα εξής στοιχεία :

- ΟΝΟΜΑ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ = 31
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΣΥΜΦΩΝΙΑΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ
- ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ

- ΣΧΕΤΙΚΟ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ
- ΘΕΣΗ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ/ΩΡΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ (VALEUR) ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ
- ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΛΗΞΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ISIN ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΟΝΟΜΑΣΤΙΚΗ ΑΞΙΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΚΛΕΙΔΑ ΔΙΑΣΦΑΛΙΣΗΣ (για telex ή fax)

7.2.10.3 Αποσύνδεση-Επανασύνδεση τοκομεριδίων ομολόγων (STRIPPING)

Η συγκεκριμένη συναλλαγή αναλύεται στο επόμενο κεφάλαιο (βλέπε κεφάλαιο 8 : ΑΠΟΣΥΝΔΕΣΗ – ΕΠΑΝΑΣΥΝΔΕΣΗ ΤΟΚΟΜΕΡΙΔΙΩΝ ΟΜΟΛΟΓΩΝ ΚΑΙ ΣΥΝΑΛΛΑΓΕΣ ΕΠΙ ΑΥΤΩΝ).

8. ΑΠΟΣΥΝΔΕΣΗ – ΕΠΑΝΑΣΥΝΔΕΣΗ ΤΟΚΟΜΕΡΙΔΙΩΝ ΟΜΟΛΟΓΩΝ ΚΑΙ ΣΥΝΑΛΛΑΓΕΣ ΕΠΙ ΑΥΤΩΝ

8.1 ΕΙΣΑΓΩΓΗ

Στο κείμενο που ακολουθεί, περιγράφεται ο τρόπος διαχείρισης των τίτλων που παράγονται από ομόλογο όταν αποσυνδεθούν τα τοκομερίδια του (παράγωγοι τίτλοι) και ο τρόπος παρακολούθησης των συναλλαγών τους από το Σύστημα. Ως μονάδα συναλλαγής (lot) προκειμένου για αποσύνδεση (stripping) των τοκομεριδίων ομολόγων ορίζονται τα 1.000 ευρώ. Επίσης, περιγράφεται η διαδικασία επανασύνδεσης των παράγωγων τίτλων με το αρχικό ομόλογο και επανένωσης των ομολόγων. Οι διαδικασίες αυτές, βασίζονται στις αρχές του Συστήματος, μια από τις οποίες είναι “η αρχή της μη μετατροπής της ονομαστικής αξίας τίτλου που έχει ήδη εισαχθεί στο Σύστημα”. Με βάση την αρχή αυτή, τα τοκομερίδια μπορούν να εισαχθούν στο Σύστημα μόνο εφόσον έχουν συγκεκριμένη ονομαστική αξία (δηλαδή σαν τίτλοι).

Τα ομόλογα ανάλογα με τον τόκο που αποδίδουν, χωρίζονται σε τρεις κατηγορίες:

1. Ομόλογα σε ευρώ σταθερού επιτοκίου

Το επιτόκιο είναι προσδιορισμένο για όλες τις τοκοφόρους περιόδους.

2. Ομόλογα σε ευρώ κυμαινόμενου επιτοκίου

Το επιτόκιο είναι προσδιορισμένο μόνο για την τρέχουσα τοκοφόρο περίοδο ενώ για κάθε επόμενη ανακοινώνεται λίγες (2 έως 3) ημέρες πριν την έναρξή της.

3. Ομόλογα σε ευρώ αγνώστου προϊόντος εξόφλησης τοκομεριδίου (εν συντομία ομόλογα “παραμετρικού” επιτοκίου)

Το προϊόν εξόφλησης των τοκομεριδίων των ομολόγων αυτών υπολογίζεται με βάση ένα συνδυασμό από παραμέτρους που οι τιμές τους είναι είτε μεταβλητές είτε σταθερές. Οι τιμές των μεταβλητών παραμέτρων αλλάζουν κατά τη διάρκεια της αντίστοιχης τοκοφόρου περιόδου. Σαν παράδειγμα αναφέρουμε το τιμαριθμοποιημένο ομόλογο σε ευρώ και το ομόλογο με ρήτρα ξένου νομίσματος των οποίων η απόδοση σε ευρώ προσδιορίζεται λίγο πριν τη λήξη της αντίστοιχης τοκοφόρου περιόδου (π.χ. 10-15 ημέρες για το τιμαριθμοποιημένο και 2 ημέρες για το ομόλογο με ρήτρα ξένου νομίσματος).

Με σκοπό την παρακολούθηση των τοκομεριδίων για τα οποία δεν έχει καθορισθεί το επιτόκιο τους, εισάγονται δύο νέες έννοιες :

- Η **μονάδα τοκομεριδίου** που αντιστοιχεί σε ένα τοκομερίδιο το οποίο είναι θεωρητικά συνημμένο σε κάθε ομόλογο με ονομαστική αξία :

α) 1.000 ευρώ (για τα ομόλογα σε ευρώ) ή

β) τόσων ευρώ όσο το γινόμενο της μονάδας έκδοσης - συναλλαγής (lot) επί την τιμή του ξένου νομίσματος που χρησιμοποιήθηκε για την έκδοση των ομολόγων με ρήτρα ξένου νομίσματος (π.χ. 1.000 USD X T ευρώ, όπου T είναι η ισοτιμία USD/€ που χρησιμοποιήθηκε για την αρχική εισαγωγή των τίτλων στο Σύστημα και τα 1.000 USD αντιστοιχούν σε μια μονάδα έκδοσης - συναλλαγής του συγκεκριμένου ομολόγου)

- Ο “**θυγατρικός**” **φορέας** κάθε συμμετέχοντος του οποίου οι λογαριασμοί τίτλων χρησιμοποιούνται για την καταχώρηση των παραπάνω μονάδων τοκομεριδίων καθώς και για την παρακολούθηση των συναλλαγών που πραγματοποιούνται με αυτές. Για το “θυγατρικό” φορέα το Σύστημα τηρεί μόνο λογαριασμούς τίτλων Ιδίου Χαρτοφυλακίου (Κ.Α. 01) και Χαρτοφυλακίου Πελατείας (Κ.Α. 100, 101, 102, 103, 11, 12).

8.2 ΑΠΟΣΥΝΔΕΣΗ ΤΟΚΟΜΕΡΙΔΙΩΝ ΟΜΟΛΟΓΩΝ

8.2.1 Γενικά περί αποσύνδεσης τοκομεριδίων ομολόγων

Η αποσύνδεση (stripping) των τοκομεριδίων από το σώμα του ομολόγου μπορεί να πραγματοποιηθεί για κάθε έκδοση ομολόγων.

Το Υπουργείο Οικονομικών εκδίδει τη σχετική απόφαση. Ταυτόχρονα γίνεται και η ανακοίνωση των κωδικών έκδοσης (ISIN) του αρχικού τίτλου, των ISIN που αφορούν τους παράγωγους τίτλους (τοκομερίδια, σώμα ομολόγου με συνημμένα τα τοκομερίδια των επόμενων τοκοφόρων περιόδων καθώς και σώμα ομολόγου χωρίς τοκομερίδια) και έχουν τη μορφή GR09CCCCC. Το πλήθος των ISIN που προκύπτουν από την αποσύνδεση είναι αριθμός διπλάσιος των ετών διάρκειας των ομολόγων.

Παράδειγμα κωδικών έκδοσης (ISIN)

Τριετές ομόλογο κυμαινομένου επιτοκίου

Αρχικό ISIN : GR0510099733

ISIN τοκομεριδίου 1ης τοκοφόρου περιόδου : GR0900649048

ISIN σώματος ομολόγου 1ης τοκοφόρου περιόδου με
συνημμένα τα υπόλοιπα (2) τοκομερίδια :
GR0900650053

ISIN τοκομεριδίου 2ης τοκοφόρου περιόδου : GR0900651069

ISIN σώματος ομολόγου 2ης τοκοφόρου περιόδου με
συνημμένο το τελευταίο τοκομερίδιο : GR0900652075

ISIN τοκομεριδίου 3ης τοκοφόρου περιόδου : GR0900653081

ISIN σώματος ομολόγου (χωρίς συνημμένα τοκομερίδια) : GR0900654097

Ο φορέας μπορεί να αποσυνδέσει ένα μέρος ή ολόκληρη την ονομαστική αξία του ομολόγου που έχει καταχωρημένη στο λογαριασμό Ιδίου Χαρτοφυλακίου ή Χαρτοφυλακίου Πελατείας.

Επισημαίνεται ότι, παρά το γεγονός ότι η αποσύνδεση τοκομεριδίου μπορεί να πραγματοποιηθεί για όλη την ονομαστική αξία του ομολόγου, ο αρχικός κωδικός έκδοσης (ISIN) δεν παύει να υφίσταται δεδομένου ότι με τον κωδικό αυτό οι συμμετέχοντες φορείς θα πραγματοποιούν συναλλαγές στις περιπτώσεις που είτε δεν έχουν προχωρήσει σε αποσύνδεση τοκομεριδίων είτε έχουν προβεί σε επανασύνδεση των παράγωγων τίτλων.

Επίσης, με τη λήξη της κάθε τοκοφόρου περιόδου, ο τίτλος που αντιστοιχεί στο σώμα του ομολόγου με συνημμένα τα τοκομερίδια των επόμενων τοκοφόρων περιόδων διαγράφεται από το Σύστημα και η ονομαστική αξία που απέμεινε στους λογαριασμούς

τίτλων του φορέα μεταφέρεται -αυτόματα από το Σύστημα- στο αρχικό ISIN (βλέπε και παράγραφο 8.5 Επανάληψη ομολόγων). Αυτό σημαίνει ότι, για τους τίτλους που διαγράφονται με την έναρξη της επόμενης τοκοφόρου περιόδου, δε γίνονται δεκτές ειδοποιήσεις που έχουν ημερομηνία διακανονισμού (valeur) συναλλαγής ίδια ή μεταγενέστερη της ημερομηνίας διαγραφής τους.

Για τη διευκόλυνση των συναλλασσομένων που πραγματοποιούν συναλλαγές επί των παράγωγων τίτλων, επιβάλλεται όπως στις χορηγούμενες από τους συμμετέχοντες φορείς βεβαιώσεις πράξεων, να αναγράφεται και το αρχικό ISIN του τίτλου.

8.2.1.1 Περιπτώσεις αποσύνδεσης

α) Αποσύνδεση του τοκομεριδίου της τρέχουσας τοκοφόρου περιόδου από ομόλογο

β) Αποσύνδεση όλων των τοκομεριδίων από ομόλογο

Και στις δύο περιπτώσεις, ο συμμετέχων φορέας ή ο πελάτης του, έχει τη δυνατότητα να πραγματοποιήσει, όπως προαναφέρθηκε, αποσύνδεση σε τμήμα ή και σε ολόκληρη την ονομαστική αξία των ομολόγων που τηρούνται σε λογαριασμό τίτλων Ιδίου Χαρτοφυλακίου ή Χαρτοφυλακίου Πελατείας.

Παραδείγματα

α) Αποσύνδεση του τοκομεριδίου της εκάστοτε τρέχουσας τοκοφόρου περιόδου

α.1) Τριετές ομόλογο γνωστού επιτοκίου (π.χ. κυμαινόμενο)

ΑΡΧΙΚΟ ΟΜΟΛΟΓΟ

ISIN GR0510099733

ΣΩΜΑ	ΤΟΚ.1
	ΤΟΚ.2
	ΤΟΚ.3

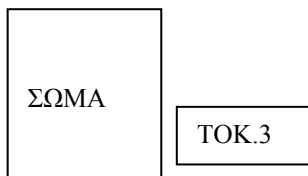
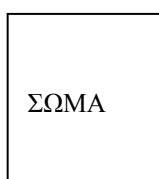
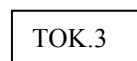
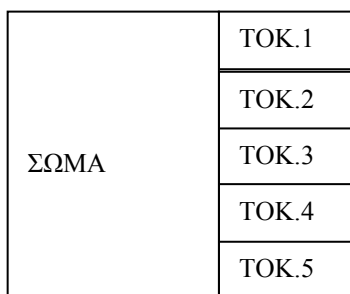
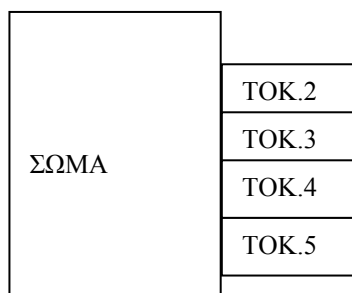
1η ΤΟΚΟΦΟΡΟΣ ΠΕΡΙΟΔΟΣ

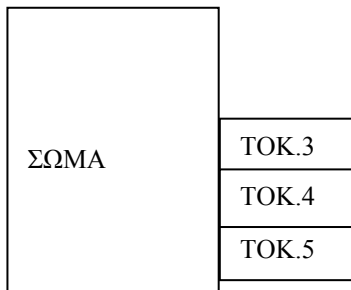
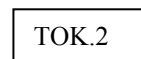
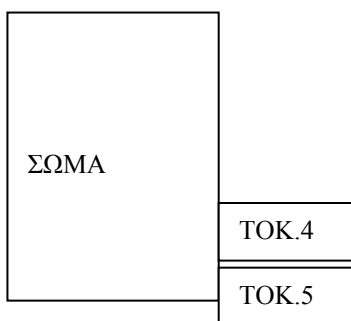
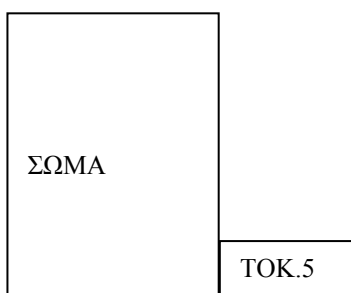
ISIN GR0900650053

ΣΩΜΑ	ΤΟΚ.2
	ΤΟΚ.3

ISIN GR0900649048

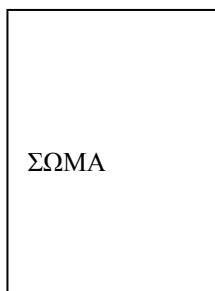
ΤΟΚ.1

2η ΤΟΚΟΦΟΡΟΣ ΠΕΡΙΟΔΟΣISIN GR0900652075ISIN GR09006510693η ΤΟΚΟΦΟΡΟΣ ΠΕΡΙΟΔΟΣISIN GR0900654097ISIN GR0900653081α.2) Πενταετές ομόλογο “παραμετρικού” επιτοκίου (π.χ. τιμαριθμοποιημένο)ΑΡΧΙΚΟ ΟΜΟΛΟΓΟISIN GR03140011251η ΤΟΚΟΦΟΡΟΣ ΠΕΡΙΟΔΟΣΣτο συμμετέχοντα φορέαISIN GR0960002906Στο “θυγατρικό” φορέαISIN GR0960001890

2η ΤΟΚΟΦΟΡΟΣ ΠΕΡΙΟΔΟΣΣτο συμμετέχοντα φορέαISIN GR0960004928Στο “θυγατρικό” φορέαISIN GR09600039803η ΤΟΚΟΦΟΡΟΣ ΠΕΡΙΟΔΟΣΣτο συμμετέχοντα φορέαISIN GR0960006949Στο “θυγατρικό” φορέαISIN GR09600059334η ΤΟΚΟΦΟΡΟΣ ΠΕΡΙΟΔΟΣΣτο συμμετέχοντα φορέαISIN GR0960008960Στο “θυγατρικό” φορέαISIN GR09600079545η ΤΟΚΟΦΟΡΟΣ ΠΕΡΙΟΔΟΣ

Στο συμμετέχοντα φορέα

ISIN GR0960010016



Στο “θυγατρικό” φορέα

ISIN GR0960009976

ΤΟΚ.5

β) Αποσύνδεση των τοκομεριδίων όλων των τοκοφόρων περιόδων

β.1) Τριετές ομόλογο σταθερού επιτοκίου

ΑΡΧΙΚΟ ΟΜΟΛΟΓΟ

ISIN GR0110001030

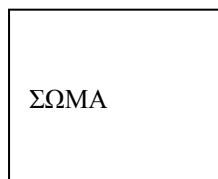
ΣΩΜΑ	ΤΟΚ.1
	ΤΟΚ.2
	ΤΟΚ.3

1η ΤΟΚΟΦΟΡΟΣ ΠΕΡΙΟΔΟΣ

ISIN GR0928006072

ISIN GR0928001024

ISIN GR0928003046 ISIN GR0928005066



ΤΟΚ.1

ΤΟΚ.2

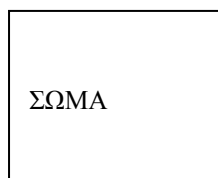
ΤΟΚ.3

2η ΤΟΚΟΦΟΡΟΣ ΠΕΡΙΟΔΟΣ

ISIN GR0928006072

ISIN GR0928003046

ISIN GR0928005066



ΤΟΚ.2

ΤΟΚ.3

3η ΤΟΚΟΦΟΡΟΣ ΠΕΡΙΟΔΟΣISIN GR0928006072

ΣΩΜΑ

ISIN GR0928005066

ΤΟΚ.3

β.2) Τριετές ομόλογο κυμαινόμενου επιτοκίουΑΡΧΙΚΟ ΟΜΟΛΟΓΟISIN GR0510099733

ΣΩΜΑ	ΤΟΚ.1
	ΤΟΚ.2
	ΤΟΚ.3

1η ΤΟΚΟΦΟΡΟΣ ΠΕΡΙΟΔΟΣΣτο συμμετέχοντα φορέαΣτο “θυγατρικό” φορέαISIN GR0900654097 ISIN GR0900649048ISIN GR0900651069ISIN GR0900653081

ΣΩΜΑ

ΤΟΚ.1

ΤΟΚ.2

ΤΟΚ.3

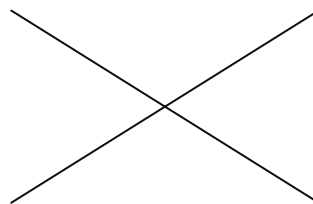
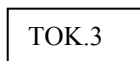
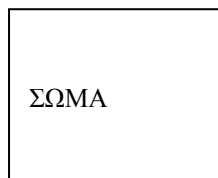
2η ΤΟΚΟΦΟΡΟΣ ΠΕΡΙΟΔΟΣΣτο συμμετέχοντα φορέαΣτο “θυγατρικό” φορέαISIN GR0900654097 ISIN GR0900651069ISIN GR0900653081

ΣΩΜΑ

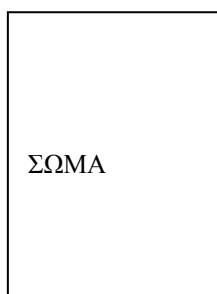
ΤΟΚ.2

ΤΟΚ.3

3η ΤΟΚΟΦΟΡΟΣ ΠΕΡΙΟΔΟΣ

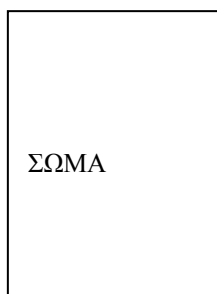
Στο συμμετέχοντα φορέαΣτο “θυγατρικό” φορέαISIN GR0900654097ISIN GR0900653081β.3) Πενταετές ομόλογο “παραμετρικού” επιτοκίου (π.χ. τιμαριθμοποιημένο)ΑΡΧΙΚΟ ΟΜΟΛΟΓΟISIN GR0314001125

ΣΩΜΑ	ΤΟΚ.1
	ΤΟΚ.2
	ΤΟΚ.3
	ΤΟΚ.4
	ΤΟΚ.5

1η ΤΟΚΟΦΟΡΟΣ ΠΕΡΙΟΔΟΣΣτο συμμετέχοντα φορέαISIN GR0960010016Στο “θυγατρικό” φορέαISIN GR0960001890ISIN GR0960003912ISIN GR0960005933ISIN GR0960007954ISIN GR0960009976

ΤΟΚ.1
ΤΟΚ.2
ΤΟΚ.3
ΤΟΚ.4
ΤΟΚ.5

2η ΤΟΚΟΦΟΡΟΣ ΠΕΡΙΟΔΟΣ

Στο συμμετέχοντα φορέαISIN GR0960010016Στο “θυγατρικό” φορέαISIN GR0960003912

ΤΟΚ.2

ISIN GR0960005933

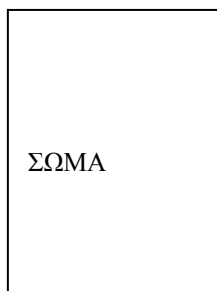
ΤΟΚ.3

ISIN GR0960007954

ΤΟΚ.4

ISIN GR0960009976

ΤΟΚ.5

3η ΤΟΚΟΦΟΡΟΣ ΠΕΡΙΟΔΟΣΣτο συμμετέχοντα φορέαISIN GR0960010016Στο “θυγατρικό” φορέαISIN GR0960005933

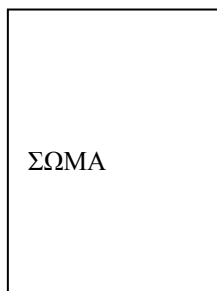
ΤΟΚ.3

ISIN GR0960007954

ΤΟΚ.4

ISIN GR0960009976

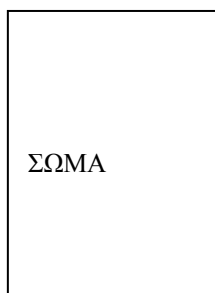
ΤΟΚ.5

4η ΤΟΚΟΦΟΡΟΣ ΠΕΡΙΟΔΟΣΣτο συμμετέχοντα φορέαISIN GR0960010016Στο “θυγατρικό” φορέαISIN GR0960007954

ΤΟΚ.4

ISIN GR0960009976

ΤΟΚ.5

5η ΤΟΚΟΦΟΡΟΣ ΠΕΡΙΟΔΟΣΣτο συμμετέχοντα φορέαΣτο “θυγατρικό” φορέαISIN GR0960010016ISIN GR0960009976

TOK.5

8.2.1.1.1 Αποσύνδεση τοκομεριδίου τρέχουσας τοκοφόρου περιόδου (περίπτωση (α))**8.2.1.1.1.1 Ομόλογο σε ευρώ σταθερού ή κυμαινόμενου επιτοκίου**

Για να πραγματοποιηθεί η αποσύνδεση της περίπτωσης αυτής, το Σύστημα πρέπει να λάβει από το φορέα μέσα στο χρονικό όριο που αναφέρεται στην παράγραφο 8.6.1 : Ειδοποιήσεις αποσύνδεσης - επανασύνδεσης, μια ειδοποίηση “Μεταβίβασης τίτλων χωρίς ταμειακή κίνηση” (κωδικός συναλλαγής 21) με τα στοιχεία της συναλλαγής. Στο πεδίο “Θέση αποστολέα” πρέπει να αναγράφεται το γράμμα V (πωλητής). Το **ISIN του τίτλου** που θα αναφέρεται στην ειδοποίηση πρέπει να είναι **το αρχικό ISIN**. Στη θέση του αντισυμβαλλόμενου αναγράφεται ο κωδικός **“9888”** που αντιστοιχεί σ’ ένα τεχνητό φορέα **“ΣΥΣΤΗΜΑ - STRIPPING 1”**.

Το Σύστημα αναλαμβάνει όλες τις ενέργειες (δημιουργία διπλών ειδοποιήσεων, υπολογισμούς, μεταφορές), ούτως ώστε **την ημερομηνία διακανονισμού (valeur) της συναλλαγής**, ο λογαριασμός τίτλων (ΙΧ ή ΧΠ) του φορέα, να χρεώνεται με την ονομαστική αξία του τίτλου από τον οποίο αποσυνδέει το τοκομερίδιο και **ο ίδιος λογαριασμός τίτλων** να πιστώνεται με τις αντίστοιχες ονομαστικές αξίες των παραγωγών τίτλων (με συναλλαγές που έχουν κωδικό 31), για να είναι δυνατή η διαπραγμάτευσή τους.

Παράδειγμα αποσύνδεσης του 2ου τοκομεριδίου από τριετές ομόλογο:

Πελάτης ενός φορέα έχει τριετές ομόλογο GR0510099733 (αρχικό ISIN) ονομαστικής αξίας 500.000 ευρώ και ζητά την ίδια ημέρα την αποσύνδεση του τοκομεριδίου της τρέχουσας (2ης) τοκοφόρου περιόδου για το τμήμα των 100.000 ευρώ. Είναι ευνόητο ότι δεν έχει πραγματοποιηθεί άλλη αποσύνδεση από τον πελάτη και η 1η τοκοφόρος περίοδος έχει λήξει. Το επιτόκιο της τρέχουσας τοκοφόρου περιόδου είναι 5,355 %. Ο φορέας πρέπει να στείλει προς το Σύστημα μια ειδοποίηση με κωδικό συναλλαγής 21 με αντισυμβαλλόμενο το φορέα “9888 : ΣΥΣΤΗΜΑ – STRIPPING 1”. Την ίδια ημέρα το Σύστημα θα κάνει τις παρακάτω εγγραφές :

Λογαριασμός τίτλων χαρτοφυλακίου πελατείας του συμμετέχοντα φορέα :

<u>Εγγραφή</u>	<u>Τίτλος (ISIN)</u>	<u>ΚΣ</u>	<u>Ονομαστική αξία</u>
Χρέωση :	GR0510099733	(21)	----- 100.000

Πίστωση :	GR0900652075	(31)	-----	100.000
Πίστωση :	GR0900651069	(31)	-----	5.355

8.2.1.1.1.2 Ομόλογο “παραμετρικού” επιτοκίου

Για την αποσύνδεση της περίπτωσης αυτής (που δεν είναι προσδιορισμένο επακριβώς το προϊόν εξόφλησης των τοκομεριδίων σε ευρώ των αντίστοιχων τοκοφόρων περιόδων), οι μονάδες τοκομεριδίων του παράγωγου τίτλου που αντιστοιχούν στο τοκομερίδιο της τρέχουσας τοκοφόρου περιόδου θα μεταφέρονται και θα παρακολουθούνται από το Σύστημα σε ένα “θυγατρικό” φορέα, που θα δημιουργηθεί για κάθε ένα συμμετέχοντα φορέα που θα ζητήσει αυτή την αποσύνδεση.

Έτσι, αν ο φορέας με κωδικό NNNN ζητήσει αποσύνδεση του τοκομεριδίου της τρέχουσας τοκοφόρου περιόδου ή και των επόμενων τοκοφόρων περιόδων (που θα παρακολουθούνται πλέον σε μονάδες τοκομεριδίων), τότε στο Σύστημα - αυτόματα - θα δημιουργηθεί και ο “θυγατρικός” του φορέας με Κ.Α. 5N...NN. Εάν ο συμμετέχων φορέας έχει Κ.Α. 0067, ο “θυγατρικός” του φορέας θα έχει τον Κ.Α. 5067. Ο “θυγατρικός” φορέας θα έχει μόνο λογαριασμούς τίτλων Ιδίου Χαρτοφυλακίου (ΙΧ) και Χαρτοφυλακίου Πελατείας (ΧΠ) στους οποίους θα καταχωρούνται οι μονάδες τοκομεριδίων των παραγώγων τίτλων και θα παρακολουθούνται οι συναλλαγές που πραγματοποιούνται μ’ αυτές.

Για να πραγματοποιηθεί η αποσύνδεση της περίπτωσης αυτής, το Σύστημα πρέπει να λάβει από το φορέα μέσα στο χρονικό όριο που αναφέρεται στην παράγραφο 8.6.1 : Ειδοποιήσεις αποσύνδεσης - επανασύνδεσης, μια ειδοποίηση “Μεταβίβασης τίτλων χωρίς ταμειακή κίνηση” (κωδικός συναλλαγής 21) με τα στοιχεία της συναλλαγής. Στο πεδίο “Θέση αποστολέα” πρέπει να αναγράφεται το γράμμα V (πωλητής). Το ISIN του τίτλου που θα αναφέρεται στην ειδοποίηση πρέπει να είναι το αρχικό ISIN. Στη θέση του αντισυμβαλλόμενου αναγράφεται ο κωδικός “9888” που αντιστοιχεί σε έναν τεχνητό φορέα “ΣΥΣΤΗΜΑ - STRIPPING 1”.

Το Σύστημα αναλαμβάνει όλες τις ενέργειες (δημιουργία διπλών ειδοποιήσεων, υπολογισμούς, μεταφορές), ούτως ώστε την ημερομηνία διακανονισμού (valeur) της συναλλαγής, ο λογαριασμός τίτλων (ΙΧ ή ΧΠ) του φορέα, να χρεώνεται με την ονομαστική αξία του τίτλου του οποίου αποσυνδέεται το τοκομερίδιο και να πιστώνονται οι ίδιοι λογαριασμοί τίτλων, του μεν φορέα με την ονομαστική αξία του ομολόγου (με συνημμένα τα τοκομερίδια των επόμενων περιόδων), του δε “θυγατρικού” του με τις μονάδες τοκομεριδίου της τρέχουσας περιόδου (με συναλλαγές που έχουν κωδικό 31), για να είναι δυνατή η διαπραγμάτευση τους.

Αν ο συμμετέχων φορέας επιθυμεί να πραγματοποιήσει συναλλαγή με τους τίτλους που είναι καταχωρημένοι στους λογαριασμούς του “θυγατρικού” φορέα, θα πρέπει να στείλει ειδοποίηση προς το Σύστημα χρησιμοποιώντας τον Κ.Α. του “θυγατρικού” φορέα. Επίσης, και ο αντισυμβαλλόμενος φορέας (αν υπάρχει), θα πρέπει να κάνει το ίδιο. Για τους αριθμούς αποστολής των ειδοποιήσεων του “θυγατρικού” φορέα, ισχύουν τα αναφερόμενα στην παράγραφο 7.1.5 του παρόντος Κανονισμού.

Μετά το κλείσιμο του Συστήματος, θα στέλνονται στο συμμετέχοντα φορέα και τα extraits των λογαριασμών τίτλων του “θυγατρικού” του. Το περιεχόμενο των extraits αυτών είναι ενδεικτικό των συναλλαγών που πραγματοποίησαν οι φορείς με τις μονάδες των τοκομεριδίων.

Μια εργάσιμη ημέρα πριν τη λήξη της τοκοφόρου περιόδου (όταν πλέον θα έχει καθοριστεί το “παραμετρικό” επιτόκιο), το Σύστημα διαγράφει τις συγκεκριμένες μονάδες τοκομεριδίων που απέμειναν στους λογαριασμούς τίτλων του “θυγατρικού” φορέα και - με τον ίδιο κωδικό έκδοσης (ISIN) - θα πιστώνει τους αντίστοιχους λογαριασμούς τίτλων του κύριου φορέα με ονομαστική αξία:

- το αποτέλεσμα που προκύπτει από το διαδοχικό πολλαπλασιασμό των μονάδων τοκομεριδίων, επί το επιτόκιο και επί 1.000 στην περίπτωση των ομολόγων που η ονομαστική τους αξία εκφράζεται σε ευρώ ή

- το αποτέλεσμα που προκύπτει από το διαδοχικό πολλαπλασιασμό των μονάδων τοκομεριδίων, επί το επιτόκιο, επί τη μονάδα έκδοσης - συναλλαγής του ξένου νομίσματος, επί την καθορισθείσα ισοτιμία του συγκεκριμένου νομίσματος σε ευρώ για την πληρωμή του τοκομεριδίου, στην περίπτωση των ομολόγων με ρήτρα ξένου νομίσματος.

α) Παράδειγμα αποσύνδεσης του 2ου τοκομεριδίου από πενταετές τιμαριθμοποιημένο ομόλογο

Πελάτης ενός φορέα έχει πενταετές τιμαριθμοποιημένο ομόλογο GR0314001125 (αρχικό ISIN) ονομαστικής αξίας 500.000 ευρώ και ζητά την ίδια ημέρα την αποσύνδεση του τοκομεριδίου της τρέχουσας (2ης) τοκοφόρου περιόδου για το τμήμα των 100.000 ευρώ. Είναι ευνόητο ότι δεν έχει πραγματοποιηθεί άλλη αποσύνδεση από τον πελάτη και η 1η τοκοφόρος περίοδος έχει λήξει. Το επιτόκιο της τρέχουσας τοκοφόρου περιόδου είναι άγνωστο (μη επακριβώς προσδιορισμένο). Ο φορέας πρέπει να στείλει προς το Σύστημα μια ειδοποίηση με κωδικό συναλλαγής 21 με αντισυμβαλλόμενο το φορέα “9888 : ΣΥΣΤΗΜΑ – STRIPPING 1”. Την ίδια ημέρα το Σύστημα θα κάνει τις παρακάτω εγγραφές :

Λογαριασμός τίτλων χαρτοφυλακίου πελατείας του συμμετέχοντα φορέα :

Εγγραφή	Τίτλος (ISIN)	ΚΣ	Ονομαστική αξία
Χρέωση :	GR0314001125	(21)	----- 100.000
Πίστωση :	GR0960004928	(31)	----- 100.000

Λογαριασμός τίτλων χαρτοφυλακίου πελατείας του “θυγατρικού” φορέα :

Εγγραφή	Τίτλος (ISIN)	ΚΣ	Μονάδες Τοκομεριδίων
Πίστωση :	GR0960003912	(31)	----- 100

β) Παράδειγμα αποσύνδεσης του 2ου τοκομεριδίου από τριετές ομόλογο με ρήτρα ξένου νομίσματος (π.χ. USD)

Πελάτης ενός φορέα έχει τριετές ομόλογο με ρήτρα USD, με GR0210001930 (αρχικό ISIN) ονομαστικής αξίας 800.000 ευρώ (1.000.000 X 0,800 όπου 1 USD = 0,8 € κατά την αρχική εισαγωγή των τίτλων στο Σύστημα) και ζητά την ίδια ημέρα την αποσύνδεση του τοκομεριδίου της τρέχουσας (2ης) τοκοφόρου περιόδου για το τμήμα των 400.000 ευρώ (500 X 800 όπου το lot αποσύνδεσης στο παράδειγμά μας είναι 800 €). Είναι ευνόητο ότι δεν έχει πραγματοποιηθεί άλλη αποσύνδεση από τον πελάτη και η πρώτη τοκοφόρος περίοδος έχει λήξει. Το προϊόν

εξόφλησης του τοκομεριδίου είναι άγνωστο (μη επακριβώς προσδιορισμένο). Ο φορέας πρέπει να στείλει προς το Σύστημα μια ειδοποίηση με κωδικό συναλλαγής 21 με αντισυμβαλλόμενο το φορέα “9888: ΣΥΣΤΗΜΑ – STRIPPING 1”. Την ίδια ημέρα το Σύστημα θα κάνει τις παρακάτω εγγραφές :

Λογαριασμός τίτλων χαρτοφυλακίου πελατείας του συμμετέχοντα φορέα :

Εγγραφή	Τίτλος (ISIN)	ΚΣ	Ονομαστική αξία
Χρέωση :	GR0210001930	(21)	----- 400.000
Πίστωση :	GR0928046474	(31)	----- 400.000

Λογαριασμός τίτλων χαρτοφυλακίου πελατείας “θυγατρικού” φορέα :

Εγγραφή	Τίτλος (ISIN)	ΚΣ	Μονάδες Τοκομεριδίων
Πίστωση :	GR0928045468	(31)	----- 500

8.2.1.1.2 Αποσύνδεση όλων των τοκομεριδίων (περίπτωση (β))

8.2.1.1.2.1 Ομόλογο σε ευρώ σταθερού επιτοκίου

Για να πραγματοποιηθεί η αποσύνδεση της περίπτωσης αυτής, το Σύστημα πρέπει να λάβει από το φορέα μέσα στο χρονικό όριο που αναφέρεται στην παράγραφο 8.6.1 : Ειδοποιήσεις αποσύνδεσης - επανασύνδεσης, μια ειδοποίηση “Μεταβίβασης τίτλων χωρίς ταμειακή κίνηση” (κωδικός συναλλαγής 21) με τα στοιχεία της συναλλαγής. Στο πεδίο “Θέση αποστολέα” πρέπει να αναγράφεται το γράμμα V (πωλητής). Το **ISIN του τίτλου** που θα αναφέρεται στην ειδοποίηση πρέπει να είναι **το αρχικό ISIN**. Στη θέση του αντισυμβαλλόμενου αναγράφεται ο κωδικός “9777” που αντιστοιχεί σε έναν τεχνητό φορέα “**ΣΥΣΤΗΜΑ - STRIPPING 2**”.

Το Σύστημα αναλαμβάνει όλες τις ενέργειες (δημιουργία των διπλών ειδοποιήσεων, υπολογισμό ονομαστικών αξιών, μεταφορές), ούτως ώστε **την ημερομηνία διακανονισμού (valeur) της συναλλαγής**, ο λογαριασμός τίτλων (ΙΧ ή ΧΠ) του φορέα, να χρεώνεται με την ονομαστική αξία του τίτλου από τον οποίο αποσυνδέει το τοκομερίδιο και ο ίδιος λογαριασμός τίτλων να πιστώνεται με τις αντίστοιχες ονομαστικές αξίες των παράγωγων τίτλων (με συναλλαγές που έχουν κωδικό 31), για να είναι δυνατή η διαπραγμάτευση όλων των νέων τίτλων.

Παράδειγμα αποσύνδεσης όλων των τοκομεριδίων από τριετές ομόλογο σταθερού επιτοκίου 3,455% :

Πελάτης ενός φορέα έχει τριετές ομόλογο GR0110001030 (αρχικό ISIN) ονομαστικής αξίας 500.000 ευρώ και ζητά την ίδια ημέρα την αποσύνδεση όλων των τοκομεριδίων. Η τρέχουσα τοκοφόρος περίοδος είναι η πρώτη. (Ευνόητο είναι ότι δεν έχει πραγματοποιηθεί άλλη αποσύνδεση από τον πελάτη). Ο φορέας πρέπει να στείλει προς το Σύστημα μια ειδοποίηση με κωδικό συναλλαγής 21 με αντισυμβαλλόμενο το φορέα “9777 : ΣΥΣΤΗΜΑ – STRIPPING 2”. Την ίδια ημέρα το Σύστημα θα κάνει τις παρακάτω εγγραφές :

Λογαριασμός τίτλων χαρτοφυλακίου πελατείας του συμμετέχοντα φορέα :

Εγγραφή	Τίτλος (ISIN)	ΚΣ	Ονομαστική αξία
---------	---------------	----	-----------------

Χρέωση :	GR0110001030	(21)	-----	500.000
Πίστωση :	GR0928006072	(31)	-----	500.000
Πίστωση :	GR0928001024	(31)	-----	17.275
Πίστωση :	GR0928003046	(31)	-----	17.275
Πίστωση :	GR0928005066	(31)	-----	17.275

8.2.1.1.2.2 Ομόλογο σε ευρώ κυμαινόμενου επιτοκίου

Για την αποσύνδεση της περίπτωσης αυτής (που δεν έχει ακόμα καθοριστεί το επιτόκιο των επόμενων τοκοφόρων περιόδων), οι μονάδες τοκομεριδίων των παραγώγων τίτλων που αντιστοιχούν στα τοκομερίδια των επόμενων τοκοφόρων περιόδων, θα μεταφέρονται και θα παρακολουθούνται από το Σύστημα σε ένα **“θυγατρικό” φορέα** που θα δημιουργηθεί για κάθε ένα συμμετέχοντα φορέα που θα ζητήσει αυτήν την αποσύνδεση, όπως αναφέρεται στην παράγραφο 8.2.1.1.1.2

Για να πραγματοποιηθεί η αποσύνδεση της περίπτωσης αυτής, το Σύστημα πρέπει να λάβει από το φορέα μέσα στο χρονικό όριο που αναφέρεται στην παράγραφο 8.6.1 : Ειδοποιήσεις αποσύνδεσης - επανασύνδεσης, μια ειδοποίηση “Μεταβίβασης τίτλων χωρίς ταμειακή κίνηση” (κωδικός συναλλαγής 21) με τα στοιχεία της συναλλαγής. Στο πεδίο “Θέση αποστολέα” πρέπει να αναγράφεται το γράμμα V (πωλητής). Το **ISIN του τίτλου** που θα αναφέρεται στην ειδοποίηση πρέπει να είναι **το αρχικό ISIN (ή της τρέχουσας τοκοφόρου περιόδου αν ζητά την αποσύνδεση και των υπόλοιπων τοκομεριδίων από τίτλο που έχει αποσυνδέσει το τοκομερίδιο της τρέχουσας τοκοφόρου περιόδου)**. Στη θέση του αντισυμβαλλόμενου αναγράφεται ο κωδικός **“9666”** που αντιστοιχεί σε έναν τεχνητό φορέα **“ΣΥΣΤΗΜΑ - STRIPPING 3”**.

Το Σύστημα αναλαμβάνει όλες τις ενέργειες (δημιουργία διπλών ειδοποιήσεων, υπολογισμούς, μεταφορές), ούτως ώστε **την ημερομηνία διακανονισμού (valeur) της συναλλαγής, ο λογαριασμός τίτλων (IX ή ΧΠ) του φορέα, να χρεώνεται με την ονομαστική αξία του τίτλου του οποίου αποσυνδέονται τα τοκομερίδια και να πιστώνονται οι ίδιοι λογαριασμοί τίτλων, του μεν φορέα με τις ονομαστικές αξίες του σώματος ομολόγου (χωρίς συνημμένα τοκομερίδια) και του τοκομεριδίου της τρέχουσας περιόδου (αν δεν είχε αποσυνδεθεί), του δε “θυγατρικού” του με τις μονάδες τοκομεριδίων των επόμενων τοκοφόρων περιόδων (με συναλλαγές που έχουν κωδικό 31), για να είναι δυνατή η διαπραγμάτευση τους.**

Αν ο συμμετέχων φορέας επιθυμεί να πραγματοποιήσει **συναλλαγή με τους τίτλους** που είναι καταχωρημένοι στους λογαριασμούς του “θυγατρικού” φορέα, θα πρέπει να στείλει **ειδοποίηση προς το Σύστημα** χρησιμοποιώντας τον Κ.Α. του **“θυγατρικού” φορέα**. Επίσης, και ο αντισυμβαλλόμενος φορέας (αν υπάρχει), θα πρέπει να κάνει το ίδιο. Για τους αριθμούς αποστολής των ειδοποιήσεων του “θυγατρικού” φορέα, ισχύουν τα αναφερόμενα στην παράγρ. 7.1.5 του παρόντος Κανονισμού.

Μετά το κλείσιμο του Συστήματος, θα στέλνονται στο συμμετέχοντα φορέα και τα extraits των λογαριασμών τίτλων του “θυγατρικού” του. Το περιεχόμενο των extraits αυτών είναι ενδεικτικό των συναλλαγών που πραγματοποίησαν οι φορείς με τις μονάδες των τοκομεριδίων.

Την ημερομηνία λήξης του τοκομεριδίου κάθε τρέχουσας τοκοφόρου περιόδου (όταν πλέον θα έχει καθοριστεί το επιτόκιο της επόμενης τοκοφόρου περιόδου), το Σύστημα θα διαγράφει τις συγκεκριμένες μονάδες τοκομεριδίων που απέμειναν στους λογαριασμούς τίτλων του “θυγατρικού” φορέα και θα πιστώνει - με τον ίδιο κωδικό έκδοσης (ISIN) - τους αντίστοιχους λογαριασμούς τίτλων του κύριου φορέα με ονομαστική αξία το αποτέλεσμα που προκύπτει από το διαδοχικό πολλαπλασιασμό των μονάδων τοκομεριδίων, επί το επιτόκιο και επί 1000.

Παράδειγμα αποσύνδεσης όλων των τοκομεριδίων από ομόλογο κυμαινόμενου επιτοκίου:

Πελάτης ενός φορέα έχει από το τριετές ομόλογο GR0510099733 (αρχικό ISIN-1η τοκοφόρος περίοδος) ονομαστική αξία 500.000 ευρώ και ζητά την ίδια ημέρα την αποσύνδεση **όλων των τοκομεριδίων** για το τμήμα των 100.000 ευρώ. Το επιτόκιο της τρέχουσας τοκοφόρου περιόδου είναι 5% ενώ των επόμενων είναι ακόμα άγνωστο. Ο φορέας πρέπει να στείλει προς το Σύστημα μια ειδοποίηση με κωδικό συναλλαγής 21 με αντισυμβαλλόμενο το φορέα “9666 : ΣΥΣΤΗΜΑ – STRIPPING 3”. Την ίδια ημέρα το Σύστημα θα κάνει τις παρακάτω εγγραφές :

Λογαριασμός τίτλων χαρτοφυλακίου πελατείας του συμμετέχοντα φορέα :

Εγγραφή	Τίτλος (ISIN)	ΚΣ	Ονομαστική αξία
Χρέωση :	GR0510099733	(21)	----- 100.000
Πίστωση :	GR0900654097	(31)	----- 100.000
Πίστωση :	GR0900649048	(31)	----- 5.000

Λογαριασμός τίτλων χαρτοφυλακίου πελατείας του “θυγατρικού” φορέα :

Εγγραφή	Τίτλος (ISIN)	ΚΣ	Μονάδες τοκομεριδίων
Πίστωση :	GR0900651069	(31)	----- 100
Πίστωση :	GR0900653081	(31)	----- 100

8.2.1.1.2.3 Ομόλογο “παραμετρικού” επιτοκίου

Για την αποσύνδεση της περίπτωσης αυτής (που δεν είναι προσδιορισμένο επακριβώς το προϊόν εξόφλησης των τοκομεριδίων σε ευρώ των αντίστοιχων τοκοφόρων περιόδων), οι μονάδες τοκομεριδίων των παραγώγων τίτλων που αντιστοιχούν στα τοκομερίδια όλων των τοκοφόρων περιόδων, θα μεταφέρονται και θα παρακολουθούνται από το Σύστημα σε ένα **“θυγατρικό” φορέα**, που θα δημιουργηθεί για κάθε ένα συμμετέχοντα φορέα που θα ζητήσει αυτήν την αποσύνδεση, όπως αναφέρεται στην παράγραφο 8.2.1.1.1.2.

Για να πραγματοποιηθεί η αποσύνδεση της περίπτωσης αυτής, το Σύστημα πρέπει να λάβει από το φορέα μέσα στο χρονικό όριο που αναφέρεται στην παράγραφο 8.6.1 : Ειδοποιήσεις αποσύνδεσης - επανασύνδεσης, μια ειδοποίηση “Μεταβίβασης τίτλων χωρίς ταμειακή κίνηση” (κωδικός συναλλαγής 21) με τα στοιχεία της συναλλαγής. Στο πεδίο “Θέση αποστολέα” πρέπει να αναγράφεται το γράμμα V (πωλητής). Το **ISIN του τίτλου** που θα αναφέρεται στην ειδοποίηση πρέπει να είναι **το αρχικό ISIN (ή της τρέχουσας τοκοφόρου περιόδου αν ζητά την αποσύνδεση και των υπόλοιπων τοκομεριδίων από τίτλο που έχει αποσυνδέσει το**

τοκομερίδιο της τρέχουσας τοκοφόρου περιόδου). Στη θέση του αντισυμβαλλόμενου αναγράφεται ο κωδικός **“9666”** που αντιστοιχεί σε έναν τεχνητό φορέα **“ΣΥΣΤΗΜΑ - STRIPPING 3”**.

Το Σύστημα αναλαμβάνει όλες τις ενέργειες (δημιουργία διπλών ειδοποιήσεων, υπολογισμούς, μεταφορές), ούτως ώστε **την ημερομηνία διακανονισμού (valeur) της συναλλαγής, ο λογαριασμός τίτλων (IX ή ΧΠ) του φορέα, να χρεώνεται με την ονομαστική αξία του τίτλου** του οποίου αποσυνδέονται τα τοκομερίδια και να πιστώνονται οι ίδιοι λογαριασμοί τίτλων, του μεν φορέα με την ονομαστική αξία του σώματος ομολόγου (χωρίς συνημμένα τοκομερίδια), του δε **“θυγατρικού” του με τις μονάδες τοκομεριδίων όλων των τοκοφόρων περιόδων** (με συναλλαγές που έχουν κωδικό 31), για να είναι δυνατή η διαπραγμάτευση τους.

Αν ο συμμετέχων φορέας επιθυμεί να πραγματοποιήσει **συναλλαγή με τους τίτλους** που είναι καταχωρημένοι στους λογαριασμούς του **“θυγατρικού”** φορέα, θα πρέπει να στείλει **ειδοποίηση προς το Σύστημα** χρησιμοποιώντας τον Κ.Α. του **“θυγατρικού”** φορέα. Επίσης, και ο αντισυμβαλλόμενος φορέας (αν υπάρχει) θα πρέπει να κάνει το ίδιο. Για τους αριθμούς αποστολής των ειδοποιήσεων του **“θυγατρικού”** φορέα, ισχύουν τα αναφερόμενα στην παράγρ. 7.1.5 του παρόντος Κανονισμού.

Μετά το κλείσιμο του Συστήματος, θα στέλνονται στο συμμετέχοντα φορέα και τα extraits των λογαριασμών τίτλων του **“θυγατρικού”** του. Το περιεχόμενο των extraits αυτών είναι ενδεικτικό των συναλλαγών που πραγματοποίησαν οι φορείς με τις μονάδες των τοκομεριδίων.

Μια εργάσιμη ημέρα πριν τη λήξη της εκάστοτε τρέχουσας τοκοφόρου περιόδου (όταν πλέον θα έχει καθορισθεί το **“παραμετρικό”** επιτόκιο), **το Σύστημα θα διαγράφει τις μονάδες τοκομεριδίων που αντιστοιχούν στην τρέχουσα τοκοφόρο περίοδο που απέμειναν στους λογαριασμούς τίτλων του “θυγατρικού” φορέα και θα πιστώνει - με τον ίδιο κωδικό έκδοσης (ISIN) - τους αντίστοιχους λογαριασμούς τίτλων του κύριου φορέα με ονομαστική αξία :**

- το αποτέλεσμα που προκύπτει από το διαδοχικό πολλαπλασιασμό των μονάδων τοκομεριδίων, επί το επιτόκιο και επί 1.000 στην περίπτωση των ομολόγων που η ονομαστική τους αξία εκφράζεται σε ευρώ ή
- το αποτέλεσμα που προκύπτει από το διαδοχικό πολλαπλασιασμό των μονάδων τοκομεριδίων, επί το επιτόκιο, επί τη μονάδα έκδοσης - συναλλαγής του ξένου νομίσματος, επί την καθορισθείσα ισοτιμία του συγκεκριμένου νομίσματος σε ευρώ για την πληρωμή του τοκομεριδίου, στην περίπτωση των ομολόγων με ρήτρα ξένου νομίσματος.

Παράδειγμα αποσύνδεσης όλων των τοκομεριδίων από ομόλογο “παραμετρικού” επιτοκίου :

Πελάτης ενός φορέα έχει από το πενταετές τιμαριθμοποιημένο ομόλογο GR0314001125 (αρχικό ISIN-1η τοκοφόρος περίοδος) ονομαστική αξία 500.000 ευρώ και ζητά την ίδια ημέρα την αποσύνδεση **όλων των τοκομεριδίων** για το τμήμα των 100.000 ευρώ. Το επιτόκιο όλων των τοκοφόρων περιόδων δεν είναι επακριβώς προσδιορισμένο. Ο φορέας πρέπει να στείλει προς το Σύστημα μια ειδοποίηση με κωδικό συναλλαγής 21 με αντισυμβαλλόμενο το φορέα **“9666 : ΣΥΣΤΗΜΑ – STRIPPING 3”**. Την ίδια ημέρα το Σύστημα θα κάνει τις παρακάτω εγγραφές :

Λογαριασμός τίτλων χαρτοφυλακίου πελατείας του συμμετέχοντα φορέα :

Εγγραφή	Τίτλος (ISIN)	ΚΣ	Ονομαστική αξία
Χρέωση :	GR0314001125	(21)	----- 100.000
Πίστωση :	GR0960010016	(31)	----- 100.000

Λογαριασμός τίτλων χαρτοφυλακίου πελατείας το “θυγατρικού” φορέα :

Εγγραφή	Τίτλος (ISIN)	ΚΣ	Μονάδες τοκομεριδίων
Πίστωση :	GR0960001890	(31)	----- 100
Πίστωση :	GR0960003912	(31)	----- 100
Πίστωση :	GR0960005933	(31)	-----100
Πίστωση :	GR0960007954	(31)	-----100
Πίστωση :	GR0960009976	(31)	----- 100

Οι φορείς πρέπει να ανακοινώνουν την αποσύνδεση που επιθυμούν να πραγματοποιήσουν, με μια ειδοποίηση ανά κωδικό έκδοσης (ISIN) και ανά ημέρα. Για λόγους συμφωνίας, ο φορέας αναγράφει στις ειδοποιήσεις του, σε ιδιαίτερο πεδίο, το επιτόκιο (αν είναι γνωστό) και τα ISIN των τίτλων που προκύπτουν από την αποσύνδεση.

Επίσης το Σύστημα, για να δημιουργήσει τις διπλές ειδοποιήσεις που απαιτούνται για την αποσύνδεση, θα χρησιμοποιεί για λογαριασμό των φορέων και των “θυγατρικών” τους, **αριθμούς αποστολής ειδοποιήσεων από 90000 έως 99999** και είναι ευνόητο ότι, οι παραπάνω αριθμοί αποστολής **δεν θα χρησιμοποιούνται εκ νέου** από τους φορείς.

8.3 ΣΥΝΑΛΛΑΓΕΣ ΜΕ ΤΟΥΣ ΠΑΡΑΓΩΓΟΥΣ ΤΙΤΛΟΥΣ

8.3.1 Γενικά περί συναλλαγών επί παράγωγων τίτλων

Η αποσύνδεση τοκομεριδίων μπορεί να γίνει μόνο σε υφιστάμενο υπόλοιπο στους λογαριασμούς τίτλων Ιδίου Χαρτοφυλακίου (Κ.Α. 01) και Χαρτοφυλακίου Πελατείας (Κ.Α. 100, 101, 102, 103, 11, 12), δεδομένου ότι σε περίπτωση που η αποσύνδεση αναφέρεται σε μη υπάρχον υπόλοιπο τίτλων δεν παρέχεται η δυνατότητα κάλυψης των χρεωστικών υπολοίπων. Ως εκ τούτου ολόκληρη η συναλλαγή θα ακυρωθεί από το Σύστημα.

Η ονομαστική αξία των τοκομεριδίων μπορεί να είναι οποιοσδήποτε αριθμός με δύο δεκαδικά ψηφία πλην της περίπτωσης των μονάδων τοκομεριδίων που είναι μόνο ακέραιος. Έτσι έχουμε τις παρακάτω δύο περιπτώσεις :

8.3.1.1. Συναλλαγές του συμμετέχοντα φορέα επί των παράγωγων τίτλων

Ο συμμετέχων φορέας ή ο πελάτης του μπορεί να πραγματοποιήσει, με τους παράγωγους τίτλους που αναφέρονται με ονομαστική αξία (όχι με μονάδες τοκομεριδίων) όλες τις συναλλαγές που αναφέρονται στον Κανονισμό Λειτουργίας του Συστήματος.

8.3.1.2 Συναλλαγές του “θυγατρικού” φορέα επί των παράγωγων τίτλων

Για τους “θυγατρικούς” φορείς, επιτρέπονται μόνο οι συναλλαγές αγοράς/πώλησης τίτλων (κωδικός συν/γής 10), μεταβίβασης τίτλων χωρίς ταμειακή κίνηση (κωδικός συν/γής 21) και εσωτερικής μεταβίβασης (κωδικός συν/γής 22). Δε γίνονται δεκτές από τους “θυγατρικούς” φορείς, ειδοποιήσεις με ημερομηνία διακανονισμού (valeur) συναλλαγής την ίδια ή μεταγενέστερη αυτής που μεταφέρονται οι μονάδες τοκομεριδίων από τους λογαριασμούς τίτλων τους, στους αντίστοιχους λογαριασμούς τίτλων του συμμετέχοντος φορέα.

8.4 ΕΠΑΝΑΣΥΝΔΕΣΗ ΤΟΚΟΜΕΡΙΔΙΩΝ ΟΜΟΛΟΓΩΝ

Ο συμμετέχων φορέας ή ο πελάτης του, έχει τη δυνατότητα να ζητήσει την επανασύνδεση του τοκομεριδίου, με ομόλογο που έχει συνημμένα τα υπόλοιπα τοκομερίδια ή όλων των τοκομεριδίων (για ομόλογο σε ευρώ σταθερού επιτοκίου) με το σώμα του ομολόγου χωρίς συνημμένα τοκομερίδια. Αυτό όμως δεν ισχύει όταν διανύεται η τελευταία τοκοφόρος περίοδος του τίτλου.

8.4.1 Επανασύνδεση τοκομεριδίου της τρέχουσας τοκοφόρου περιόδου ομολόγου σε ευρώ σταθερού ή κυμαινόμενου επιτοκίου

Για να πραγματοποιηθεί η επανασύνδεση της περίπτωσης αυτής, το Σύστημα πρέπει να λάβει από το φορέα μέσα στο χρονικό όριο που αναφέρεται στην παράγραφο 8.6.1 : Ειδοποιήσεις αποσύνδεσης - επανασύνδεσης, μια ειδοποίηση “Μεταβίβασης τίτλων χωρίς ταμειακή κίνηση” (κωδικός συναλλαγής 21) αναγράφοντας στο πεδίο “Θέση αποστολέα” το γράμμα V (πωλητής) και στη θέση του αντισυμβαλλόμενου τον κωδικό 9888. Το ISIN που θα αναφέρεται στην ειδοποίηση πρέπει να είναι αυτό του **σώματος ομολόγου που έχει συνημμένα τα τοκομερίδια των επόμενων τοκοφόρων περιόδων**. Για να είναι δυνατή η επανασύνδεση θα πρέπει ο φορέας να έχει στον ίδιο λογαριασμό τίτλων τόσο τον τίτλο που αντιστοιχεί στο σώμα του ομολόγου (με συνημμένα τα τοκομερίδια των επόμενων τοκοφόρων περιόδων) όσο και το αποσυνδεδεμένο τοκομερίδιο της τρέχουσας τοκοφόρου περιόδου.

Το Σύστημα αναλαμβάνει όλες τις ενέργειες (δημιουργία διπλών ειδοποιήσεων, υπολογισμούς, μεταφορές), ούτως ώστε **την ίδια μέρα να πιστώνεται το επανασυνδεδεμένο ομόλογο στο λογαριασμό τίτλων του φορέα** (με συναλλαγές που θα έχουν κωδικό 31) και να είναι δυνατή η διαπραγμάτευση του.

Παράδειγμα (ομόλογο κυμαινόμενου επιτοκίου – 2η τοκοφόρος περίοδος) :

Πελάτης ενός φορέας ζητά την επανασύνδεση του τίτλου ISIN GR0900652075 με το αποσυνδεδεμένο τοκομερίδιό του για ονομαστική αξία 1.500.000 ευρώ. Έστω ότι το επιτόκιο για την τρέχουσα τοκοφόρο περίοδο είναι 5%. Ο φορέας στέλνει προς το Σύστημα μια ειδοποίηση με κωδικό συναλλαγής 21, θέση αποστολέα V, Κ.Α. αντισυμβαλλόμενου 9888, ISIN GR0900652075 και ονομαστική αξία 1.500.000 ευρώ. Για να ολοκληρωθεί η συναλλαγή, πρέπει ο φορέας να έχει στο λογαριασμό τίτλων ΧΠ και τον τίτλο GR0900651069 (που αντιστοιχεί στο τοκομερίδιο) με ονομαστική αξία 75.000 ευρώ.

8.4.2 Επανασύνδεση όλων των τοκομεριδίων ομολόγου σε ευρώ σταθερού επιτοκίου

Για να πραγματοποιηθεί η επανασύνδεση της περίπτωσης αυτής, το Σύστημα πρέπει να λάβει από το φορέα μέσα στο χρονικό όριο που αναφέρεται στην παράγραφο 8.6.1 : Ειδοποιήσεις αποσύνδεσης – επανασύνδεσης, μια ειδοποίηση “Μεταβίβασης τίτλων χωρίς ταμειακή κίνηση”

(κωδικός συναλλαγής 21) αναγράφοντας στο πεδίο “Θέση αποστολέα” το γράμμα V (πωλητής) και στη θέση του αντισυμβαλλόμενου τον κωδικό 9777. Το ISIN που θα αναφέρεται στην ειδοποίηση πρέπει να είναι αυτό του σώματος του ομολόγου που δεν έχει συνημμένα τοκομερίδια. Για να είναι δυνατή η επανασύνδεση θα πρέπει ο φορέας να έχει στον ίδιο λογαριασμό τίτλων τόσο τον τίτλο που αντιστοιχεί στο σώμα του ομολόγου (χωρίς συνημμένα τοκομερίδια) όσο και όλα τα αποσυνδεδεμένα τοκομερίδια.

Το Σύστημα αναλαμβάνει όλες τις ενέργειες (δημιουργία των διπλών ειδοποιήσεων, μεταφορές), ούτως ώστε την ίδια μέρα να πιστώνεται το επανασυνδεδεμένο ομόλογο στο λογαριασμό τίτλων του φορέα (με συναλλαγές που θα έχουν κωδικό 31) και να είναι δυνατή η διαπραγμάτευση του.

Παράδειγμα (ομόλογο σταθερού επιτοκίου – 1η τοκοφόρος περίοδος) :

Ο συμμετέχων φορέας ζητά για το λογαριασμό τίτλων ΙΧ, την επανασύνδεση του τίτλου ISIN GR0928006072 (σώμα ομολόγου χωρίς τοκομερίδια) με τα τρία αποσυνδεδεμένα τοκομερίδια του και για ονομαστική αξία 3.000 ευρώ. Έστω ότι το επιτόκιο του ομολόγου είναι 3%. Ο φορέας στέλνει προς το Σύστημα μια ειδοποίηση με κωδικό συναλλαγής 21, θέση αποστολέα V, Κ.Α. αντισυμβαλλόμενου 9777, ISIN GR0928006072 και ονομαστική αξία 3.000 ευρώ. Για να ολοκληρωθεί η συναλλαγή, πρέπει ο φορέας να έχει στο λογαριασμό τίτλων ΙΧ και τους τίτλους με ISIN GR0928001024, GR0928003046 και GR0928005066 που αντιστοιχούν στα τρία τοκομερίδια με ονομαστική αξία 90 ευρώ έκαστο.

8.4.3 Γενικά περί επανασύνδεσης τοκομεριδίων ομολόγων

Οι φορείς πρέπει να ανακοινώνουν την επανασύνδεση που επιθυμούν να πραγματοποιήσουν, με μια ειδοποίηση ανά κωδικό έκδοσης (ISIN) και ανά ημέρα. Για λόγους συμφωνίας, ο φορέας αναγράφει στις ειδοποιήσεις του, σε ιδιαίτερο πεδίο, το επιτόκιο και τα ISIN του αρχικού ομολόγου και των τοκομεριδίων.

Επίσης το Σύστημα, για να δημιουργήσει τις διπλές ειδοποιήσεις που απαιτούνται για την επανασύνδεση, θα χρησιμοποιεί για λογαριασμό των φορέων, αριθμούς αποστολής ειδοποιήσεων από 90000 έως 99999 και είναι ευνόητο ότι, οι παραπάνω αριθμοί αποστολής δεν θα χρησιμοποιούνται εκ νέου από τους φορείς.

Η επανασύνδεση τοκομεριδίων μπορεί να γίνει μόνο σε υφιστάμενα υπόλοιπα στους λογαριασμούς τίτλων ΙΧ και ΧΠ, δεδομένου ότι σε περίπτωση που η επανασύνδεση αναφέρεται σε μη υπάρχοντα υπόλοιπα τίτλων δεν παρέχεται η δυνατότητα κάλυψης των χρεωστικών υπολοίπων. Ως εκ τούτου ολόκληρη η συναλλαγή θα ακυρωθεί από το Σύστημα.

Δεν παρέχεται τέλος, η δυνατότητα επανασύνδεσης :

α) του τοκομεριδίου της τρέχουσας τοκοφόρου περιόδου και των μονάδων τοκομεριδίων που είναι καταχωρημένες στους λογαριασμούς τίτλων των “θυγατρικών” φορέων, με το σώμα του ομολόγου (χωρίς συνημμένα τοκομερίδια), για τα ομόλογα σε ευρώ κυμαινόμενου επιτοκίου και

β) των μονάδων τοκομεριδίων όλων των τοκοφόρων περιόδων που είναι καταχωρημένες στους λογαριασμούς τίτλων των “θυγατρικών” φορέων, με το σώμα του ομολόγου (χωρίς συνημμένα τοκομερίδια), για τα ομόλογα “παραμετρικού” επιτοκίου, λόγω της πολυπλοκότητας των ενεργειών που απαιτούνται για τις διαδικασίες αυτές.

8.5 ΕΠΑΝΕΝΩΣΗ ΟΜΟΛΟΓΩΝ ΑΠΟ ΤΟ ΣΥΣΤΗΜΑ

Με τη λήξη της κάθε τοκοφόρου περιόδου, ο τίτλος που αντιστοιχεί στο σώμα του ομολόγου με συνημμένα τα τοκομερίδια των επόμενων τοκοφόρων περιόδων, διαγράφεται από το Σύστημα και η ονομαστική αξία που απέμεινε στους λογαριασμούς τίτλων του συμμετέχοντος φορέα μεταφέρεται αυτόματα - από το Σύστημα - στον αρχικό τίτλο. Η ενέργεια αυτή αποσκοπεί στο να μην εμφανίζεται στους φορείς ο ίδιος τίτλος με δύο διαφορετικά ISIN. Έτσι, κατά τη νέα τοκοφόρο περίοδο θα υπάρχει στους λογαριασμούς τίτλων μόνο το αρχικό ομόλογο και ο συμμετέχων φορέας, εφόσον πραγματοποιήσει νέα αποσύνδεση, θα μπορεί να πραγματοποιεί συναλλαγές με τους τίτλους που θα παραχθούν. Στην περίπτωση λήξης παράγωγου τίτλου (σώμα ομολόγου με τοκομερίδια), που είναι καταχωρημένος σε λογαριασμό ενεχύρου, το Σύστημα αντικαθιστά αυτόματα τον τίτλο αυτό με τον αρχικό τίτλο ίσης ονομαστικής αξίας.

8.6 ΤΕΛΕΥΤΑΙΑ ΠΡΟΘΕΣΜΙΑ ΛΗΨΗΣ (cut-off time) ΤΩΝ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΕΩΝ ΓΙΑ ΑΠΟΣΥΝΔΕΣΗ – ΕΠΑΝΑΣΥΝΔΕΣΗ ΤΟΚΟΜΕΡΙΔΙΩΝ ΟΜΟΛΟΓΩΝ ΑΠΟ ΤΟ ΣΥΣΤΗΜΑ

8.6.1 Ειδοποιήσεις αποσύνδεσης - επανασύνδεσης

Τελευταία προθεσμία λήψης των ειδοποιήσεων αποσύνδεσης ή επανασύνδεσης με τρέχουσα ημερομηνία διακανονισμού (same day value) είναι **2 ώρες πριν την λήξη του επισήμου ωραρίου συναλλαγών των Τραπεζών.**

8.6.2 Ειδοποιήσεις ακύρωσης της αποσύνδεσης - επανασύνδεσης

Τελευταία προθεσμία λήψης ειδοποίησης ακύρωσης της αποσύνδεσης ή επανασύνδεσης που έχει τρέχουσα ημερομηνία διακανονισμού είναι **1 ώρα πριν την λήξη του επισήμου ωραρίου συναλλαγών των Τραπεζών.**

Μετά την παρέλευση της παραπάνω προθεσμίας ο συμμετέχων φορέας μπορεί να επανέλθει μόνο με την αναγγελία αντιθέτων πράξεων λαμβάνοντας υπόψη τον περιορισμό του κεφ. 7.2.10.1 παρ. β).

8.7 ΤΕΛΗ ΕΠΙ ΤΩΝ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΕΩΝ ΑΠΟΣΥΝΔΕΣΗΣ – ΕΠΑΝΑΣΥΝΔΕΣΗΣ ΤΟΚΟΜΕΡΙΔΙΩΝ ΟΜΟΛΟΓΩΝ

Κάθε ειδοποίηση που αποστέλλεται από τους φορείς ή δημιουργείται από το Σύστημα για λογαριασμό τους, συνεπάγεται χρέωσή του με τα τέλη που αναφέρονται στο κεφ. 14. ΤΙΜΟΛΟΓΗΣΗ του παρόντος Κανονισμού.

9. ΤΡΟΠΟΙ ΜΕΤΑΔΟΣΗΣ ΤΩΝ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΕΩΝ ΠΡΟΣ ΤΟ ΣΥΣΤΗΜΑ

Οι συμμετέχοντες φορείς μπορούν να αποστέλλουν ειδοποιήσεις προς το Σύστημα, με τους παρακάτω τρόπους :

- α) με αποστολή σχετικού εγγράφου,
- β) με telex ή fax¹,
- γ) με swift και
- δ) με τηλεμετάδοση¹

Στις περιπτώσεις α) και β) απαιτείται η συμπλήρωση συγκεκριμένου τύπου εγγράφων, όπως τα συνημμένα υποδείγματα 3 έως 8. Για την αποστολή ειδοποιήσεων μέσω του συστήματος S.W.I.F.T. ακολουθούνται οι ειδικές οδηγίες που περιλαμβάνονται στο Παράρτημα 4 του παρόντος Κανονισμού.

¹ Με διασφαλισμένη όμως την αυθεντικότητα της ειδοποίησης, εφόσον αυτό είναι εφικτό από πλευράς αποστολέα και παραλήπτη.

10. ΩΡΑΡΙΟ ΛΕΙΤΟΥΡΓΙΑΣ ΤΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

Το άνοιγμα του Συστήματος και η έναρξη εισαγωγής ειδοποιήσεων που αποστέλλουν οι συμμετέχοντες φορείς, γίνεται ταυτόχρονα με την έναρξη του επισήμου ωραρίου συναλλαγών του Ελληνικού Τραπεζικού Συστήματος. Τελευταία προθεσμία (cut-off time) λήψης ειδοποιήσεων για συναλλαγές με τρέχουσα ημερομηνία διακανονισμού (same day value) είναι η 15:30 ώρα για όλες τις εργάσιμες ημέρες της εβδομάδας.

Εκτός ωραρίου λειτουργίας του Συστήματος (δηλαδή μετά την παρέλευση της τελευταίας προθεσμίας λήψης ειδοποιήσεων για συναλλαγές με τρέχουσα ημερομηνία διακανονισμού) γίνονται αποδεκτές ειδοποιήσεις για συναλλαγές για τις οποίες ισχύουν ιδιαίτερα ωράρια - σύμφωνα με αποφάσεις των αρμοδίων οργάνων - (π.χ. ειδοποιήσεις που αφορούν στην εξυπηρέτηση των πράξεων νομισματικής πολιτικής και παροχής ενδοημερήσιας ρευστότητας του Ευρωσυστήματος, του Συστήματος Ανταποκριτριών Κεντρικών Τραπεζών κλπ.).

11. ΕΠΕΞΕΡΓΑΣΙΑ ΤΩΝ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΕΩΝ (ΤΑΥΤΟΠΟΙΗΣΗ)

11.1 ΚΟΙΝΑ ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΤΩΝ ΔΙΠΛΩΝ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΕΩΝ

Η ταυτοποίηση των διπλών ειδοποιήσεων (ζεύγους ειδοποιήσεων που αποστέλλονται στο πλαίσιο μιας συναλλαγής) γίνεται αμέσως με την παραλαβή τους με βάση τα ακόλουθα κοινά στοιχεία για το σύνολο των συναλλαγών :

- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ
- ΘΕΣΗ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ/ΩΡΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ (VALEUR) ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ISIN ΤΩΝ ΤΙΤΛΩΝ (που αποτελούν το αντικείμενο της συναλλαγής)
- ΟΝΟΜΑΣΤΙΚΗ ΑΞΙΑ ΤΩΝ ΤΙΤΛΩΝ (που αποτελούν το αντικείμενο της συναλλαγής)

Ειδικότερα, για όλους τους τύπους των συναλλαγών επιτρέπονται διαφορές :

- Ως προς την αξία διακανονισμού ύψους μέχρι και 3 ευρώ. Σε τέτοια περίπτωση, το Σύστημα χρησιμοποιεί στις εγγραφές το μικρότερο ποσό.
- Ως προς την ώρα διακανονισμού μέχρι και 30 λεπτά της ώρας. Για το διακανονισμό της συναλλαγής θα λαμβάνεται υπόψη η μεταγενέστερη ώρα.

11.2 ΙΔΙΑΙΤΕΡΑ ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΑΝΑ ΤΥΠΟ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ

Επιπλέον, πρέπει να είναι κοινά τα ακόλουθα στοιχεία ανά τύπο συναλλαγής :

11.2.1 Αγορά/πώληση τίτλων

- ΑΞΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ

11.2.2 Repos επί τίτλων

- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ/ΩΡΑ ΛΗΞΗΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ
- ΑΞΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ
- ΑΞΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ ΣΤΗ ΛΗΞΗ

11.2.3 Buy / Sell back τίτλων

- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ/ΩΡΑ ΛΗΞΗΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ
- ΑΞΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ
- ΑΞΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ ΣΤΗ ΛΗΞΗ

11.2.4 Πράξεις περιθωρίου

- ΕΤΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ ΑΡΧΙΚΗΣ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΗΣ
- ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ ΑΡΧΙΚΗΣ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΗΣ
- ΑΞΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ ΣΤΗΝ ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ VALEUR
- ΚΑΤΕΥΘΥΝΣΗ ΛΟΓΙΣΤΙΚΟΠΟΙΗΣΗΣ
- ΑΞΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ ΣΤΗΝ ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΛΗΞΗΣ
- ΚΑΤΕΥΘΥΝΣΗ ΛΟΓΙΣΤΙΚΟΠΟΙΗΣΗΣ

11.2.5 Swap επί τίτλων

- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ/ΩΡΑ ΛΗΞΗΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ
- ΚΩΔΙΚΟΣ ISIN ΠΑΡΑΛΗΦΘΕΝΤΩΝ ΤΙΤΛΩΝ (από τον αντισυμβαλλόμενο)
- ΟΝΟΜΑΣΤΙΚΗ ΑΞΙΑ ΠΑΡΑΛΗΦΘΕΝΤΩΝ ΤΙΤΛΩΝ (από τον αντισυμβαλλόμενο)
- ΚΑΤΑΒΛΗΤΕΟ ΠΟΣΟ ΣΕ ΕΥΡΩ

11.2.6 Απλό δάνειο τίτλων

- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ/ΩΡΑ ΛΗΞΗΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ (του δανείου)
- ΚΑΤΑΒΑΛΛΟΜΕΝΟΣ ΤΟΚΟΣ
- ΠΟΣΟ ΣΕ ΕΥΡΩ ή ΒΑΣΗ ΥΠΟΛΟΓΙΣΜΟΥ και ΕΠΙΤΟΚΙΟ

11.2.7 Δάνειο τίτλων έναντι ενεχύρου

- ΚΩΔΙΚΟΣ ISIN ΕΝΕΧΥΡΑΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΟΝΟΜΑΣΤΙΚΗ ΑΞΙΑ ΕΝΕΧΥΡΑΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ
- ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ/ΩΡΑ ΛΗΞΗΣ ΤΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΗΣ (του δανείου)
- ΚΑΤΑΒΑΛΛΟΜΕΝΟΣ ΤΟΚΟΣ
- ΠΟΣΟ ΣΕ ΕΥΡΩ ή ΒΑΣΗ ΥΠΟΛΟΓΙΣΜΟΥ και ΕΠΙΤΟΚΙΟ

11.2.8 Ειδικές περιπτώσεις ειδοποιήσεων

Η ειδοποίηση “Εσωτερική μεταβίβαση” (Κ. Σ. 22) δεν απαιτεί διπλή ειδοποίηση (Κεφάλαιο 7 : ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΤΩΝ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΕΩΝ ΚΑΙ ΕΙΔΗ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ εδ.2.3). Επίσης, το Σύστημα δημιουργεί αυτόματα τις απαιτούμενες διπλές (ταυτοποιούμενες) ειδοποιήσεις για τα προθεσμιακά σκέλη συναλλαγών (repos, δάνεια κλπ.).

11.3 ΣΥΝΑΛΛΑΓΕΣ ΤΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

11.3.1 Συναλλαγές του Συστήματος προς διακανονισμό

Δύο ταυτοποιημένες (ταυτιζόμενες ως προς τα στοιχεία τους) ειδοποιήσεις δημιουργούν συναλλαγή του Συστήματος, που καταχωρείται σ’αυτό και φέρεται προς εκκαθάριση και διακανονισμό. Οι συναλλαγές του Συστήματος λαμβάνουν αύξουσα αρίθμηση κατά ημερομηνία διακανονισμού (valeur) της συναλλαγής και χρόνο ταυτοποίησης.

Όταν η ημερομηνία διακανονισμού συναλλαγής συμπίπτει με την τρέχουσα ημερομηνία διακανονισμού του Συστήματος (same day value), η συναλλαγή αυτή εξετάζεται και διακανονίζεται άμεσα¹ εκτός και αν αναγράφει ως ώρα διακανονισμού ώρα μεταγενέστερη από εκείνη της καταχώρησης στο Σύστημα της συναλλαγής, οπότε θα εξεταστεί τη συγκεκριμένη ώρα.

Στην περίπτωση που, κατά τη χρονική στιγμή καταχώρησης στο Σύστημα της συναλλαγής, έχει ενεργοποιηθεί διαδικασία συμψηφιστικού κύκλου πολυμερούς διακανονισμού, τότε η συναλλαγή εξετάζεται αμέσως μετά τη λήξη της διαδικασίας αυτής.

¹ Εφόσον πληρούνται οι συνθήκες για το διακανονισμό της (επαρκές υπόλοιπο στον αντίστοιχο λογαριασμό τίτλων και επαρκές υπόλοιπο στον τρεχούμενο λογαριασμό ταμειακής διαχείρισης σε ευρώ ή λογαριασμό καταθέσεων σε ευρώ)

11.3.2 Συναλλαγές του Συστήματος “σε κατάσταση αναμονής προς διακανονισμό”

Σε κατάσταση αναμονής προς διακανονισμό θεωρούνται οι συναλλαγές του Συστήματος ως προς τις οποίες δεν έχει γίνει ακόμη προσπάθεια διακανονισμού. Αν κατά τη χρονική στιγμή καταχώρησης συναλλαγής στο Σύστημα αυτό εξετάζει άλλη ή άλλες συναλλαγές σε αναμονή, ιδίως σε περίπτωση που αυτές έχουν καταχωρηθεί προγενέστερα στο Σύστημα, η συναλλαγή τίθεται σε κατάσταση αναμονής προς διακανονισμό και εξετάζεται μόλις έρθει η σειρά της. Η κατάταξη των συναλλαγών στην κατάσταση αναμονής προς διακανονισμό, γίνεται με βάση τα κριτήρια προτεραιότητας (εδ. 11.3.5) και, κατόπιν, με την αύξουσα αρίθμησή τους.

11.3.3 Συναλλαγές του Συστήματος σε εκκρεμότητα

Συναλλαγή ως προς την οποία έχει γίνει έστω και μία προσπάθεια διακανονισμού, η οποία απέτυχε, μεταπίπτει σε “συναλλαγή του Συστήματος σε εκκρεμότητα”. Οι συναλλαγές σε εκκρεμότητα επανακατατάσσονται κατά την αύξουσα αρίθμησή τους χάνοντας οποιαδήποτε προτεραιότητα είχαν από κριτήρια προτεραιότητας και εξετάζονται σύμφωνα με την κατάταξη αυτή¹. Αν κατά το ημερήσιο κλείσιμο του Συστήματος υπάρχουν συναλλαγές σε εκκρεμότητα, οι συναλλαγές αυτές δεν ισχύουν πλέον ως προς το Σύστημα .

11.3.4 Συναλλαγές με μελλοντικές ημερομηνίες (και ώρες) διακανονισμού

Αν συναλλαγές του Συστήματος φέρουν μελλοντική ημερομηνία (ή/και ώρα) διακανονισμού σε σχέση με την ημερομηνία (ή/και ώρα) καταχώρησης της συναλλαγής, κατατάσσονται σε σειρά κατά την προτεραιότητά τους (εάν εμπίπτουν στα κριτήρια προτεραιότητας), καθώς και κατά την αύξουσα αρίθμησή τους και θα εξεταστούν και διακανονιστούν τις συγκεκριμένες ημερομηνίες (ή/και ώρες).

11.3.5 Κριτήρια προτεραιότητας

Λόγω της ιδιαιτερότητας που παρουσιάζουν ορισμένες συναλλαγές, ο διακανονισμός τους γίνεται με απόλυτη προτεραιότητα. Το εν λόγω κριτήριο προτεραιότητας ισχύει στις παρακάτω περιπτώσεις συναλλαγών

- α. συναλλαγές που διενεργούνται ή/και διακανονίζονται μέσω του Συστήματος Ανταποκριτριών Κεντρικών Τραπεζών (CCBM),
- β. συναλλαγές παροχής ή επιστροφής ενδοημερήσιας ρευστότητας, στο πλαίσιο λειτουργίας του Συστήματος TARGET2-GR,
- γ. συναλλαγές στις οποίες αντισυμβαλλόμενος είναι η Ευρωπαϊκή Κεντρική Τράπεζα (ΕΚΤ),
- δ. συναλλαγές στις οποίες αντισυμβαλλόμενος είναι η Τράπεζα της Ελλάδος,
- ε. συναλλαγές Πρωτογενούς Αγοράς,
- στ. συναλλαγές παρεμφερείς με τις ανωτέρω, τις οποίες θα καθορίζει η Τράπεζα της Ελλάδος, ενημερώνοντας προηγουμένως όλους τους συμμετέχοντες φορείς.

¹ Εξαιρούνται οι συναλλαγές του Συστήματος Ανταποκριτριών Κεντρικών Τραπεζών – Corespondent Central Banking Model (CCBM) που δε χάνουν την προτεραιότητά τους.

12. ΗΜΕΡΗΣΙΑ ΔΙΑΔΙΚΑΣΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ ΤΩΝ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ ΤΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

12.1 ΓΕΝΙΚΑ

12.1.1 ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΣ ΤΩΝ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ ΤΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ ΜΕ ΤΡΕΧΟΥΣΑ ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ (VALEUR) ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ

Ο διακανονισμός συναλλαγών του Συστήματος, με οποιαδήποτε διαδικασία πραγματοποιηθεί, είναι οριστικός και ανέκκλητος. Η ενεργοποίηση μίας διαδικασίας διακανονισμού προϋποθέτει την παύση ή τη διακοπή άλλων διαδικασιών διακανονισμού. Ο Διαχειριστής του Συστήματος διατηρεί το δικαίωμα να ενεργοποιήσει πολλές φορές μία διαδικασία διακανονισμού κατά τη διάρκεια της ημέρας, με σκοπό τη βελτιστοποίηση της λειτουργίας του ή/και την απεμπλοκή συναλλαγών. Επίσης, ο Διαχειριστής του Συστήματος διατηρεί το δικαίωμα να διακανονίζει συναλλαγές μεμονωμένα ή να εξαιρεί ορισμένες συναλλαγές από μία διαδικασία διακανονισμού, εάν θεωρεί ότι αυτό μπορεί να εξυπηρετήσει τις ανάγκες της εύρυθμης λειτουργίας του Συστήματος.

Οι συμμετέχοντες φορείς υποχρεούνται να λαμβάνουν κάθε απαραίτητο μέτρο, ώστε να συντρέχουν οι προϋποθέσεις ομαλού και προσήκοντος διακανονισμού κάθε συναλλαγής που εισάγεται στο Σύστημα προς διακανονισμό. Ενδεικτικώς, δεν επιτρέπεται να εισάγουν στο Σύστημα συναλλαγές, όταν δεν υφίσταται βεβαιότητα ότι κατά την εκκαθάριση και το διακανονισμό τους θα υφίστανται οι προς παράδοση τίτλοι ή τα οφειλόμενα συνεπεία της συναλλαγής χρηματικά ποσά, κατά περίπτωση.

12.1.2 ΤΡΟΠΟΣ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ ΤΩΝ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ

Βασικός τρόπος διακανονισμού των συναλλαγών είναι η διαδικασία του διακανονισμού τους μία προς μία σε συνεχή χρόνο, καθόλη τη διάρκεια της ενδοημερήσιας λειτουργίας του Συστήματος. Η διαδικασία αυτή περιγράφεται στο εδάφιο 12.3. Συνεχίζεται καθόλη τη διάρκεια της ημερήσιας λειτουργίας του Συστήματος και αδρανοποιείται προσωρινά (Σύστημα σε προσωρινή αδράνεια) μόνον εάν δεν καταχωρούνται νέες συναλλαγές στο Σύστημα ή αν ο Διαχειριστής του Συστήματος κρίνει ότι, για την εύρυθμη λειτουργία του Συστήματος, πρέπει να ενεργοποιηθούν άλλοι τρόποι διακανονισμού. Οι άλλοι τρόποι διακανονισμού των συναλλαγών περιγράφονται στο εδάφιο 12.4.

Εάν το Σύστημα βρίσκεται σε κατάσταση προσωρινής αδράνειας και καταχωρηθεί σ' αυτό συναλλαγή, τότε το Σύστημα ενεργοποιείται εκ νέου και εξετάζει τη συναλλαγή αυτή. Εάν η συναλλαγή αυτή διακανονιστεί, τότε εξετάζει εξ αρχής όλες τις εκκρεμείς συναλλαγές κατά τη σειρά της αύξουσας αρίθμησης τους. Εάν η συναλλαγή αυτή δε διακανονιστεί, τότε το Σύστημα επανέρχεται στην κατάσταση της προσωρινής αδράνειας.

Η εκ νέου ενεργοποίηση του Συστήματος από την προσωρινή αδράνεια, μπορεί να γίνει και με πρωτοβουλία του Διαχειριστή, οπότε και επανεξετάζονται προς διακανονισμό -κατά τη σειρά της αύξουσας αρίθμησης τους- όλες οι εκκρεμείς συναλλαγές που τυχόν υπάρχουν.

12.2 ΕΝΕΡΓΕΙΕΣ ΠΟΥ ΠΡΑΓΜΑΤΟΠΟΙΟΥΝΤΑΙ ΑΥΤΟΜΑΤΑ ΚΑΙ ΑΜΕΣΑ ΜΕ ΤΟ ΑΝΟΙΓΜΑ ΤΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

Με το άνοιγμα του Συστήματος γίνονται κατά σειρά τα εξής :

- Διακανονίζονται τοκομερίδια που πληρώνονται ή/και τίτλοι που λήγουν τη συγκεκριμένη ημέρα.
- Επανεנώνονται οι “παράγωγοι” τίτλοι με τους αρχικούς (Κεφάλαιο 8 : ΑΠΟΣΥΝΔΕΣΗ – ΕΠΑΝΑΣΥΝΔΕΣΗ ΤΟΚΟΜΕΡΙΔΙΩΝ ΟΜΟΛΟΓΩΝ ΚΑΙ ΣΥΝΑΛΛΑΓΕΣ ΕΠΙ ΑΥΤΩΝ εδ. 8.5 Επανεένωση ομολόγων από το Σύστημα).
- Ενεργοποιείται η διαδικασία συμψηφιστικού κύκλου πολυμερούς διακανονισμού κατά τη διάρκεια της ημέρας για το διακανονισμό συναλλαγών του Συστήματος που τυχόν είναι σε αναμονή με τρέχουσα ημερομηνία διακανονισμού (same day value). Η διαδικασία περιγράφεται στο εδάφιο 12.4.β
- Ενεργοποιείται η διαδικασία διακανονισμού των συναλλαγών του Συστήματος μία προς μία σε συνεχή χρόνο.

12.3 ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΣ ΤΩΝ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ ΤΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ ΜΙΑ ΠΡΟΣ ΜΙΑ ΣΕ ΣΥΝΕΧΗ ΧΡΟΝΟ

Η διαδικασία διακανονισμού των συναλλαγών του Συστήματος μία προς μία σε συνεχή χρόνο συνίσταται στα εξής :

- Συναλλαγές χωρίς ταμειακό σκέλος (π.χ. εσωτερική μεταβίβαση, ενεχύραση κλπ.)

Εξετάζεται αν η συναλλαγή δύναται να διακανονισθεί με βάση το τρέχον υπόλοιπο του λογαριασμού τίτλων του φορέα που παραδίδει τους τίτλους (πωλητή/εκκαθαριστή για τις ανάγκες του διακανονισμού των συναλλαγών του Συστήματος) και, εφόσον αυτό ισχύει, **οι τίτλοι αφαιρούνται από το λογαριασμό τίτλων του** (με χρέωση του λογαριασμού τίτλων) **και μεταφέρονται στον αντίστοιχο λογαριασμό τίτλων** του φορέα που λαμβάνει τους τίτλους (πίστωση του λογαριασμού τίτλων του αγοραστή/εκκαθαριστή για τις ανάγκες του διακανονισμού των συναλλαγών του Συστήματος).

Εάν η συναλλαγή δεν δύναται να διακανονισθεί βάσει του τρέχοντος υπολοίπου του λογαριασμού του φορέα που παραδίδει τους τίτλους, παραμένει σε εκκρεμότητα για να διακανονιστεί αργότερα (εντός της ημέρας) χάνοντας οποιαδήποτε προτεραιότητα από κριτήριο προτεραιότητας¹.

¹ Εξαιρούνται οι συναλλαγές του Συστήματος Ανταποκριτριών Κεντρικών Τραπεζών – Correspondent Central Banking Model (CCBM) που δε χάνουν την προτεραιότητά τους

- **Συναλλαγές με ταμειακό σκέλος** (π.χ. αγορά/πώληση, repos κλπ.)

Το Σύστημα εξετάζει αν η συναλλαγή δύναται να διακανονισθεί βάσει του τρέχοντος υπολοίπου του λογαριασμού τίτλων του φορέα που παραδίδει τους τίτλους (πωλητή/εκκαθαριστή της συναλλαγής πώλησης). Εάν η συναλλαγή δεν δύναται να διακανονισθεί βάσει του τρέχοντος υπολοίπου του λογαριασμού του φορέα που παραδίδει τους τίτλους, παραμένει σε εκκρεμότητα για να διακανονιστεί αργότερα (εντός της ημέρας) χάνοντας οποιαδήποτε προτεραιότητα τυχόν είχε από κριτήριο προτεραιότητας¹.

Εάν ο διακανονισμός είναι δυνατός ως προς το σκέλος των τίτλων, οι τίτλοι αφαιρούνται από το υπόλοιπο του λογαριασμού τίτλων του φορέα που παραδίδει τους τίτλους και δεσμεύονται προσωρινά. Στη συνέχεια, το Σύστημα εξετάζει αν η συναλλαγή δύναται να διακανονισθεί και ως προς το χρηματικό-ταμειακό σκέλος και, εφόσον ο διακανονισμός είναι δυνατός, γίνονται οριστικές εγγραφές τόσο στους λογαριασμούς τίτλων, όσο και στους ταμειακούς λογαριασμούς των συναλλασσομένων φορέων.

Εάν η συναλλαγή δεν δύναται να διακανονισθεί βάσει του τρέχοντος υπολοίπου τρεχούμενου λογαριασμού ταμειακής διαχείρισης σε ευρώ ή λογαριασμού καταθέσεων σε ευρώ του φορέα που οφείλει το τίμημα (αγοραστή για τις ανάγκες της εκκαθάρισης), οι τίτλοι αποδεσμεύονται και προστίθενται εκ νέου στο λογαριασμό του παραδίδοντος τους τίτλους. Η συγκεκριμένη συναλλαγή παραμένει σε εκκρεμότητα χάνοντας οποιαδήποτε προτεραιότητα τυχόν είχε από κριτήριο προτεραιότητας¹.

12.4 ΑΛΛΟΙ ΤΡΟΠΟΙ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ ΤΩΝ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ ΤΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

Πέραν της διαδικασίας διακανονισμού των συναλλαγών μία προς μία σε συνεχή χρόνο, οι συναλλαγές του Συστήματος μπορούν να διακανονιστούν και με τις παρακάτω μεθόδους:

α) μία προς μία (για τις συναλλαγές σε εκκρεμότητα)

Εάν το Σύστημα βρίσκεται σε προσωρινή αδράνεια και υπάρχουν συναλλαγές σε εκκρεμότητα, τότε ο Διαχειριστής του Συστήματος μπορεί να ενεργοποιήσει εκ νέου το Σύστημα για να επανεξετάσει τη δυνατότητα διακανονισμού των συναλλαγών αυτών με τη διαδικασία του διακανονισμού των μία προς μία. Η διαδικασία αυτή είναι εκείνη που περιγράφεται στο εδάφιο 12.3.

Εάν κατά τη διάρκεια εξέτασης εκκρεμούς συναλλαγής καταχωρηθεί στο Σύστημα νέα συναλλαγή, τότε το Σύστημα - αφού ολοκληρώσει την εξέτασή της εκκρεμούς συναλλαγής - εξετάζει αμέσως μετά τη νέα συναλλαγή και, εν συνεχεία, εξετάζει εκ νέου όλες τις εκκρεμείς συναλλαγές που απέμειναν κ.ο.κ.

β) στο πλαίσιο κύκλων πολυμερών συμψηφιστικών διακανονισμών :

- κατά τη διάρκεια της ημέρας
- στο τέλος της ημέρας

¹ Εξαιρούνται οι συναλλαγές του Συστήματος Ανταποκριτριών Κεντρικών Τραπεζών – Correspondent Central Banking Model (CCBM) που δε χάνουν την προτεραιότητά τους.

Με τη μέθοδο αυτή διακανονίζονται όλες οι **συναλλαγές που είναι σε αναμονή ή εκκρεμότητα** την ώρα ενεργοποίησης του κάθε κύκλου πολυμερούς συμψηφιστικού διακανονισμού, συμπεριλαμβανομένων των συναλλαγών για τις οποίες : α) έχει συμφωνηθεί από τους φορείς ώρα διακανονισμού, β) δεν έχει γίνει γι' αυτές άλλη προσπάθεια διακανονισμού και γ) έχει παρέλθει η συμφωνηθείσα ώρα διακανονισμού. **Η σειρά κατάταξης των συναλλαγών στη σειρά αναμονής, προκειμένου να εξετασθεί αν πληρούνται οι προϋποθέσεις διακανονισμού, προς πραγματοποίησή του, εξαρτάται από την προτεραιότητά τους (για τις συναλλαγές σε αναμονή) και την αύξουσα αρίθμησή τους.** Εάν καταχωρηθούν στο Σύστημα μία ή περισσότερες συναλλαγές καθόν χρόνο στο Σύστημα έχει ξεκινήσει κύκλος πολυμερούς συμψηφιστικού διακανονισμού που δεν έχει ακόμη ολοκληρωθεί, αφού το Σύστημα θα ολοκληρώσει τη διαδικασία επεξεργασίας και διακανονισμού των συναλλαγών του τρέχοντος κύκλου, αμέσως μετά θα εξετάσει τις νέες συναλλαγές.

12.4.1 Κύκλος πολυμερούς συμψηφιστικού διακανονισμού κατά τη διάρκεια της ημέρας

Σκέλος τίτλων

Λαμβάνοντας υπόψη τα υπόλοιπα των λογαριασμών τίτλων των φορέων που υπέχουν – βάσει της συναλλαγής του Συστήματος – υποχρέωση παράδοσης τίτλων, όπως αυτά έχουν διαμορφωθεί από το διακανονισμό των συναλλαγών μέχρι τη στιγμή έναρξης ενεργοποίησης του κύκλου, εξετάζεται, με τη **διαδικασία του πολυμερούς συμψηφισμού, αν πληρούνται οι όροι διακανονισμού των συναλλαγών που αποτελούν αντικείμενο επεξεργασίας στο συγκεκριμένο κύκλο, με βάση τα τρέχοντα υπόλοιπα των λογαριασμών τίτλων των φορέων που παραδίδουν τους τίτλους.** Σε περίπτωση που δεν πληρούνται οι όροι διακανονισμού με βάση τα τρέχοντα υπόλοιπα για όλες τις εξεταζόμενες συναλλαγές, **αφαιρούνται οι τελευταίες συναλλαγές κατά τη σειρά κατάταξής τους. Εάν οι συναλλαγές που απέμειναν :**

- **δεν έχουν ταμειακό σκέλος, τότε γίνονται οριστικές εγγραφές** (χρεώσεις και πιστώσεις των λογαριασμών τίτλων των φορέων) **ανά συναλλαγή,**
- **έχουν και ταμειακό σκέλος, τότε αφαιρούνται από τα υπόλοιπα των λογαριασμών τίτλων τα συνολικά ποσά των προς παράδοση τίτλων** των συναλλαγών που πληρούν το εν λόγω σκέλος (σκέλος τίτλων) των όρων διακανονισμού, **δεσμεύονται αυτοί οι τίτλοι προσωρινά και εξετάζεται το ταμειακό σκέλος.**

Σημείωση : Οι συναλλαγές που αφαιρούνται επειδή δεν πληρούνται οι όροι διακανονισμού τους, κατά τα ανωτέρω, παραμένουν σε εκκρεμότητα για μεταγενέστερο διακανονισμό (είτε με τη μέθοδο διακανονισμού των συναλλαγών μία προς μία είτε με τη μέθοδο των κύκλων), χάνοντας οποιαδήποτε προτεραιότητα τυχόν είχαν από κριτήριο προτεραιότητας ².

² Εξαιρούνται οι συναλλαγές του Συστήματος Ανταποκριτριών Κεντρικών Τραπεζών – Correspondent Central Banking Model (CCBM) που δε χάνουν την προτεραιότητά τους.

Ταμειακό σκέλος

Εξετάζονται τα τρέχοντα υπόλοιπα των τρεχούμενων λογαριασμών ταμειακής διαχείρισης σε ευρώ ή λογαριασμών καταθέσεων σε ευρώ των φορέων που υπέχουν υποχρέωση πληρωμής ως προς τις συναλλαγές που πληρούν τους όρους διακανονισμού του σκέλους τίτλων και ως προς τις οποίες έχουν δεσμευτεί προσωρινά οι τίτλοι που αποτελούν αντικείμενο της συναλλαγής. Εάν τα τρέχοντα υπόλοιπα είναι επαρκή για να διακανονιστούν οι συναλλαγές, τότε γίνονται οριστικές εγγραφές (τόσο στους λογαριασμούς τίτλων όσο και στους ταμειακούς λογαριασμούς) ανά συναλλαγή για το σκέλος των τίτλων και συνολικά για το ταμειακό σκέλος. Εάν δεν είναι επαρκή έστω και για έναν φορέα, τότε δε διακανονίζεται καμία συναλλαγή, αποδεσμεύονται οι τίτλοι, προστίθενται εκ νέου στους λογαριασμούς τίτλων των φορέων και οι συναλλαγές παραμένουν σε εκκρεμότητα για να διακανονιστούν αργότερα, εντός της ημέρας (είτε με τη μέθοδο διακανονισμού των συναλλαγών μία προς μία είτε με τη μέθοδο των κύκλων), χάνοντας οποιαδήποτε προτεραιότητα τυχόν είχαν από κριτήριο προτεραιότητας².

12.4.2 Συμψηφιστικός κύκλος πολυμερούς διακανονισμού στο τέλος της ημέρας

Μετά την τελευταία προθεσμία (cut-off time) λήψης ειδοποιήσεων για συναλλαγές με τρέχουσα ημερομηνία διακανονισμού (same day value) και εφόσον αυτό απαιτείται, δηλαδή εάν παραμένουν συναλλαγές σε εκκρεμότητα που δεν ικανοποιούνται με άλλους τρόπους διακανονισμού, **ενεργοποιείται ο τελικός συμψηφιστικός κύκλος πολυμερούς διακανονισμού** που περιλαμβάνει την παρακάτω διαδικασία:

Σκέλος τίτλων

Λαμβάνοντας υπόψη τα υπόλοιπα των λογαριασμών τίτλων των φορέων που υπέχουν – βάσει της συναλλαγής του Συστήματος – υποχρέωση παράδοσης τίτλων, όπως αυτά έχουν διαμορφωθεί από το διακανονισμό των συναλλαγών μέχρι τη στιγμή έναρξης ενεργοποίησης του κύκλου, εξετάζεται, με τη **διαδικασία του πολυμερούς συμψηφισμού, αν πληρούνται οι όροι διακανονισμού των συναλλαγών που αποτελούν αντικείμενο επεξεργασίας στο συγκεκριμένο κύκλο, με βάση τα τρέχοντα υπόλοιπα των λογαριασμών τίτλων των φορέων που παραδίδουν τους τίτλους.** Σε περίπτωση που δεν πληρούνται οι όροι διακανονισμού κατά τα ανωτέρω, ο Διαχειριστής του Συστήματος συνεχίζει με τη διαδικασία κάλυψης χρεωστικών ή ανοικτών θέσεων.

Κάλυψη χρεωστικών ή ανοικτών θέσεων σε τίτλους

Σε περίπτωση ύπαρξης χρεωστικών θέσεων σε λογαριασμούς τίτλων, ειδοποιούνται αμέσως οι συμμετέχοντες φορείς για την τακτοποίησή τους το συντομότερο δυνατόν. Για το λόγο αυτό, κατά το χρονικό διάστημα από την 15:30 έως και την 16:00 ώρα γίνονται δεκτές από το Σύστημα μόνο ειδοποιήσεις που αφορούν στην τακτοποίηση αυτή.

Εάν παραμένουν χρεωστικές θέσεις, τότε από την 16:30 έως και την 16:45 ώρα διενεργείται από το Διαχειριστή του Συστήματος, μέσω της Ηλεκτρονικής Δευτερογενούς Αγοράς Τίτλων (ΗΔΑΤ), δημοπρασία για αγορά τίτλων αξίας ισόποσης της διαπιστωθείσας χρεωστικής θέσης μέσω συναλλαγών “buy/sell back” διάρκειας overnight (O/N), μόνο εφ’ όσον ο φορέας που παρουσιάζει τη χρεωστική θέση το επιθυμεί. Η προθεσμία αναγγελίας του αιτήματος για τη συμμετοχή στην Δημοπρασία θα είναι μέχρι την 16:20 ώρα.

² Εξαιρούνται οι συναλλαγές του Συστήματος Ανταποκριτριών Κεντρικών Τραπεζών – Correspondent Central Banking Model (CCBM) που δε χάνουν την προτεραιότητά τους.

Για τη διενέργεια παρόμοιου τύπου δημοπρασίας, μπορεί να υποβάλλει αίτημα και οποιοσδήποτε συμμετέχων φορέας που δεν παρουσιάζει χρεωστική θέση κατά το κλείσιμο του Συστήματος, αλλά επιθυμεί να καλύψει ανοικτή θέση λόγω μη έγκαιρης παράδοσης τίτλων για προσυμφωνημένες συναλλαγές που πραγματοποίησε με αντισυμβαλλομένους του και μπορούν να αποδειχθούν από σχετικά παραστατικά.

Στις συναλλαγές που προκύπτουν ως αποτέλεσμα της δημοπρασίας ο φορέας ή οι φορείς που παρουσιάζουν χρεωστική θέση ή επιθυμούν να καλύψουν ανοικτή θέση συμβάλλονται με το φορέα ή τους φορείς που υποβάλλουν τις καλύτερες προσφορές.

Η τιμή των προσφορών (διαμορφούμενη βάσει επιτοκίου) δεν μπορεί να είναι δυσμενέστερη για τον λαμβάνοντα τους τίτλους από το αντίστοιχο Lombard της ημέρας μείον 10 εκατοστιαίες μονάδες.

Η δημοπρασία ολοκληρώνεται και εξάγονται τα αποτελέσματά της 75 λεπτά της ώρας από τη λήξη της τελευταίας προθεσμίας λήψης ειδοποιήσεων για συναλλαγές με τρέχουσα ημερομηνία διακανονισμού. Η κατάταξη των προσφορών γίνεται με φθίνουσα σειρά. Ως τιμή δημοπρασίας λαμβάνεται η τιμή της τελευταίας προσφοράς που προκύπτει από την κατάταξη αυτή και συνεχίζεται η επιλογή προσφορών με βάση την κατά τα ανωτέρω σειρά κατάταξης τους, έως ότου συμπληρωθεί το ποσό τίτλων της δημοπρασίας. Σε περίπτωση που το προσφερόμενο από όλους τους συμμετέχοντες στη δημοπρασία ποσό τίτλων είναι μικρότερο του αναζητούμενου μέσω της δημοπρασίας, τότε ο Διαχειριστής του Συστήματος προχωρεί στην κάλυψη των εκκρεμών συναλλαγών που δημιουργήσαν τη χρεωστική θέση κατά τη σειρά ταυτοποίησής τους, στο μέτρο που το εκάστοτε εναπομένον υπόλοιπο από τη διαδοχική κάλυψη των συναλλαγών επαρκεί για να καλύψει μία ολόκληρη συναλλαγή, αλλιώς προχωρεί στην κάλυψη της επόμενης συναλλαγής. Στη συνέχεια -και εφόσον επαρκεί το υπόλοιπο τίτλων που προσφέρθηκαν στη δημοπρασία- ο Διαχειριστής προχωρεί, με την ίδια μεθοδολογία στην κάλυψη και των ανοικτών θέσεων κατά τη σειρά αναγγελίας των αντιστοίχων ειδοποιήσεων στο Σύστημα. Αν μετά την εξάντληση του προσφερόμενου στη δημοπρασία ποσού τίτλων παραμένουν προς κάλυψη χρεωστικές ή/και ανοικτές θέσεις, ο Διαχειριστής καταβάλλει προσπάθεια να επιδιώξει την κάλυψή τους με άλλο τρόπο, που κρίνει πρόσφορο, χωρίς όμως να υπέχει υποχρέωση για την επίτευξη του σκοπού αυτού. Σε περίπτωση που από τις ενέργειες του Διαχειριστή ικανοποιηθούν ολικά ή μερικά οι υπόλοιπες χρεωστικές ή ανοικτές θέσεις, η τιμή ικανοποίησης αυτών δεν μπορεί να είναι ευμενέστερη της τιμής που καθορίστηκε με τη διαδικασία της δημοπρασίας, δύναται όμως αυτή να είναι δυσμενέστερη.

Οι συναλλαγές που καταρτίζονται είτε στο πλαίσιο της δημοπρασίας είτε με τις ενέργειες του Διαχειριστή καταχωρούνται αυτόματα στο Σύστημα και ταυτόχρονα ενημερώνονται σχετικά οι αντισυμβαλλόμενοι (ως τοιούτων νοουμένων των φορέων που είναι υπεύθυνοι για το διακανονισμό των σχετικών συναλλαγών).

Εξυπακούεται ότι στις περιπτώσεις που οι χρεωστικές θέσεις τίτλων δημιουργούνται σε φορείς που διακανονίζουν τις συναλλαγές τους επί τίτλων μέσω θεματοφυλάκων, το αντίτιμο των τίτλων που αποκτώνται με τη δημοπρασία ή με την παρέμβαση του Διαχειριστή του Συστήματος, αντλείται από τους τρεχούμενους λογαριασμούς των θεματοφυλάκων.

Εάν εμφανίζεται χρεωστική θέση για τον ίδιο συμμετέχοντα και για τον ίδιο κωδικό έκδοσης τίτλου επί δέκα συνεχείς ημέρες, ο Διαχειριστής του Συστήματος παρεμβαίνει για την οριστική τακτοποίηση του χρεωστικού υπολοίπου τίτλων που παρουσιάζεται στο λογαριασμό του συμμετέχοντα φορέα, ανεξαρτήτως κόστους, δυνάμενος να λάβει και επιβάλει κάθε πρόσφορο μέτρο. Παράλληλα, επιβάλλει εις βάρος του διοικητικές κυρώσεις. Ο Διαχειριστής του Συστήματος δύναται να παρέμβει εάν εμφανίζεται χρεωστική θέση για τον ίδιο συμμετέχοντα και

για τον ίδιο κωδικό έκδοσης τίτλου και για χρονικό διάστημα μικρότερο των δέκα συνεχών ημερών, εφόσον η παρέμβαση αυτή διασφαλίζει ή απαιτείται για την εύρυθμη λειτουργία του Συστήματος, δυνάμενος να επιβάλλει και στην περίπτωση αυτή κυρώσεις. Η παρέμβαση αυτή πραγματοποιείται σε κάθε περίπτωση όταν δεν έχει καλυφθεί με τη μέθοδο της δημοπρασίας χρεωστική θέση τίτλων του φορέα, με την προϋπόθεση ότι αυτή η χρεωστική θέση είχε καλυφθεί την αμέσως προηγούμενη εργάσιμη ημέρα.

Η διαδικασία δεν εφαρμόζεται για τους συμμετέχοντες φορείς ως προς τους οποίους η σύμβαση συμμετοχής στο Σύστημα δεν επιτρέπει την ύπαρξη χρεωστικών ή/και ανοικτών θέσεων.

Ταμειακό σκέλος

Μετά την ολοκλήρωση της διαδικασίας κάλυψης των χρεωστικών ή ανοικτών θέσεων σε τίτλους, εξετάζονται τα τρέχοντα υπόλοιπα των τρεχούμενων λογαριασμών ταμειακής διαχείρισης σε ευρώ ή λογαριασμών καταθέσεων σε ευρώ των φορέων (ή θεματοφυλάκων) που υπέχουν υποχρέωση πληρωμής από τη συναλλαγή που εκκαθαρίζεται. Εάν τα τρέχοντα υπόλοιπα των χρηματικών λογαριασμών επαρκούν για να διακανονιστούν οι συναλλαγές, τότε γίνονται οριστικές εγγραφές (τόσο στους λογαριασμούς τίτλων όσο και στους ταμειακούς λογαριασμούς) ανά συναλλαγή τόσο για το σκέλος των τίτλων όσο και για το ταμειακό σκέλος. Εάν τα τρέχοντα υπόλοιπα δεν επαρκούν για να διακανονιστούν οι συναλλαγές, τότε δεν εκκαθαρίζονται μέσω του Συστήματος οι μη καλυπτόμενες ταμειακά συναλλαγές, ακυρουμένων των σχετικών ειδοποιήσεων, αφού απέβη άκαρπη η διαδικασία επίτευξης διακανονισμού τους, και οι εκατέρωθεν απαιτήσεις και υποχρεώσεις που τυχόν συνεπάγεται ο μη διακανονισμός των συναλλαγών μέσω του Συστήματος, συνεπεία ακυρώσεως των ειδοποιήσεων, κατά τα ανωτέρω, εκκαθαρίζονται από τα συμβαλλόμενα μέρη εκτός Συστήματος, απ' ευθείας μεταξύ τους.

12.5 ΓΕΝΙΚΟΙ ΚΑΝΟΝΕΣ ΠΟΥ ΙΣΧΥΟΥΝ ΚΑΤΑ ΤΟ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ

12.5.1 Σε κάθε πίστωση τίτλων σε λογαριασμό φορέα του Συστήματος, πρέπει να αντιστοιχεί χρέωση ισόποσων ομοειδών τίτλων σε λογαριασμό άλλου φορέα ή στον άλλο λογαριασμό του ιδίου φορέα.

12.5.2 Τα αποτελέσματα της πίστωσης ή χρέωσης τίτλων σε λογαριασμούς του Συστήματος επέρχονται από της οριστικοποίησης των σχετικών εγγραφών, κατά τους κανόνες λειτουργίας του παρόντος Κανονισμού.

12.5.3 Οι τίτλοι που είναι καταχωρημένοι στο λογαριασμό επενδυτών φορέα δεν δύνανται να αποτελέσουν αντικείμενο οιασδήποτε μορφής κατάσχεσης για απαίτηση κατά του φορέα, ούτε εις χείρας του φορέα, ούτε περιλαμβάνονται στην πτωχευτική περιουσία σε περίπτωση πτώχευσης ή άλλου είδους αφερεγγυότητας του φορέα, αλλά αποδίδονται στους δικαιούχους τους, μεταφερόμενοι σε λογαριασμό επενδυτών άλλου φορέα, τηρουμένων των διατάξεων του άρθρου 8 του ν. 2198/1994, του άρθρου 6 του ν. 2396/1996, των λοιπών σχετικών διατάξεων της νομοθεσίας, καθώς και του κεφαλαίου 15 : ΛΗΞΗ ΤΗΣ ΣΥΜΜΕΤΟΧΗΣ ΣΤΟ ΣΥΣΤΗΜΑ του παρόντος Κανονισμού. Ο σύνδικος πτώχευσης, ο ειδικός εκκαθαριστής και οποιοσδήποτε δανειστής του φορέα δεν δικαιούνται να κατάσχουν ή να αποκτήσουν, καθ' οιονδήποτε τρόπο, δικαιώματα επί των τίτλων αυτών για απαιτήσεις τους κατά του φορέα. Εξυπακούεται ότι ο σύνδικος πτωχεύσεως ή ο ειδικός εκκαθαριστής δύνανται να προβάλλουν κατά των επενδυτών δικαιούχων των κατ' ιδίαν τίτλων νόμιμες ενστάσεις του φορέα κατ' αυτών, τηρουμένων των διατάξεων της νομοθεσίας.

12.5.4 Η έναρξη διαδικασίας αφερεγγυότητας κατά φορές του Συστήματος δεν επηρεάζει τη διαδικασία εκκαθάρισης και διακανονισμού συναλλαγών μέσω του Συστήματος που είχε αρχίσει πριν από την αναγγελία στο Διαχειριστή του Συστήματος της σχετικής απόφασης, τηρουμένων των διατάξεων του ν. 2789/2000, του ν. 3301/2004 και του Καταστατικού της Τράπεζας της Ελλάδος.

12.6 ΕΝΗΜΕΡΩΣΗ ΤΩΝ ΣΥΜΜΕΤΕΧΟΝΤΩΝ ΦΟΡΕΩΝ ΓΙΑ ΤΙΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΕΣ ΚΑΙ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΥΣ ΤΩΝ

Κατά τη διάρκεια της ημέρας ο Διαχειριστής του Συστήματος παρέχει στους συμμετέχοντες φορείς πληροφορίες για τις ειδοποιήσεις και τις συναλλαγές τους με τρέχουσα ή μελλοντική ημερομηνία (valeur) διακανονισμού. Οι πληροφορίες αυτές αφορούν ταυτοποιημένες ή μη ειδοποιήσεις, εκκρεμείς συναλλαγές, διακανονισμένες και οριστικώς μη διακανονισθείσες συναλλαγές (συνεπεία ακυρώσεως των σχετικών ειδοποιήσεων, αφού απέβη άκαρπη η διαδικασία επίτευξης διακανονισμού μέσω του Συστήματος) κλπ. Με βάση τις πληροφορίες αυτές οι φορείς προβαίνουν στις δικές τους ενέργειες. Οι παραπάνω πληροφορίες παρέχονται μέσω :

- του διαδικτύου (κατόπιν ειδικής εξουσιοδότησης)
- της ΗΔΑΤ (για τους φορείς-μέλη)
- του SWIFT
- τηλεομοιοτυπίας (fax)

Με τους δύο τελευταίους τρόπους αποστέλλονται στους φορείς καταστάσεις -κατά τακτά χρονικά διαστήματα- κατόπιν συμφωνίας με τους ενδιαφερόμενους.

Επίσης, σε εύλογο χρονικό διάστημα μετά την ολοκλήρωση του τελικού κύκλου οριστικού διακανονισμού, το Σύστημα αποστέλλει στους συμμετέχοντες φορείς τα ακόλουθα στοιχεία:

- υπόλοιπα των λογαριασμών τίτλων του που κινήθηκαν, κατά κωδικό έκδοσης τίτλων,
- την κίνηση των λογαριασμών τίτλων και των λογαριασμών ταμειακής διαχείρισης του φορέα,
- κατάσταση των μη διακανονισμένων συναλλαγών ανά λογαριασμό τίτλων του φορέα.

12.7 ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ ΓΙΑ ΤΙΣ ΟΠΟΙΕΣ ΙΣΧΥΟΥΝ ΙΔΙΑΙΤΕΡΑ ΩΡΑΡΙΑ ΛΗΨΗΣ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΕΩΝ

Οι συναλλαγές, οι ειδοποιήσεις ως προς τις οποίες λαμβάνονται μετά τον τελικό κύκλο οριστικού διακανονισμού (π.χ. ειδοποιήσεις για την εξυπηρέτηση των αναγκών πράξεων νομισματικής πολιτικής και παροχής ενδοημερήσιας ρευστότητας του Ευρωσυστήματος, του Συστήματος Ανταποκριτριών Κεντρικών Τραπεζών κλπ.) για τις οποίες ισχύουν ιδιαίτερα ωράρια λήψης ειδοποιήσεων σύμφωνα με αποφάσεις των αρμοδίων αρχών και οργάνων, διακανονίζονται μία προς μία μεμονωμένα.

12.8 ΚΛΕΙΣΙΜΟ ΤΗΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

Το κλείσιμο της ημέρας του Συστήματος γίνεται μετά την παρέλευση της τελευταίας προθεσμίας (cut off time) λήψης όλων των ειδοποιήσεων για συναλλαγές, δηλαδή στις 19:00 η ώρα.

13. ΚΥΡΩΣΕΙΣ

Σε περίπτωση που ο λογαριασμός ταμειακής διαχείρισης ή ο λογαριασμός τίτλων του συμμετέχοντα φορέα παρουσιάσει ανεπαρκές υπόλοιπο, με συνέπεια:

- α) να απαιτηθεί παρέμβαση του Διαχειριστή του Συστήματος για την επίτευξη του διακανονισμού των συναλλαγών του (βλέπε Κεφάλαιο 12 : ΗΜΕΡΗΣΙΑ ΔΙΑΔΙΚΑΣΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ ΤΩΝ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ ΤΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ εδ. 4 .2. Κάλυψη χρεωστικών και ανοικτών θέσεων) ή/και
- β) το μη διακανονισμό συναλλαγών του συμμετέχοντα φορέα (συνδεόμενο με ακύρωση των σχετικών ειδοποιήσεων) στις οποίες αντισυμβαλλόμενος ή αντισυμβαλλόμενοι είναι και άλλος ή και άλλοι φορείς,

ο συμμετέχων φορέας υποχρεούται αυτοδίκαια και χωρίς όχληση να καταβάλει στο Διαχειριστή του Συστήματος ποσό 300 (τριακοσίων) ευρώ ανά κωδικό έκδοσης τίτλων, που αποσκοπεί στην κάλυψη των εξόδων διαχείρισης στα οποία υποβλήθηκε το Σύστημα, υπό μορφήν προστίμου.

Ο Διαχειριστής του Συστήματος δύναται να επιβάλλει στον παραπάνω συμμετέχοντα φορέα πρόστιμο πολλαπλάσιο του ανωτέρω ποσού, εφόσον οι μη διακανονισθείσες συναλλαγές λόγω ελλείψεως τίτλων ή χρημάτων στους λογαριασμούς του φορέα προκάλεσαν στη συνέχεια το μη διακανονισμό συναλλαγών άλλων φορέων.

Αν η ανεπάρκεια υπολοίπου οφείλεται σε γεγονός για το οποίο δεν ευθύνεται ο συμμετέχων φορέας, δεν του επιβάλλεται πρόστιμο.

Η επιβολή του προστίμου γίνεται από το Σύστημα κατά το κλείσιμο της ημέρας. Κατά το άνοιγμα της επόμενης εργάσιμης ημέρας χρεώνεται ο λογαριασμός ταμειακής διαχείρισης του συμμετέχοντα φορέα με το ποσό του επιβαλλομένου προστίμου και πιστώνεται ο αντίστοιχος λογαριασμός του Συστήματος.

Προκειμένου περί φορέων το ταμειακό σκέλος των συναλλαγών των οποίων διακανονίζεται μέσω λογαριασμού που τηρεί τράπεζα διακανονισμού στο πλαίσιο λειτουργίας του συστήματος TARGET2, το επιβαλλόμενο, σύμφωνα με τα ανωτέρω αναφερόμενα, πρόστιμο καταβάλλεται από τον φορέα στο λογαριασμό που ορίζει η Τράπεζα της Ελλάδος, εντός της επόμενης της επιβολής του εργάσιμης ημέρας.

Σε περίπτωση υποτροπής ή σε περίπτωση μη καταβολής του προστίμου εκ μέρους του φορέως σύμφωνα με τα ανωτέρω, ο συμμετέχων φορέας μπορεί να αποκλεισθεί από το Σύστημα, με την επιφύλαξη όσων ορίζονται στο Κεφάλαιο 15: ΛΗΞΗ ΤΗΣ ΣΥΜΜΕΤΟΧΗΣ ΣΤΟ ΣΥΣΤΗΜΑ του παρόντος Κανονισμού.

14. ΤΙΜΟΛΟΓΗΣΗ

14.1 Τέλη επί των ειδοποιήσεων

Κάθε ειδοποίηση προς το Σύστημα που λαμβάνεται μέχρι την 15:30 ώρα (cut-off time λήψης ειδοποιήσεων) ή δημιουργείται από το Σύστημα για λογαριασμό των φορέων συνεπάγεται χρέωση του αποστολέα (φορέα) ως εξής:

- οι πρώτες **2.000** ειδοποιήσεις του μήνα με **2,93** ευρώ,
- οι επόμενες **4.000** ειδοποιήσεις του μήνα με **2,70** ευρώ,
- οι υπόλοιπες ειδοποιήσεις του μήνα με **2,50** ευρώ.

Επίσης, οι καταστάσεις που αποστέλλονται στους συμμετέχοντες φορείς ύστερα από αίτησή τους τιμολογούνται κατά περίπτωση.

Απαλλάσσονται των πιο πάνω χρεώσεων :

- 1) οι ειδοποιήσεις εσωτερικής μεταβίβασης (Κ.Σ. 22) μεταξύ των λογαριασμών τίτλων πελατείας κατοίκων Ελλάδος (Κ.Λ. 100, 101, 102, 103),
- 2) οι ειδοποιήσεις για αναγγελία απόκτησης τίτλων στην Πρωτογενή Αγορά,
- 3) οι ειδοποιήσεις που δημιουργούνται από το Σύστημα και αφορούν τα δεύτερα σκέλη των προθεσμιακών πράξεων (Repos, Buy/sell back, Λήξη δανείου καθορισμένης διάρκειας) και
- 4) οι καταστάσεις που αποστέλλονται στους συμμετέχοντες φορείς για ενημέρωση τους ως προς τις ημερήσιες συναλλαγές τους (Κεφ. 12 εδάφιο 12.6).

Ο υπολογισμός των τελών επί των ειδοποιήσεων γίνεται ανά μήνα και περιλαμβάνει ειδοποιήσεις που λαμβάνονται από το Σύστημα από την τελευταία εργάσιμη ημέρα κάθε μήνα έως και την προτελευταία εργάσιμη ημέρα του επόμενου μήνα. Η είσπραξη των τελών από τους φορείς γίνεται την τελευταία εργάσιμη ημέρα κάθε μήνα, σύμφωνα με τις υποδείξεις της Τράπεζας της Ελλάδος. Σε κάθε περίπτωση, η Τράπεζα της Ελλάδος δικαιούται να εισπράττει τα ως άνω ποσά και μέσω της χρέωσης των χρηματικών λογαριασμών των φορέων. Προκειμένου περί φορέων το ταμειακό σκέλος των συναλλαγών των οποίων διακανονίζεται μέσω λογαριασμού που τηρεί τράπεζα διακανονισμού στο πλαίσιο λειτουργίας του συστήματος TARGET2, τα τέλη καταβάλλονται από τον φορέα την ίδια ως άνω ημέρα, στο λογαριασμό που ορίζει η Τράπεζα της Ελλάδος.

14.2 Προμήθειες εκ της συνδέσεως του Συστήματος με το σύστημα πληρωμών TARGET2-GR

Οι φορείς βαρύνονται με τις προμήθειες που οφείλει να καταβάλει το Σύστημα στο πλαίσιο λειτουργίας του συστήματος TARGET2 και σύμφωνα με τα ειδικότερα οριζόμενα στον Κανονισμό Λειτουργίας του συστήματος πληρωμών TARGET2-GR, όπως τυχόν εξειδικεύεται με σχετικές εγκυκλίους ή και οδηγίες της Τράπεζας της Ελλάδος. Οι φορείς καταβάλλουν τα ως άνω ποσά σύμφωνα με τις υποδείξεις της Τράπεζας της Ελλάδος. Σε κάθε περίπτωση, η Τράπεζα της Ελλάδος δικαιούται να εισπράττει τα ως άνω ποσά και μέσω της χρέωσης των χρηματικών λογαριασμών των φορέων. Προκειμένου περί φορέων το ταμειακό σκέλος των συναλλαγών των οποίων διακανονίζεται μέσω λογαριασμού που τηρεί τράπεζα διακανονισμού στο σύστημα TARGET2, τα ποσά των προμηθειών καταβάλλονται από τον φορέα στο λογαριασμό που ορίζει η Τράπεζα της Ελλάδος.

14.3 Αναπροσαρμογή τελών και λοιπών επιβαρύνσεων

Ο Διαχειριστής του Συστήματος μπορεί να αναπροσαρμόζει, κατά την κρίση του, τα εισπραττόμενα τέλη, τις προμήθειες, τα πρόστιμα, και τις λοιπές επιβαρύνσεις. Οι αναπροσαρμογές αυτές γνωστοποιούνται εγγράφως στους συμμετέχοντες φορείς 2 μήνες πριν από την έναρξη της εφαρμογής τους.

15. ΛΗΞΗ ΤΗΣ ΣΥΜΜΕΤΟΧΗΣ ΣΤΟ ΣΥΣΤΗΜΑ

15.1 Μέλος του Συστήματος παύει να συμμετέχει σ' αυτό με απόφαση του Διαχειριστή του Συστήματος:

α) Είτε κατόπιν πρωτοβουλίας του ίδιου του φορέα, οπότε αυτός υποβάλλει γραπτό αίτημα στο Διαχειριστή, τουλάχιστον δεκαπέντε (15) ημέρες πριν από τη λήξη της συμμετοχής. Ο Διαχειριστής του Συστήματος υποχρεούται να κάνει δεκτό το εν λόγω αίτημα εφόσον δεν υφίστανται εκκρεμείς υποχρεώσεις του φορέα έναντι του Συστήματος ή άλλων φορέων και με απόφασή του ορίζει την ακριβή ημερομηνία λήξης της συμμετοχής. Σε κάθε περίπτωση, ο Διαχειριστής μεριμνά για τη διασφάλιση της προηγούμενης εκπλήρωσης των υποχρεώσεων του αποχωρούντος φορέα.

β) Είτε κατόπιν απόφασης του Διαχειριστή του Συστήματος για σπουδαίο λόγο, όπως η μη εκπλήρωση από το φορέα των προϋποθέσεων συμμετοχής στο Σύστημα, η μη ανεκτή διακινδύνευση της λειτουργίας του Συστήματος ή της εύρυθμης λειτουργίας της χρηματοπιστωτικής αγοράς από τη συνέχιση της συμμετοχής του φορέα στο Σύστημα, συμπεριλαμβανομένων των περιπτώσεων των σοβαρών ή και επανειλημμένων παραβάσεων διατάξεων του Κανονισμού από το φορέα, οι οποίες θέτουν εν αμφιβόλω την αξιοπιστία του και θέτουν σε κίνδυνο την εύρυθμη λειτουργία του Συστήματος ή της χρηματοπιστωτικής αγοράς ή για άλλους λόγους που ορίζονται στον παρόντα Κανονισμό. Η απόφαση αυτή του Διαχειριστή του Συστήματος γνωστοποιείται στο φορέα και ισχύει τουλάχιστον τρεις (3) ημέρες μετά την εν λόγω γνωστοποίηση, όπως ειδικότερα ορίζει η απόφαση. Στην έγγραφη αυτή γνωστοποίηση περιλαμβάνονται συνοπτικά οι λόγοι που οδήγησαν το Διαχειριστή του Συστήματος στο να λάβει την απόφαση για τη διαγραφή του φορέα.

Τα αποτελέσματα της λήξης συμμετοχής επέρχονται από την ημερομηνία, κατά την οποία θα έχουν οριστικά εκκαθαριστεί, σύμφωνα με τα κεφάλαια 11 : ΕΠΕΞΕΡΓΑΣΙΑ ΤΩΝ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΕΩΝ και 12 : ΗΜΕΡΗΣΙΑ ΔΙΑΔΙΚΑΣΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ ΤΩΝ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ ΤΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ του παρόντος Κανονισμού, όλες οι πράξεις του φορέα που έχουν ανακοινωθεί δεκαπέντε (15) ημέρες πριν από τη λήξη της συμμετοχής, όταν αυτή επέρχεται με πρωτοβουλία του φορέα, ή τρεις (3) ημέρες πριν από τη λήξη, όταν αυτή επέρχεται με πρωτοβουλία του Διαχειριστή του Συστήματος.

15.2 Η λήξη της συμμετοχής στο Σύστημα συμμετέχοντος φορέα επέρχεται αυτοδικαίως και παράγει αμέσως αποτελέσματα, ανεξάρτητα από οποιαδήποτε γνωστοποίηση, αν συντρέχει μία τουλάχιστον από τις παρακάτω περιπτώσεις:

- αφερεγγυότητα του φορέα, δηλαδή κάθε συλλογικό μέτρο που προβλέπεται από το δίκαιο του κράτους που διέπει τη λειτουργία του φορέα και συνεπάγεται την απαγόρευση ή τον περιορισμό της εξουσίας διάθεσης του φορέα, όπως η πτώχευση, η ειδική εκκαθάριση ή η εξυγίανση κλπ.
- διορισμός στο φορέα Επιτρόπου ή άλλου αναγκαστικού διαχειριστή,
- θέση του φορέα υπό εκκαθάριση, από οποιαδήποτε αιτία,
- οριστική ανάκληση της άδειας λειτουργίας του,
- ανάκληση της άδειας συμμετοχής του στο Σύστημα.

15.3 Ο Διαχειριστής δύναται με απόφασή του να αναστείλει τη συμμετοχή φορέα στο Σύστημα για χρονικό διάστημα έως 30 ημερών, αν συντρέχει μία τουλάχιστον από τις παρακάτω περιπτώσεις:

- μεταβολή της οικονομικής κατάστασης του φορέα η οποία, κατά την εύλογο κρίση του Διαχειριστή του Συστήματος, μπορεί να τον οδηγήσει σε παύση πληρωμών ή σε αφερεγγυότητα,
- επιβολή σε βάρος του φορέα αναγκαστικής ή συντηρητικής κατάσχεσης, που θέτουν σε κίνδυνο την εύρυθμη λειτουργία του ή την εκπλήρωση των υποχρεώσεών του, κατά την εύλογο κρίση του Διαχειριστή του Συστήματος,
- μη εκπλήρωση, είτε πρόσκαιρη είτε οριστική, εκ μέρους του φορέα υποχρεώσεών του που απορρέουν από τον παρόντα Κανονισμό, έτσι ώστε να δημιουργείται άμεσος κίνδυνος για την εύρυθμη λειτουργία του Συστήματος,
- μείωση της αξίας των ασφαλειών που έχει δώσει ο φορέας στο Σύστημα προς εξασφάλιση των υποχρεώσεών του, έτσι ώστε να δημιουργείται άμεσος κίνδυνος από τη συνέχιση της συμμετοχής του φορέα στο Σύστημα,
- προσωρινή αναστολή της άδειας λειτουργίας του φορέα,
- κάθε γεγονός ικανό να δημιουργήσει, ευλόγως, στο Διαχειριστή του Συστήματος την εντύπωση ότι η συνέχιση της συμμετοχής του φορέα στο Σύστημα δύναται να θέσει σε κίνδυνο την ομαλή λειτουργία του Συστήματος ή την εύρυθμη λειτουργία της χρηματοπιστωτικής αγοράς.

Ο Διαχειριστής του Συστήματος δύναται να αναστείλει προηγούμενη απόφασή του για αναστολή της συμμετοχής φορέα στο Σύστημα, αν, κατά την κρίση του, δεν συντρέχουν πλέον οι λόγοι που επέβαλαν την επιβολή του εν λόγω μέτρου.

Κατά τη διάρκεια ισχύος του μέτρου της προσωρινής αναστολής, οι λογαριασμοί που τηρεί ο φορέας μεταφέρονται σε ειδικό δεσμευμένο λογαριασμό, που κινείται από το Διαχειριστή του Συστήματος μόνο για σκοπούς εκκαθάρισης εκκρεμών σχέσεων και, κυρίως, μεταφοράς των τίτλων σε λογαριασμούς άλλων φορέων, τηρουμένων αναλόγως όσων προβλέπονται στην παράγραφο 15.4.

15.4 Κατά την ημερομηνία κατά την οποία επέρχονται τα αποτελέσματα της λήξης συμμετοχής φορέα στο Σύστημα και με την επιφύλαξη της συνδρομής περιπτώσεων του Κεφαλαίου 16 : ΑΣΦΑΛΕΙΕΣ ΥΠΕΡ ΤΟΥ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΤΗ ΤΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ του παρόντος Κανονισμού, ο Διαχειριστής του Συστήματος μεταφέρει, τους τίτλους που είναι καταχωρημένοι στο λογαριασμό του φορέα σε λογαριασμό άλλου φορέα που συναινεί, τον οποίο υποδεικνύει ο φορέας που λήγει η συμμετοχή του στο Σύστημα, εφόσον υφίσταται τέτοιο δικαίωμα του φορέως, ή, ελλείψει τέτοιας υποδείξεως, καθώς και στις περιπτώσεις των παραγράφων 15.1 περ. β' και 15.2., σε ειδικό δεσμευμένο λογαριασμό που διαχειρίζεται προσωρινώς ο Διαχειριστής του Συστήματος. Ο λογαριασμός αυτός κινείται μόνο για σκοπούς εκκαθάρισης εκκρεμών σχέσεων και, κυρίως, μεταφοράς των τίτλων σε λογαριασμούς άλλων φορέων. Εντολές για κίνηση του ειδικού αυτού λογαριασμού δύνανται να δίδουν στο Διαχειριστή του Συστήματος τα εξουσιοδοτημένα να διαχειρίζονται και εκπροσωπούν τον φορέα (ως τοιούτου νοουμένου και του αποβληθέντος φορέα) πρόσωπα, όπως, κατά περίπτωση, ο σύνδικος πτωχεύσεως, ο ειδικός εκκαθαριστής, ο επόπτης εκκαθάρισης ή άλλο όργανο που αναλαμβάνει, βάσει των διατάξεων της νομοθεσίας, την τακτοποίηση των υποθέσεων του φορέως και έχει εξουσία διαχείρισης των υποθέσεων και εκπροσώπησής του. Πέραν της μεταφοράς τίτλων του λογαριασμού πελατών (επενδυτών) του φορέως, του οποίου έληξε ή αναστάλη η συμμετοχή στο Σύστημα, καθώς και της, εν γένει, πώλησης τίτλων των λογαριασμών του μέχρι τότε φορέως, δυνατή είναι και η μεταφορά τίτλων από το λογαριασμό ιδίων τίτλων (ΙΧ) του μέχρι πρότινος φορέως του Συστήματος σε λογαριασμό επενδυτών άλλου φορέως. Δεν επιτρέπονται κινήσεις αγοράς τίτλων μέσω του ειδικού λογαριασμού, παρά μόνο κινήσεις μεταφοράς και πώλησης τίτλων. [Αγορές τίτλων επιτρέπονται μόνον κατόπιν ρητής και ειδικής αδείας του Διαχειριστή του Συστήματος].

Σε περιπτώσεις ανάκλησης ή αναστολής της άδειας λειτουργίας φορέως, έτσι ώστε να απαγορεύεται σ'αυτόν η άσκηση δραστηριοτήτων θεματοφύλακα τίτλων ή και διενέργειας

συναλλαγών επί τίτλων (π.χ. στο πλαίσιο εκτέλεσης εντολών ή διαχείρισης χαρτοφυλακίου), κινήσεις μεταφοράς τίτλων ή εκποίησης επιτρέπονται στις εξής, ιδίως, περιπτώσεις :

- α) αν η σχετική εντολή δοθεί από ειδικό εκκαθαριστή ή επόπτη,
- β) αν η απόφαση των οργάνων του φορέως για μεταφορά, μεταβίβαση ή πώληση εγκριθεί από την αρμόδια εποπτική του αρχή και
- γ) αν η αρμόδια εποπτική αρχή του φορέως ενημερώσει το Διαχειριστή του Συστήματος περί της εξουσίας συγκεκριμένων προσώπων να προβούν σε πράξεις στον εν λόγω λογαριασμό, οπότε τα πρόσωπα αυτά θα δικαιούνται να διενεργήσουν τις εκτεθείσες ανωτέρω πράξεις και, εν γένει, πράξεις που εξυπηρετούν την εκκαθάριση των λογαριασμών και ομαλή λήξη της σχέσης του Συστήματος με τον εν λόγω φορέα υπό την ιδιότητά του αυτή.

Σχετικώς, ο Διαχειριστής του Συστήματος επιδεικνύει την οφειλόμενη επιμέλεια για την τήρηση των διατάξεων της νομοθεσίας που κατοχυρώνουν τα δικαιώματα των επενδυτών-πελατών του αποβληθέντος φορέως, χωρίς να ευθύνεται από τυχόν καθυστερήσεις κατά την κίνηση του ειδικού δεσμευμένου λογαριασμού, όταν υφίσταται εύλογη αμφιβολία ως προς το νόμιμο της αιτουμένης κινήσεως. Ειδικώς ως προς αλλοδαπούς φορείς, ο Διαχειριστής του Συστήματος δύναται να επαφίεται σε γνωμοδοτήσεις δικηγορικών γραφείων ή επιστολές εποπτικών αρχών των κρατών, το δίκαιο των οποίων διέπει τη λειτουργία του αποβληθέντος φορέως, χωρίς να ευθύνεται για την ορθότητα των περιεχομένων στις γνωμοδοτήσεις ή εποπτικές αρχές θέσεων.

15.5 Οι ανωτέρω περιορισμοί ως προς τα πρόσωπα που επιτρέπεται να διαχειρισθούν και κινήσουν λογαριασμούς τίτλων ισχύουν και για την κίνηση των λογαριασμών κεφαλαίων που διαθέτει στο Σύστημα ο φορέας του, που χάνει – οριστικά ή προσωρινά – την ιδιότητα αυτή.

15.6 Σε κάθε περίπτωση λήξης της συμμετοχής φορέως στο Σύστημα ο Διαχειριστής του Συστήματος οφείλει να ενημερώσει τους λοιπούς φορείς με σχετική δημοσίευση ή ανακοίνωση απευθυνόμενη σε όλους τους φορείς, χωρίς να προσδιορίζει με πρωτοβουλία τίνος από τα δύο μέρη επήλθε η λήξη της συμμετοχής. Ο Διαχειριστής του Συστήματος ανακοινώνει επίσης στους φορείς και την αναστολή της συμμετοχής φορέα στο Σύστημα, καθώς και τη λήξη της αναστολής.

16. ΑΣΦΑΛΕΙΕΣ ΥΠΕΡ ΤΟΥ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΤΗ ΤΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

Κάθε περιουσιακό στοιχείο (χρηματικά ποσά και τίτλοι) που τηρεί η Τράπεζα της Ελλάδος ως Διαχειριστής του Συστήματος για λογαριασμό του συμμετέχοντα φορέα, διασφαλίζει την εκτέλεση των υποχρεώσεων του φορέα προς το Διαχειριστή και γενικότερα των υποχρεώσεων του που απορρέουν από τις συναλλαγές του που παρακολουθούνται από το Σύστημα, καθώς και εκείνων του άρθρου 28 του Ν.2076/92 ή και άλλων διατάξεων της νομοθεσίας. Σε περίπτωση που ο συμμετέχων φορέας αδυνατεί ή καθυστερεί να εκπληρώσει τις υποχρεώσεις του, ο Διαχειριστής εξουσιοδοτείται με τον παρόντα Κανονισμό να παρακρατήσει τα εν λόγω περιουσιακά στοιχεία (ποσά ή τίτλους), να τα ρευστοποιήσει σύμφωνα με τα προβλεπόμενα στις διατάξεις των νόμων και να διαθέσει το προϊόν της ρευστοποίησης προς εκπλήρωση των υποχρεώσεων του συμμετέχοντα φορέα, κατά κεφάλαιο, τόκους και έξοδα.

Σχετικώς εφαρμόζονται οι διατάξεις του Καταστατικού της Τράπεζας της Ελλάδος, καθώς και των άρθρων 1-10 του Ν. 3301/2004 “Συμφωνίες παροχής χρηματοοικονομικής ασφάλειας εφαρμογή των Διεθνών Λογιστικών Προτύπων και άλλες διατάξεις”. Κατά συνέπεια, ο Διαχειριστής του Συστήματος δικαιούται να επιδιώξει τις απαιτήσεις του κατά τις διατάξεις του νόμου αυτού και, ενδεικτικώς, με τους τρόπους του άρθρου 4, προβαίνοντας σε άμεση εκποίηση των τίτλων ιδίου λογαριασμού του φορέως προς ικανοποίηση των απαιτήσεων του.

17. ΤΡΟΠΟΠΟΙΗΣΗ ΤΟΥ ΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ

Με την επιφύλαξη της προβλεπόμενης στο Κεφάλαιο 14 : ΤΙΜΟΛΟΓΗΣΗ εδ. 2 ειδικής περίπτωσης, ο Διαχειριστής του Συστήματος δικαιούται - οποτεδήποτε - να τροποποιήσει τις διατάξεις του παρόντος Κανονισμού, με την προϋπόθεση ότι θα λάβει χώρα αναγγελία της τροποποίησης στους συμμετέχοντες φορείς τουλάχιστον οκτώ (8) εργάσιμες ημέρες πριν από την έναρξη εφαρμογής της, εκτός αν συντρέχει κατεπείγουσα περίπτωση τροποποίησης, όπως αλλαγή της νομοθεσίας ή κατεπείγουσα διασφάλιση της εύρυθμης λειτουργίας του Συστήματος. Οι τροποποιήσεις γνωστοποιούνται εγγράφως στους συμμετέχοντες φορείς. Ο Διαχειριστής του Συστήματος δεσμεύεται να διαβουλεύεται με τους φορείς του Συστήματος πριν προχωρήσει σε ουσιώδεις τροποποιήσεις του. Φορέας του Συστήματος που δεν αποδέχεται τις τροποποιήσεις, δικαιούται να αποχωρήσει από το Σύστημα.

18. ΕΦΑΡΜΟΣΤΕΟ ΔΙΚΑΙΟ - ΔΙΚΑΙΟΔΟΣΙΑ

- 18.1 Οι διατάξεις του παρόντος Κανονισμού καθώς και κάθε συναλλαγή που ρυθμίζεται από αυτόν, διέπονται από το Ελληνικό Δίκαιο.
- 18.2 Αρμόδια δικαστήρια για την επίλυση κάθε διαφοράς που απορρέει από την εφαρμογή του παρόντος Κανονισμού και, εν γένει, τη λειτουργία του Συστήματος, είναι τα δικαστήρια των Αθηνών.

*

* *

Αθήνα, Φεβρουάριος 2010

Υπόδειγμα 1

Αρ. σύμβασης :

**ΣΥΜΒΑΣΗ ΠΡΟΣΧΩΡΗΣΗΣ ΣΤΟ
"ΣΥΣΤΗΜΑ ΠΑΡΑΚΟΛΟΥΘΗΣΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ
ΕΠΙ ΤΙΤΛΩΝ ΜΕ ΛΟΓΙΣΤΙΚΗ ΜΟΡΦΗ (ΑΪΛΟΙ ΤΙΤΛΟΙ)"**

Ο/Η
με έδρα νομίμως εκπροσωπούμεν-ος/η εν προκειμένω
από
δηλώνουμε ότι :

- 1) Γνωρίζουμε τους όρους του Κανονισμού Λειτουργίας του "Συστήματος Παρακολούθησης Συναλλαγών επί Τίτλων με Λογιστική Μορφή (ΑΪλοι Τίτλοι)" και των παραρτημάτων του και έχουμε παραλάβει από ένα αντίτυπο αυτών.
- 2) Αποδεχόμεθα ανεπιφύλακτα τις διατάξεις του ως άνω Κανονισμού και των παραρτημάτων του. Οι εν λόγω διατάξεις θα διέπουν ως ειδικές διατάξεις τις συναλλαγές που θα διενεργούνται στα πλαίσια του "Συστήματος Παρακολούθησης Συναλλαγών επί Τίτλων με Λογιστική Μορφή (ΑΪλοι Τίτλοι)" είτε για δικό μας λογαριασμό είτε για λογαριασμό των πελατών μας.
- 3) Παρέχουμε στην Τράπεζα της Ελλάδος εντολή και εξουσιοδότηση να κινεί όλους τους λογαριασμούς τίτλων που τηρούνται επ' ονόματί μας στο "Σύστημα Παρακολούθησης Συναλλαγών επί Τίτλων με Λογιστική Μορφή (ΑΪλοι Τίτλοι)" καθώς και τον τρεχούμενο λογαριασμό ταμειακής διαχείρισης σε ευρώ (λογαριασμό διακανονισμού) που τηρούμε στο πλαίσιο λειτουργίας του συστήματος πληρωμών TARGET2/TARGET2-GR ή τον λογαριασμό καταθέσεων σε ευρώ που τηρείται στην Τράπεζα της Ελλάδος, ιδίως δε να προβαίνει σε χρεωστικές ή πιστωτικές εγγραφές σύμφωνα με την καθοριζόμενη στον Κανονισμό Λειτουργίας του διαδικασία. Η παρούσα εντολή και εξουσιοδότηση παρέχεται ανεκκλήτως, με την επιφύλαξη του κεφ. 15 του προαναφερομένου Κανονισμού, σχετικά με τη λήξη της συμμετοχής του φορέα στο "Σύστημα Παρακολούθησης Συναλλαγών επί Τίτλων με Λογιστική Μορφή (ΑΪλοι Τίτλοι)".

Επισυνάπτεται σε παράρτημα ένα έντυπο με τα στοιχεία μας καθώς και μια κατάσταση των εξουσιοδοτημένων υπογραφών για τις συναλλαγές και τις ειδοποιήσεις που θα λαμβάνουν χώρα επ' ονόματί μας στα πλαίσια του "Συστήματος Παρακολούθησης Συναλλαγών επί Τίτλων με Λογιστική Μορφή (ΑΪλοι Τίτλοι)". Η εν λόγω κατάσταση παραμένει σε ισχύ μέχρι να κοινοποιηθεί εγγράφως νεώτερη στην Τράπεζα της Ελλάδος.

Αθήνα ,
(Ημερομηνία)

.
(Υπογραφές, ονόματα και βαθμός-θέση των
προσώπων που δεσμεύουν την Εταιρεία)

Συνημμένα : 2

ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΣΥΜΜΕΤΕΧΟΝΤΟΣ ΦΟΡΕΑ

ΣΥΜΜΕΤΕΧΩΝ ΦΟΡΕΑΣ

(1)

ΕΠΩΝΥΜΙΑ : (Ελληνικά)
 (Λατινικά)

ΔΙΕΥΘΥΝΣΗ :

Συμπληρωματικά στοιχεία :
 (Τμήμα, Υπηρεσία κλπ)

Αρμόδιος :

Τηλέφωνο :
Telex :
Α.Φ.Μ. :

Telefax :
K. SWIFT :

Λογαριασμός RTGS σε ΕΥΡΩ στην Ε.Κ.Π. ή
Λογαριασμός καταθέσεων σε ΕΥΡΩ στην Τ.Ε.

Τρόπος αποστολής ειδοποιήσεων : SWIFT / Ταχυδρομικά (2)

Τρόπος παραλαβής extraits λογαριασμών : Telefax / ΗΔΑΤ/ SWIFT (2)

.....
 (Τόπος) (Ημερομηνία)

.....
 (Υπογραφές, ονόματα και βαθμός-θέση των
 προσώπων που δεσμεύουν την Εταιρεία)

(1) Συμπληρώνεται από την Τράπεζα της Ελλάδος.

(2) Διαγράφεται ό,τι δεν χρησιμοποιείται.

ΚΑΤΑΣΤΑΣΗ ΕΞΟΥΣΙΟΔΟΤΗΜΕΝΩΝ ΥΠΟΓΡΑΦΩΝ

(1)

ΣΥΜΜΕΤΕΧΩΝ ΦΟΡΕΑΣ

ΕΠΩΝΥΜΙΑ :
 ..

Η Εταιρεία δηλώνει ότι τα πρόσωπα που αναφέρονται πιο κάτω είναι εξουσιοδοτημένα να υπογράφουν, μόνα ή σε συνδυασμό, χωρίς όριο όσον αφορά το ποσό, όλες τις συναλλαγές, δεσμεύσεις, αποδεσμεύσεις, δικαιολογητικά, πιστοποιητικά, δηλώσεις κλπ που αναφέρονται σε συναλλαγές του "Συστήματος Παρακολούθησης Συναλλαγών επί Τίτλων με Λογιστική Μορφή (Αϋλοι Τίτλοι)".

ΟΝΟΜΑ	(2)	ΥΠΟΓΡΑΦΗ

Όλες οι αλλαγές του καταλόγου αυτού θα ανακοινώνονται **εγγράφως** στο "Σύστημα Παρακολούθησης Συναλλαγών επί Τίτλων με Λογιστική Μορφή (Αϋλοι Τίτλοι)" που λειτουργεί στην Τράπεζα της Ελλάδος.

.....
 (Τόπος) (Ημερομηνία)

.....
 (Υπογραφές, ονόματα και βαθμός-θέση των
 προσώπων που δεσμεύουν την Εταιρεία)

(1) Συμπληρώνεται από την Τράπεζα της Ελλάδος.

(2) Σημειώνεται αν μπορεί να υπογράψει μόνος ή σε συνδυασμό.

Υπόδειγμα 2

Αρ. Σύμβασης : ...

ΔΗΛΩΣΗ ΑΝΑΛΗΨΗΣ ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΩΣ
ΓΙΑ ΤΗΝ ΥΠΟ ΟΡΟΥΣ ΤΗΡΗΣΗ
ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΥ ΚΑΤΑΘΕΣΕΩΝ ΣΕ ΕΥΡΩ
ΣΤΗΝ ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ

Ο υπογεγραμμένος , ενεργών ως νόμιμος εκπρόσωπος της με την επωνυμία που είναι εγκατεστημένη στην και επί της οδού αρ..... δηλώνουμε τα εξής :

1) Αποδεχόμαστε το άνοιγμα άτοκου λογαριασμού καταθέσεων σε ευρώ στην Τράπεζα της Ελλάδος στο όνομα της παραπάνω Εταιρίας μας. Ο λογαριασμός αυτός δεν θα παρουσιάζει χρεωστικό υπόλοιπο και θα χρησιμοποιείται μόνο για τη συμψηφιστική τακτοποίηση των συναλλαγών που πραγματοποιούνται στην Πρωτογενή και Δευτερογενή Αγορά επί τίτλων με λογιστική μορφή (άυλων τίτλων) του Ελληνικού Δημοσίου και αναγγέλλονται για το σκοπό αυτό στο Σύστημα Παρακολούθησης Συναλλαγών επί Τίτλων με Λογιστική Μορφή (Αυλοι Τίτλοι), για συντομία Σύστημα.

2) Παρέχουμε στην Τράπεζα της Ελλάδος εντολή και εξουσιοδότηση να κινεί τον ως άνω άτοκο λογαριασμό καταθέσεων σε ευρώ και ειδικότερα να προβαίνει σε χρεωστικές ή πιστωτικές εγγραφές σύμφωνα με τη διαδικασία που καθορίζεται στον Κανονισμό Λειτουργίας του Συστήματος, αντίγραφο του οποίου έχει ήδη παραλάβει η Εταιρία μας. Η παρούσα εντολή και εξουσιοδότηση παρέχεται ανεκκλήτως με την επιφύλαξη του κεφ. 15. ΛΗΞΗ ΤΗΣ ΣΥΜΜΕΤΟΧΗΣ ΣΤΟ ΣΥΣΤΗΜΑ του προαναφερόμενου Κανονισμού. Επίσης, τα αναφερόμενα στο ως άνω κεφ. 15 εφαρμόζονται αναλόγως και ως προς το κλείσιμο ή τη διακοπή της λειτουργίας του ως άνω άτοκου λογαριασμού καταθέσεων σε ευρώ της Εταιρίας μας.

3) Γνωρίζουμε ότι,

- οι συναλλαγές μας επί των άυλων τίτλων που θα εξυπηρετούνται μέσω του λογαριασμού καταθέσεων σε ευρώ της Εταιρίας μας, η σχετική διαδικασία που θα ακολουθείται για την ταυτοποίηση των συναλλαγών αυτών και

- η τιμολόγηση για εργασίες κίνησης κεφαλαίων του λογαριασμού καταθέσεων σε ευρώ της Εταιρίας μας,

έχουν ως εξής:

A. Συναλλαγές στην Πρωτογενή Αγορά

i) Αρχική Διάθεση Τίτλων

Στο Σύστημα θα αναγγέλεται με μια ειδοποίηση κατά κωδικό έκδοσης τίτλων, η τελική κατανομή των τίτλων, για το ίδιο χαρτοφυλάκιο μας και για το χαρτοφυλάκιο της πελατείας μας καθώς και οι αντίστοιχες αξίες διακανονισμού. Η πληρωμή της αξίας διακανονισμού των ειδοποιήσεων θα πραγματοποιείται είτε με αντίστοιχη χρέωση του λογαριασμού καταθέσεων σε ευρώ της Εταιρίας μας (εφόσον έχει επαρκές υπόλοιπο)

είτε συμφηφιστικά με την ταυτόχρονη παράδοση ειδοποιήσεων για συναλλαγές της Δευτερογενούς Αγοράς που αναφέρονται στην πώληση των αποκτηθέντων από την Πρωτογενή Αγορά τίτλων, με τίμημα ίσο ή μεγαλύτερο του κόστους απόκτησής των. Η τυχόν προκύπτουσα μετά το κλείσιμο του Συστήματος, θετική σε ευρώ διαφορά, θα κατατίθεται στο λογαριασμό καταθέσεων σε ευρώ της Εταιρίας μας. Αν η προκύπτουσα διαφορά είναι αρνητική, οι αντίστοιχες συναλλαγές θα γίνονται δεκτές για συμφηφισμό και τακτοποίηση από το Σύστημα, μόνο αν υπάρχει επαρκές υπόλοιπο στο λογαριασμό καταθέσεων σε ευρώ ή οι σχετικές ειδοποιήσεις μας συνοδεύονται από τραπεζική επιταγή σε διαταγή της Τραπέζης της Ελλάδος ή μετρητά για το ισόποσο της διαφοράς.

ii) Εξόφληση τίτλων στη λήξη και πληρωμή τοκομεριδίων

Στην ημερομηνία λήξης των τίτλων ή της πληρωμής των τοκομεριδίων, το Σύστημα θα πραγματοποιεί τις σχετικές πιστώσεις στο λογαριασμό καταθέσεων σε ευρώ της Εταιρίας μας. Κατά τα λοιπά θα ισχύουν τα αναφερόμενα στον Κανονισμό Λειτουργίας του Συστήματος.

B. Συναλλαγές στη Δευτερογενή Αγορά

i) Αγοραπωλησία τίτλων

Η αγορά τίτλων θα συνοδεύεται από πώληση, σε άλλους φορείς ή πελάτες άλλων φορέων, των ίδιων τίτλων με την ίδια ημερομηνία συμφηφισμού (valeur) (συναλλαγή back-to-back). Οι ειδοποιήσεις μας για το ζεύγος αυτό των συναλλαγών (μία ειδοποίηση για την αγορά και μία για την πώληση των ίδιων τίτλων), θα παραδίδονται ταυτόχρονα στο Σύστημα και η σε ευρώ διαφορά τους θα είναι ουδέτερη ή θετική υπέρ της Εταιρίας μας. Η προκύπτουσα θετική σε ευρώ διαφορά, θα κατατίθεται, μετά το κλείσιμο του Συστήματος, στο λογαριασμό καταθέσεων σε ευρώ της Εταιρίας μας. Εάν στην πράξη, υπάρχει ζεύγος ειδοποιήσεών μας για συναλλαγές back-to-back στο οποίο όμως, το συνολικό τίμημα της πώλησης υπολείπεται του τιμήματος αγοράς, τότε οι αντίστοιχες συναλλαγές θα γίνονται δεκτές από το Σύστημα μόνο στις περιπτώσεις που η διαφορά καλύπτεται από ανάλογο πιστωτικό υπόλοιπο του λογαριασμού καταθέσεων σε ευρώ της Εταιρίας μας ή από Τραπεζική επιταγή που προσκομίζεται άμεσα στο Τμήμα Διαχείρισης Τίτλων με Λογιστική Μορφή ή τέλος από μετρητά που κατατίθενται στα Ταμεία της Τράπεζας της Ελλάδος. Εάν δεν συντρέχει καμία από τις παραπάνω περιπτώσεις, οι ειδοποιήσεις δεν θα εισάγονται για συμφηφισμό στο Σύστημα και θα ακυρώνονται άμεσα.

ii) Άλλες συναλλαγές

Το σύστημα δεν θα διενεργεί συναλλαγές που δημιουργούν την ανάγκη μελλοντικής ταμειακής κίνησης στον λογαριασμό καταθέσεων σε ευρώ της Εταιρίας μας. Όλες οι άλλες συναλλαγές που αναφέρονται στον Κανονισμό Λειτουργίας του Συστήματος που δεν δημιουργούν την ανάγκη μελλοντικής ταμειακής κίνησης στο λογαριασμό καταθέσεων σε ευρώ της Εταιρίας μας (π.χ. μεταβίβαση τίτλων χωρίς ταμειακή κίνηση, εσωτερική μεταβίβαση, ενεχυρίαση τίτλων για συναλλαγές εκτός Συστήματος, ακυρώσεις), θα πραγματοποιούνται σύμφωνα με τα αναφερόμενα στον Κανονισμό Λειτουργίας του Συστήματος.

Γ. Χρονικό όριο παράδοσης των ειδοποιήσεων

Οι ειδοποιήσεις για τις συναλλαγές που περιλαμβάνονται στις παραπάνω παραγράφους 2.Α.ι) και 2.Β.ι), θα παραδίδονται στο Σύστημα δύο ώρες -το αργότερο- μετά το άνοιγμα του Συστήματος την ημέρα συμψηφισμού (valeur) των συναλλαγών.

Δ. Τιμολόγηση για εργασίες κίνησης κεφαλαίων

(α) Η έκδοση εντολής μεταφοράς υπέρ της Εταιρίας μας,

i) είτε για την απ' ευθείας απόδοση του προϊόντος εξόφλησης άυλων τίτλων στη λήξη ή των τοκομεριδίων τους,

ii) είτε με χρέωση του λογαριασμού καταθέσεων σε ευρώ της Εταιρίας μας,

απαλλάσσεται από προμήθεια.

(β) Κάθε εντολή πληρωμής που δημιουργείται από τον διακανονισμό συναλλαγών στο Σύστημα οι οποίες αφορούν στην Εταιρία μας και συνεπάγεται χρέωση της Τράπεζας της Ελλάδος στην Ενιαία Κοινή Πλατφόρμα (Ε.Κ.Π.) θα χρεώνεται με 0,80 ευρώ.

Αθήνα,
(Ημερομηνία)

.....
(Υπογραφές, ονόματα και βαθμός – θέση των
νομίμων εκπροσώπων της Εταιρίας μας)

Υπόδειγμα 3

ΠΡΑΞΕΙΣ ΕΠΙ ΤΙΤΛΩΝ

ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ		
Όνομα :	Κωδικός	1
Κωδικός συναλλαγής *		2
Ημερομηνία συμφωνίας της συναλλαγής		3
Αριθμός αποστολής		4
Σχετικό		5
Κωδικός λογαριασμού τίτλων		8
Θέση αποστολέα *		9
Ημερομηνία συμφητισμού (valeur) της συναλλαγής		10
ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ		
Όνομα :	Κωδικός	12
Για εσωτερική μεταβίβαση : Πιστούμενος λογαριασμός		13
ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΩΝ ΤΙΤΛΩΝ		
Στοιχεία έκδοσης :		14
Ημερομηνία λήξης : ... / ... / ...	Κωδικός ISIN	15
Ονομαστική αξία		16
Αξία διακανονισμού		
REPOS		
Ημερομηνία λήξης της συναλλαγής		11
Αξία διακανονισμού στη λήξη		17
ΠΕΡΙΘΩΡΙΟ ΠΡΑΞΗΣ REPOS		
Έτος αποστολής της αρχικής ειδοποίησης		6
Αριθμός αποστολής της αρχικής ειδοποίησης		7
Αξία διακανονισμού στη λήξη		31
Κατεύθυνση λογιστικοποίησης αξίας διακανονισμού		32
Κατεύθυνση λογιστικοποίησης αξίας διακανονισμού στη λήξη		34
ΑΚΥΡΩΣΗ		
Στοιχεία της αρχικής ειδοποίησης		
Έτος αποστολής της αρχικής ειδοποίησης		6
Αριθμός αποστολής της αρχικής ειδοποίησης		7

ΚΛΕΙΔΑ ΔΙΑΣΦΑΛΙΣΗΣ

(Υπογραφή - Σφραγίδα)

* Σχετική κωδικοποίηση παρατίθεται στην πίσω σελίδα

ΚΩΔΙΚΟΙ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ

ΑΓΟΡΑ/ΠΩΛΗΣΗ : 10

ΜΕΤΑΒΙΒΑΣΗ ΤΙΤΛΩΝ ΧΩΡΙΣ ΤΑΜΕΙΑΚΗ ΚΙΝΗΣΗ : 21

ΕΣΩΤΕΡΙΚΗ ΜΕΤΑΒΙΒΑΣΗ : 22

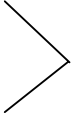
REPOS ΕΠΙ ΤΙΤΛΩΝ : 70

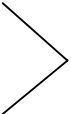
ΠΕΡΙΘΩΡΙΟ ΠΡΑΞΗΣ REPOS : 75

"BUY/SELL BACK" ΤΙΤΛΩΝ : 78

ΑΚΥΡΩΣΗ : 90

ΘΕΣΗ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ

ΑΓΟΡΑΣΤΗΣ
ΛΗΠΤΗΣ  A

ΠΩΛΗΤΗΣ
ΔΟΤΗΣ  V

ΧΡΕΟΥΜΕΝΟΣ : D

ΠΙΣΤΟΥΜΕΝΟΣ : C

Υπόδειγμα 4

SWAP ΕΠΙ ΤΙΤΛΩΝ

ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ		
Όνομα :	Κωδικός	1
Κωδικός συναλλαγής *		2
Ημερομηνία συμφωνίας της συναλλαγής		3
Αριθμός αποστολής		4
Σχετικό		5
Κωδικός λογαριασμού τίτλων		8
Ημερομηνία συμψηφισμού (valeur) της συναλλαγής		10
Ημερομηνία λήξης της συναλλαγής		11
ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ		
Όνομα :	Κωδικός	12
ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΠΑΡΑΔΟΘΕΤΩΝ ΤΙΤΛΩΝ		
Στοιχεία έκδοσης :		
Ημερομηνία λήξης : / /	Κωδικός ISIN	14
Ονομαστική αξία		15
ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΠΑΡΑΛΗΦΘΕΤΩΝ ΤΙΤΛΩΝ		
Στοιχεία έκδοσης :		
Ημερομηνία λήξης : / /	Κωδικός ISIN	25
Ονομαστική αξία		26
ΚΑΤΑΒΛΗΤΕΟ ΠΟΣΟ ΚΑΙ ΔΙΚΑΙΟΥΧΟΣ		
Ποσό σε ευρώ		27
Δικαιούχος *		28
ΑΚΥΡΩΣΗ		
Στοιχεία της αρχικής ειδοποίησης		
Έτος αποστολής της αρχικής ειδοποίησης		6
Αριθμός αποστολής της αρχικής ειδοποίησης		7

ΚΛΕΙΔΑ ΔΙΑΣΦΑΛΙΣΗΣ

(Υπογραφή - Σφραγίδα)

* Σχετική κωδικοποίηση παρατίθεται στην πίσω σελίδα

ΚΩΔΙΚΟΙ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ

SWAP ΕΠΙ ΤΙΤΛΩΝ : 60

ΑΚΥΡΩΣΗ : 90

ΔΙΚΑΙΟΥΧΟΣ ΤΟΥ ΠΟΣΟΥ

Ο ΑΠΟΣΤΟΛΕΑΣ ΤΗΣ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΗΣ : Ε

Ο ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΣ : C

Υπόδειγμα 5

ΔΑΝΕΙΣΜΟΣ ΤΙΤΛΩΝ

ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ		
Όνομα :	Κωδικός	1
Κωδικός συναλλαγής *		2
Ημερομηνία συμφωνίας της συναλλαγής		3
Αριθμός αποστολής		4
Σχετικό		5
Κωδικός λογαριασμού τίτλων		8
Θέση αποστολέα *		9
Ημερομηνία συμφηφισμού (valeur) της συναλλαγής		10
Ημερομηνία λήξης της συναλλαγής		10
ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ		
Όνομα :	Κωδικός	12
ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΔΑΝΕΙΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ		
Στοιχεία έκδοσης :		
Ημερομηνία λήξης : / /	Κωδικός ISIN	14
Ονομαστική αξία		15
ΚΑΤΑΒΑΛΛΟΜΕΝΟΣ ΤΟΚΟΣ		
Ποσό σε ευρώ		18
ή Βάση υπολογισμού		19
και επιτόκιο		20
ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΕΝΕΧΥΡΑΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ		
Στοιχεία έκδοσης :		
Ημερομηνία λήξης : / /	Κωδικός ISIN	21
Ονομαστική αξία		22
ΑΚΥΡΩΣΗ		
Στοιχεία της αρχικής ειδοποίησης		
Έτος αποστολής της αρχικής ειδοποίησης		6
Αριθμός αποστολής της αρχικής ειδοποίησης		7

ΚΛΕΙΔΑ ΔΙΑΣΦΑΛΙΣΗΣ

.....
(Υπογραφή - Σφραγίδα)

ΚΩΔΙΚΟΙ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ

ΑΠΛΟ ΔΑΝΕΙΟ : 41

ΔΑΝΕΙΟ ΕΝΑΝΤΙ ΕΝΕΧΥΡΟΥ : 42

ΑΚΥΡΩΣΗ : 90

ΘΕΣΗ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ

ΔΑΝΕΙΣΤΗΣ : Ρ

ΔΑΝΕΙΖΟΜΕΝΟΣ : Ε

Υπόδειγμα 6

ΕΝΕΧΥΡΑΣΗ ΤΙΤΛΩΝ

ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ		
Όνομα :	Κωδικός	1
Κωδικός συναλλαγής *		2
Ημερομηνία συμφωνίας της συναλλαγής		3
Αριθμός αποστολής		4
Σχετικό		5
Κωδικός λογαριασμού τίτλων		8
Θέση αποστολέα *		9
Ημερομηνία συμφητισμού (valeur) της συναλλαγής		10
ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ		
Όνομα :	Κωδικός	12
ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΕΝΕΧΥΡΑΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ		
Στοιχεία έκδοσης :		
Ημερομηνία λήξης : ... / ... / ...	Κωδικός ISIN	21
Ονομαστική αξία		22
ΑΚΥΡΩΣΗ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΗΣ ή ΑΠΟΔΕΣΜΕΥΣΗ ΕΝΕΧΥΡΟΥ		
Στοιχεία της αρχικής ειδοποίησης		
Έτος αποστολής της αρχικής ειδοποίησης		6
Αριθμός αποστολής της αρχικής ειδοποίησης		7

ΚΛΕΙΔΑ ΔΙΑΣΦΑΛΙΣΗΣ

.....
(Υπογραφή - Σφραγίδα)

* Σχετική κωδικοποίηση παρατίθεται στην πίσω σελίδα

ΚΩΔΙΚΟΙ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ

ΕΝΕΧΥΡΑΣΗ : 51

ΑΠΟΔΕΣΜΕΥΣΗ ΕΝΕΧΥΡΟΥ : 59

ΑΚΥΡΩΣΗ : 90

ΘΕΣΗ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ

ΔΟΤΗΣ ΕΝΕΧΥΡΟΥ : D

Υπόδειγμα 7

ΑΝΑΓΓΕΛΙΑ ΑΠΟΚΤΗΣΗΣ ΤΙΤΛΩΝ ΣΤΗΝ ΠΡΩΤΟΓΕΝΗ ΑΓΟΡΑ
ΚΑΙ ΚΑΤΑΝΟΜΗΣ ΤΩΝ ΣΕ ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΑ

ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ																						
Όνομα : Κωδικός	1	<table><tr><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr></table>																				
Κωδικός συναλλαγής	2	<table><tr><td>8</td><td>1</td></tr></table>	8	1																		
8	1																					
Ημερομηνία συμφωνίας της συναλλαγής	3	<table><tr><td>2</td><td>0</td><td>0</td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr></table>	2	0	0																	
2	0	0																				
Αριθμός αποστολής	4	<table><tr><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr></table>																				
Σχετικό	5																					
Ημερομηνία απόκτησης των τίτλων		10																				
		<table><tr><td>2</td><td>0</td><td>0</td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr></table>	2	0	0																	
2	0	0																				
ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΤΩΝ ΤΙΤΛΩΝ																						
Στοιχεία έκδοσης :																						
Ημερομηνία λήξης : / / Κωδικός ISIN	14	GR <table><tr><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr></table>																				
Λογαριασμός τίτλων (Ι.Χ., Χ.Π., Χ.Π.Ε.Ε., Χ.Π.Τ.Χ.)	8	100 - <table><tr><td>8</td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr></table> - <table><tr><td></td><td></td></tr></table>	8																			
8																						
Ονομαστική αξία	15																					
Αξία διακανονισμού	16																					

ΚΛΕΙΔΑ ΔΙΑΣΦΑΛΙΣΗΣ

.....
(Υπογραφή - Σφραγίδα)

Υπόδειγμα 8

ΑΝΤΙΚΑΤΑΣΤΑΣΗ ΕΝΕΧΥΡΟΥ ΤΙΤΛΩΝ

ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ		
Όνομα :	Κωδικός	1
Κωδικός συναλλαγής		2
Ημερομηνία συμφωνίας της συναλλαγής		3
Αριθμός αποστολής		4
Σχετικό		5
Κωδικός λογαριασμού τίτλων		8
Θέση αποστολέα		9
Ημερομηνία συμψηφισμού (valeur) της συναλλαγής		10
ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ		
Όνομα :	Κωδικός	12
ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΑΠΟΔΕΣΜΕΥΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ		
Στοιχεία έκδοσης :		
Ημερομηνία λήξης : ... / ... / ...	Κωδικός ISIN	23
Ονομαστική αξία συναλλαγής		24
ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΕΝΕΧΥΡΑΖΟΜΕΝΩΝ ΤΙΤΛΩΝ		
Στοιχεία έκδοσης :		
Ημερομηνία λήξης : ... / ... / ...	Κωδικός ISIN	21
Ονομαστική αξία συναλλαγής		22
Στοιχεία της αρχικής ειδοποίησης		
Έτος αποστολής της αρχικής ειδοποίησης		6
Αριθμός αποστολής της αρχικής ειδοποίησης		7

ΚΛΕΙΔΑ ΔΙΑΣΦΑΛΙΣΗΣ

.....
(Υπογραφή - Σφραγίδα)

Υπόδειγμα 9

ΑΠΟΣΥΝΔΕΣΗ ΤΟΚΟΜΕΡΙΔΙΩΝ ΟΜΟΛΟΓΟΥ

ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ		
Όνομα :..... Κωδικός :	1	
Κωδικός συναλλαγής	2	2 1
Ημερομηνία συμφωνίας της συναλλαγής	3	2 0 0
Αριθμός αποστολής	4	
Σχετικό	5	
Κωδικός λογαριασμού τίτλων	8	100 - 8
Θέση αποστολέα	9	V
Ημερομηνία συμψηφισμού (valeur) της συναλλαγής	10	2 0 0
ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ		
Όνομα :..... Κωδικός :	12	
ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΩΝ ΤΙΤΛΩΝ		
Στοιχεία έκδοσης :		
Ημερομηνία λήξης : ... / ... / ... Κωδικός ISIN :	14	GR
Ονομαστική αξία	15	
Επιτόκιο τοκομεριδίου τρέχουσας τοκοφόρου περιόδου	X	
ISIN παραγώγων τίτλων	X	
	X	

ΚΛΕΙΔΑ ΔΙΑΣΦΑΛΙΣΗΣ

.....
(Υπογραφή - Σφραγίδα)

Υπόδειγμα 10

ΕΠΑΝΑΣΥΝΔΕΣΗ ΤΟΚΟΜΕΡΙΔΙΩΝ ΟΜΟΛΟΓΟΥ

ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΑΠΟΣΤΟΛΕΑ														
Όνομα :..... Κωδικός :	1	<table border="1"><tr><td></td><td></td><td></td><td></td></tr></table>												
Κωδικός συναλλαγής	2	<table border="1"><tr><td>2</td><td>1</td></tr></table>	2	1										
2	1													
Ημερομηνία συμφωνίας της συναλλαγής	3	<table border="1"><tr><td>2</td><td>0</td><td>0</td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr></table>	2	0	0									
2	0	0												
Αριθμός αποστολής	4	<table border="1"><tr><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr></table>												
Σχετικό	5													
Κωδικός λογαριασμού τίτλων	8	100 - <table border="1"><tr><td>8</td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr></table> - <table border="1"><tr><td></td><td></td></tr></table>	8											
8														
Θέση αποστολέα	9	<table border="1"><tr><td>V</td></tr></table>	V											
V														
Ημερομηνία συμψηφισμού (valeur) της συναλλαγής	10	<table border="1"><tr><td>2</td><td>0</td><td>0</td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr></table>	2	0	0									
2	0	0												
ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ														
Όνομα :..... Κωδικός :	12	<table border="1"><tr><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr></table>												
ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΚΔΟΣΗΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΩΝ ΤΙΤΛΩΝ														
Στοιχεία έκδοσης :														
Ημερομηνία λήξης : / / Κωδικός ISIN :	14	GR <table border="1"><tr><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr></table>												
Ονομαστική αξία	15													
Επιτόκιο τοκομεριδίου τρέχουσας τοκοφόρου περιόδου	X	<table border="1"><tr><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr></table>												
ISIN αρχικού ομολόγου και τοκομεριδίων	X													
	X													

ΚΛΕΙΔΑ ΔΙΑΣΦΑΛΙΣΗΣ

(Υπογραφή - Σφραγίδα)

Παράρτημα 1

ΥΠΟΛΟΓΙΣΜΟΣ ΚΩΔΙΚΩΝ ΕΛΕΓΧΟΥ

Οι ελληνικοί τίτλοι που παρακολουθούνται από το Σύστημα έχουν την κωδικοποίηση (ISIN) :

GRANANANAYYZ

όπου : GR είναι ο ISO κωδικός της Ελλάδος (GR-GREECE),
ANANANA είναι αλφαριθμητικοί χαρακτήρες που αποτελούν τον κωδικό έκδοσης,
YY και Z είναι κωδικοί ελέγχου.

1.1 Υπολογισμός του Κ. Α. ελέγχου YY τίτλου με ISIN GRANANANAYYZ

Αποκωδικοποιούμε όσα λατινικά γράμματα περιέχονται στον κωδικό έκδοσης του τίτλου σύμφωνα με τον παρακάτω πίνακα

A = 10	F = 15	K = 20	P = 25	U = 30	Z = 35
B = 11	G = 16	L = 21	Q = 26	V = 31	
C = 12	H = 17	M = 22	R = 27	W = 32	
D = 13	I = 18	N = 23	S = 28	X = 33	
E = 14	J = 19	O = 24	T = 29	Y = 34	

και διαιρούμε τον αριθμό (αρχικός) που προκύπτει με το 97. Από το πηλίκο της διαίρεσης απορρίπτουμε το δεκαδικό μέρος και πολλαπλασιάζουμε το ακέραιο επί 97. Αφαιρούμε το γινόμενο από τον αρχικό αποκωδικοποιημένο αριθμό και το αποτέλεσμα αποτελεί τον Κ. Α. ελέγχου YY. Αν το αποτέλεσμα είναι μονοψήφιος αριθμός διάφορος του 0 τότε στη θέση του πρώτου Y γράφουμε 0. Αν το αποτέλεσμα είναι 0 τότε στη θέση του YY γράφουμε το 97.

Παράδειγμα

Έστω ότι έχουμε την έκδοση τίτλου με κωδικό **GR01A2B3EYYZ**. Αποκωδικοποιούμε τα A, B, E σύμφωνα με τον πιο πάνω πίνακα και έχουμε : **GR0110211314YYZ**

Διαιρούμε τον αριθμό 0110211314 με το 97. Το πηλίκο είναι 1136199,113402. Κρατάμε το 1136199 και το πολλαπλασιάζουμε επί 97. Το γινόμενο είναι 110211303 το οποίο αφαιρούμε από τον αρχικό αριθμό 110211314 και βρίσκουμε τον αριθμό 11. **Το 11 αποτελεί τον Κ.Α. ελέγχου YY** και έτσι ο κωδικός έκδοσης γράφεται: **GR01A2B3E11Z**

1.2 Υπολογισμός του Κ. Α. ελέγχου Z τίτλου με ISIN GRANANANAYYZ (ISO 6166 Annex A)

Μετά τον υπολογισμό του κωδικού YY, αποκωδικοποιούμε τα λατινικά γράμματα του GRANANANAYYZ σύμφωνα με τον πιο πάνω πίνακα, ώστε να προκύψουν μόνο αριθμοί. Ξεκινώντας πάντα από δεξιά, πολλαπλασιάζουμε τους αριθμούς που βρίσκουμε στις μονές θέσεις με το 2 και αυτούς που βρίσκονται στις ζυγές θέσεις με το 1. Αθροίζουμε ένα-ένα τα ψηφία του αποτελέσματος και τον αριθμό που θα προκύψει τον αφαιρούμε από την επόμενη δεκάδα. Αν το αποτέλεσμα είναι μονοψήφιος αριθμός, αυτός είναι και ο κωδικός ελέγχου. Αν το αποτέλεσμα είναι το 10 τότε ο κωδικός ελέγχου είναι 0. Ο Κ.Α. ελέγχου γράφεται στη θέση του Z.

Παράδειγμα

Έστω ότι έχουμε την έκδοση τίτλου με κωδικό GR01A2B3EYYZ. Στη θέση του YY βάζουμε τον αριθμό 11 οπότε ο κωδικός έκδοσης γράφεται GR01A2B3E11Z
Αποκωδικοποιούμε τον κωδικό αυτό και έχουμε :

1 6 2 7 0 1 1 0 2 1 1 3 1 4 1 1

Πολλαπλασιάζουμε τις μονές και τις ζυγές θέσεις όπως αναφέρεται παραπάνω και έχουμε τον αριθμό 112214021022161812. Αθροίζουμε ένα-ένα τα ψηφία του αποτελέσματος, δηλαδή $1+1+2+2+1+4+0+2+1+0+2+2+1+6+1+8+1+2$ και βρίσκουμε τον αριθμό 37. Τον αριθμό αυτόν αφαιρούμε από την επομένη δεκάδα που είναι το 40 και έτσι έχουμε **Κ. Α. ελέγχου Z το 3**.

Τελικά ο τίτλος έχει το εξής ISIN : **GR01A2B3E113**

Παράρτημα 2

ΚΩΔΙΚΟΙ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ

ΣΥΝΑΛΛΑΓΗ	ΚΩΔΙΚΟΣ	ΧΡΗΣΙΜΟΠΟΙΕΙΤΑΙ ΠΡΩΤΟΓΕΝΩΣ ΑΠΟ :	
		<u>ΤΟ ΣΥΣΤΗΜΑ</u>	<u>ΤΟΥΣ ΣΥΜΜΕΤΕΧΟΝΤΕΣ</u>
ΑΓΟΡΑ/ΠΩΛΗΣΗ	10	OXI	NAI
ΣΥΝΑΛΛΑΓΗ ΧΩΡΙΣ ΤΑΜΕΙΑΚΗ ΚΙΝΗΣΗ	21	OXI	NAI
ΕΣΩΤΕΡΙΚΗ ΜΕΤΑΦΟΡΑ	22	OXI	NAI
ΑΠΟΡΡΟΦΗΣΗ ΤΙΤΛΩΝ	30	NAI	OXI
ΕΓΓΡΑΦΗ ΣΕ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟ	31	NAI	NAI
ΕΚΔΟΣΗ ΤΙΤΛΩΝ ΙΔΙΩΤΙΚΟΥ ΤΟΜΕΑ	32	OXI	NAI
ΑΠΛΟ ΔΑΝΕΙΟ	41	OXI	NAI
ΔΑΝΕΙΟ ΕΝΑΝΤΙ ΕΝΕΧΥΡΟΥ	42	OXI	NAI
ΛΗΞΗ ΔΑΝΕΙΟΥ ΚΑΘΟΡΙΣΜΕΝΗΣ ΔΙΑΡΚΕΙΑΣ	48	NAI	OXI
ΛΗΞΗ ΔΑΝΕΙΟΥ ΑΚΑΘΟΡΙΣΤΗΣ ΔΙΑΡΚΕΙΑΣ	49	OXI	NAI
ΕΝΕΧΥΡΑΣΗ	51	OXI	NAI
ΑΝΤΙΚΑΤΑΣΤΑΣΗ ΕΝΕΧΥΡΟΥ	58	OXI	NAI
ΑΠΟΔΕΥΣΜΕΥΣΗ ΕΝΕΧΥΡΟΥ	59	OXI	NAI
SWAP ΕΠΙ ΤΙΤΛΩΝ	60	OXI	NAI
ΛΗΞΗ SWAP ΕΠΙ ΤΙΤΛΩΝ	61	NAI	OXI
REPOS ΕΠΙ ΤΙΤΛΩΝ	70	OXI	NAI
ΛΗΞΗ REPOS	71	NAI	OXI
ΠΕΡΙΘΩΡΙΟ ΠΡΑΞΗΣ REPOS	75	OXI	NAI
"BUY/SELL BACK" ΤΙΤΛΩΝ	78	OXI	NAI
ΛΗΞΗ "BUY/SELL BACK"	79	NAI	OXI
ΑΝΑΓΓΕΛΙΑ ΑΠΟΚΤΗΣΗΣ ΤΙΤΛΩΝ ΣΤΗΝ Π.Α.	81	OXI	NAI
ΠΛΗΡΩΜΗ ΤΟΚΟΜΕΡΙΔΙΩΝ ΣΤΟΥΣ ΚΑΤΟΧΟΥΣ (προθεσμιακές πράξεις)	87	NAI	OXI
ΠΛΗΡΩΜΗ ΤΟΚΟΜΕΡΙΔΙΩΝ	88	NAI	OXI
ΕΞΟΦΛΗΣΗ ΤΙΤΛΩΝ ΣΤΗ ΛΗΞΗ	89	NAI	OXI
ΑΚΥΡΩΣΗ	90	OXI	NAI

Παράρτημα 3

ΟΔΗΓΙΕΣ ΓΙΑ ΤΗΝ ΑΠΟΣΤΟΛΗ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΕΩΝ ΜΕΣΩ SWIFT ΠΡΟΣ ΤΟ ΣΥΣΤΗΜΑ ΠΑΡΑΚΟΛΟΥΘΗΣΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ ΕΠΙ ΤΙΤΛΩΝ ΜΕ ΛΟΓΙΣΤΙΚΗ ΜΟΡΦΗ (ΑΨΛΩΝ ΤΙΤΛΩΝ)

1. ΕΙΣΑΓΩΓΗ

Το κείμενο αυτό απευθύνεται σε εκείνους τους φορείς που συμμετέχουν στο Σύστημα Παρακολούθησης Συναλλαγών επί Τίτλων με Λογιστική Μορφή (για συντομία 'Σύστημα') που λειτουργεί στην Τράπεζα της Ελλάδος σύμφωνα με το Νόμο 2198/94.

Το SWIFT έχει ορίσει ότι για την αποστολή μηνυμάτων που αναφέρονται σε πράξεις επί τίτλων (έντοκα, ομόλογα κλπ.), θα χρησιμοποιείται η κατηγορία 5 : SECURITIES. Σε όλα τα μηνύματα επιβάλλεται να μην καταστρατηγούνται τα "standards" του SWIFT και οπωσδήποτε πρέπει να χρησιμοποιούνται τα κεφαλαία λατινικά γράμματα.

Όλα τα μηνύματα SWIFT που αποτελούν ειδοποιήσεις για συναλλαγές επί τίτλων με λογιστική μορφή (άυλων τίτλων), πρέπει να αποστέλλονται προς την ειδική διεύθυνση SWIFT "BNGRGRAASS", προκειμένου να διαβιβάζονται απ' ευθείας για επεξεργασία στο Σύστημα.

2. ΔΟΜΗ ΤΩΝ ΜΗΝΥΜΑΤΩΝ SWIFT

Κάθε μήνυμα SWIFT αποτελείται από τρία τμήματα :

- Την επικεφαλίδα (HEADER)
- Το κείμενο (TEXT)
- Το τέλος (TRAILER)

Η επικεφαλίδα και το τέλος αποτελούν το "εξωτερικό μέρος" ενός μηνύματος SWIFT.

Επικεφαλίδα (HEADER)

Συμπληρώνεται από τον αποστολέα και περιέχει κυρίως τα στοιχεία :

- Τύπος μηνύματος 5NN (N = αριθμητικό στοιχείο)
- Αποστολέας (UID SWIFT) 8 ή 12 στοιχεία AN (AN = αλφαριθμητικό στοιχείο)
- Παραλήπτης (UID SWIFT) 8 ή 12 στοιχεία AN
- Ημερομηνία/ώρα αποστολής κλπ.

Κείμενο (TEXT)

Το κείμενο αποτελείται από "ακολουθίες" (sequences) πληροφοριών, επαναλαμβανόμενες ή μη. Κάθε "ακολουθία" μπορεί να περιέχει "υποακολουθίες" (subsequences), επαναλαμβανόμενες ή μη, με συναφείς πληροφορίες και έχουν διακριτικά αρχής και τέλους (Start of block - end of block). Οι πληροφορίες καταχωρούνται σε πεδία (fields). Άλλα πεδία συμπληρώνονται υποχρεωτικά από τον αποστολέα και άλλα προαιρετικά. Από τις πληροφορίες που περιέχονται στα πεδία άλλες είναι απαραίτητες για να γίνει μια συναλλαγή και άλλες παραβλέπονται.

Τέλος (TRAILER)

Το τμήμα αυτό περιέχει διάφορα στοιχεία όπως :

- Κλειδαρίθμηση (Το μήνυμα κλειδαριθμείται αυτόματα).
- Ένδειξη πιθανού διπλού μηνύματος : PDM ή PDE.
- Ένδειξη καθυστέρησης επίδοσης μηνύματος κλπ.

Στα στοιχεία του τμήματος αυτού δεν επεμβαίνει ο αποστολέας.

3. ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΕΙΣ ΓΙΑ ΣΥΝΑΛΛΑΓΕΣ ΕΠΙ ΤΙΤΛΩΝ ΠΟΥ ΑΠΟΣΤΕΛΛΟΥΝ ΟΙ ΣΥΜΜΕΤΕΧΟΝΤΕΣ ΦΟΡΕΙΣ ΠΡΟΣ ΤΟ ΣΥΣΤΗΜΑ ΜΕΣΩ SWIFT

Ανάλογα με τη συναλλαγή αποστέλλονται από τους συμμετέχοντες φορείς προς το Σύστημα μηνύματα SWIFT που αφορούν τις παρακάτω πραγματοποιηθείσες συναλλαγές :

- 3.1) **Αγορά τίτλων**
Κωδικός συναλλαγής = 10, Τύπος μηνύματος = MT 541
- 3.2) **Πώληση τίτλων**
Κωδικός συναλλαγής = 10, Τύπος μηνύματος = MT 543
- 3.3) **Παραλαβή τίτλων χωρίς ταμειακή κίνηση**
Κωδικός συναλλαγής = 21, Τύπος μηνύματος = MT 540
- 3.4) **Παράδοση τίτλων χωρίς ταμειακή κίνηση**
Κωδικός συναλλαγής = 21, Τύπος μηνύματος = MT 542
- 3.5) **Εσωτερική μεταβίβαση (σε λογ/μούς τίτλων του αποστολέα)**
Κωδικός συναλλαγής = 22, Τύπος μηνύματος = MT 542
- 3.6) **Repos επί τίτλων – Αγορά τίτλων**
Κωδικός συναλλαγής = 70 Τύπος μηνύματος = MT 541
- 3.7) **Repos επί τίτλων – Πώληση τίτλων**
Κωδικός συναλλαγής = 70 Τύπος μηνύματος = MT 543
- 3.8) **Buy/sell back – Αγορά τίτλων**
Κωδικός συναλλαγής = 78 Τύπος μηνύματος = MT 541
- 3.9) **Buy/sell back – Πώληση τίτλων**
Κωδικός συναλλαγής = 78 Τύπος μηνύματος = MT 543
- 3.10) **Περιθώρια πράξης “repos” επί τίτλων – Αγορά τίτλων**
Κωδικός συναλλαγής = 75 Τύπος Μηνύματος = MT 599
- 3.11) **Περιθώρια πράξης “repos” επί τίτλων – Πώληση τίτλων**
Κωδικός συναλλαγής = 75 Τύπος Μηνύματος = MT 599
- 3.12) **Δανεισμός τίτλων – Δανειζόμενος τίτλους**
Κωδικός συναλλαγής = 41 Τύπος Μηνύματος = MT 540
- 3.13) **Δανεισμός τίτλων – Δανειστής τίτλων**
Κωδικός συναλλαγής = 41 Τύπος Μηνύματος = MT 542
- 3.14) **Λήξη δανείου τίτλων αόριστης διάρκειας – Δανειστής τίτλων**
Κωδικός συναλλαγής = 49 Τύπος Μηνύματος = MT 599
- 3.15) **Δανεισμός τίτλων έναντι ενεχύρου – Δανειζόμενος τίτλους**
Κωδικός συναλλαγής = 42 Τύπος Μηνύματος = MT 599
- 3.16) **Δανεισμός τίτλων έναντι ενεχύρου – Δανειστής τίτλων**
Κωδικός συναλλαγής = 42 Τύπος Μηνύματος = MT 599

3.17) Ενεχύραση τίτλων για συναλλαγές εκτός Συστήματος – Ενεχυράζων τίτλους

Κωδικός συναλλαγής = 51 Τύπος Μηνύματος = MT 542

3.18) Ενεχύραση τίτλων για συναλλαγές εκτός Συστήματος – Ενεχυρούχος δανειστής

Κωδικός συναλλαγής = 51 Τύπος Μηνύματος = MT 540

3.19) Αντικατάσταση ενεχύρου τίτλων – Ενεχυράζων τίτλους

Κωδικός συναλλαγής = 58 Τύπος Μηνύματος = MT 542

Ισχύει και για μερική αποδέσμευση τίτλων.

3.20) Αντικατάσταση ενεχύρου τίτλων – Ενεχυρούχος δανειστής

Κωδικός συναλλαγής = 58 Τύπος Μηνύματος = MT 540

Ισχύει και για μερική αποδέσμευση τίτλων.

3.21) Ολική αποδέσμευση ενεχύρου τίτλων – Ενεχυράζων τίτλους

Κωδικός συναλλαγής = 59 Τύπος Μηνύματος = MT 542

3.22) Ολική αποδέσμευση ενεχύρου τίτλων – Ενεχυρούχος δανειστής

Κωδικός συναλλαγής = 59 Τύπος Μηνύματος = MT 540

3.23) Αναγγελία απόκτησης τίτλων στην Πρωτογενή αγορά

Κωδικός συναλλαγής = 81 Τύπος Μηνύματος = MT 599

3.24) Εγγραφή τίτλων σε λογαριασμό

Κωδικός συναλλαγής = 31 Τύπος Μηνύματος = MT 599

3.25) Μετατροπή φυσικών τίτλων σε τίτλους με λογιστική μορφή

Κωδικός συναλλαγής = 31 Τύπος Μηνύματος = MT 599

3.26) "SWAP" επί τίτλων

Κωδικός συναλλαγής = 60 Τύπος Μηνύματος = MT 599

3.27) Ακύρωση μηνύματος που δεν έχει διακανονιστεί

Κωδικός συναλλαγής = 90

Αρχικό μήνυμα MT 540 – Ακυρωτικό μήνυμα MT 540

Αρχικό μήνυμα MT 541 – Ακυρωτικό μήνυμα MT 541

Αρχικό μήνυμα MT 542 – Ακυρωτικό μήνυμα MT 542

Αρχικό μήνυμα MT 543 – Ακυρωτικό μήνυμα MT 543

Αρχικό μήνυμα MT 599 – Ακυρωτικό μήνυμα MT 592

4. ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΜΗΝΥΜΑΤΩΝ ΠΟΥ ΑΠΟΣΤΕΛΛΟΥΝ ΟΙ ΣΥΜΜΕΤΕΧΟΝΤΕΣ ΦΟΡΕΙΣ ΠΡΟΣ ΤΟ ΣΥΣΤΗΜΑ

Προς το Σύστημα αποστέλλονται μηνύματα τύπου 540, 541, 542, 543, 592 και 599, τα στοιχεία των οποίων περιγράφονται παρακάτω. Ειδικότερα τα στοιχεία των μηνυμάτων 599 περιγράφονται στο συνημμένο πίνακα S1.

Για κάθε συναλλαγή αποστέλλεται από το φορέα μόνο ένα μήνυμα SWIFT μη επιτρεπόμενης της επαναληπτικότητας των "ακολουθιών" και "υποακολουθιών".

4.1) ΑΓΟΡΑ ΤΙΤΛΩΝ MT 541 RECEIVE AGAINST PAYMENT

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//16AN
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADDET
98A ή C	DATE/TIME	SETT//YYYYMMDD ή SETT//YYYYMMDDHHMMSS
98A	DATE	TRAD//YYYYMMDD
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRNNNNNNNNYYZ
70E	NARRATIVE	SPRO//10-ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ-ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
16S	END OF BLOCK	TRADDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE ή - COUPON UNITS	SETT//FAMT/15N,2 decimals ή SETT//UNIT/15N,
97A	ACCOUNT	SAFE//ΑΡΙΘΜΟΣ ΛΟΓ/ΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ
16S	END OF BLOCK	FIAC
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P ή Q	PARTY	DEAG//BIC ή DEAG//ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNGRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E3 AMOUNTS		
16R	START OF BLOCK	AMT
19A	AMOUNT	SETT//EUR15N,2 decimals
16S	END OF BLOCK	AMT
16S	END OF BLOCK	SETDET

Για να **ταυτοποιηθεί** το μήνυμα αυτό (αγοράς τίτλων), πρέπει το Σύστημα να λάβει και μια αντίστοιχη ειδοποίηση από τον αντισυμβαλλόμενο πωλητή. Αν η ειδοποίηση του πωλητή σταλεί μέσω SWIFT, τότε πρέπει να είναι μήνυμα τύπου 543 (MT 543).

ΠΑΡΑΔΕΙΓΜΑ

Την 22 Νοεμβρίου 2001 η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ (Κ.Α. 0001) αγοράζει για το λογαριασμό τίτλων ιδίου χαρτοφυλακίου της αρ. 100800010160 από την ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ (Κ.Α. 0007) έντοκα γραμμάτια ISIN GRXXXXXXX XXXX ονομαστικής αξίας 30.000.000 ευρώ. Η συναλλαγή συμφωνήθηκε να διακανονιστεί στις 26 Νοεμβρίου 2001 και ώρα 10.30 π.μ. και το αντίτιμο καθορίστηκε σε ευρώ 29.351.989,35

Η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ αποστέλλει προς το Σύστημα ένα MT 541 με αριθμό αποστολής 50008.

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//ANANANAN.....
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADEDET
98C	DATE/TIME	SETT//20011126103000
98A	DATE	TRAD//20011122
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRXXXXXXX XXXX
70E	NARRATIVE	SPRO//10-0001-50008
16S	END OF BLOCK	TRADEDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/30000000,
97A	ACCOUNT	SAFE//100800010160
16S	END OF BLOCK	FIAC
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P ή Q	PARTY	DEAG//EMPOGRAA ή DEAG//0007
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNGRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E3 AMOUNTS		
16R	START OF BLOCK	AMT
19A	AMOUNT	SETT//EUR29351989,35
16S	END OF BLOCK	AMT
16S	END OF BLOCK	SETDET

Αντίστοιχα η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ ως πωλήτρια, αν στείλει την δική της ειδοποίηση προς το Σύστημα μέσω SWIFT, θα χρησιμοποιήσει το MT 543 όπως περιγράφεται πιο κάτω (στην πώληση τίτλων).

4.2) ΠΩΛΗΣΗ ΤΙΤΛΩΝ

MT 543 DELIVER AGAINST PAYMENT

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//16AN
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADDET
98A ή C	DATE/TIME	SETT//YYYYMMDD ή SETT//YYYYMMDDHHMMSS
98A	DATE	TRAD//YYYYMMDD
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRNNNNNNNNYYZ
70E	NARRATIVE	SPRO//10-ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ-ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
16S	END OF BLOCK	TRADDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE ή - COUPON UNITS	SETT//FAMT/15N,2 decimals ή SETT//UNIT/15N,
97A	ACCOUNT	SAFE//ΑΡΙΘΜΟΣ ΛΟΓ/ΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ
16S	END OF BLOCK	FIAC
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P ή Q	PARTY	REAG//BIC ή REAG//ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E3 AMOUNTS		
16R	START OF BLOCK	AMT
19A	AMOUNT	SETT//EUR15N,2 decimals
16S	END OF BLOCK	AMT
16S	END OF BLOCK	SETDET

Για να **ταυτοποιηθεί** το μήνυμα αυτό (πώλησης τίτλων), πρέπει το Σύστημα να λάβει και μια αντίστοιχη ειδοποίηση από τον αντισυμβαλλόμενο αγοραστή. Αν η ειδοποίηση του αγοραστή σταλεί μέσω SWIFT τότε, όπως προαναφέρθηκε, πρέπει να είναι μήνυμα τύπου 541 (MT 541).

ΠΑΡΑΔΕΙΓΜΑ

Χρησιμοποιούμε το παράδειγμα της αγοράς τίτλων. Η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ πωλεί τους τίτλους από το λογαριασμό τίτλων ιδίου χαρτοφυλακίου της αρ. 100800070178.

Η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ αποστέλλει προς το Σύστημα ένα MT 543 με αριθμό αποστολής 34345.

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//ANANANAN.....
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADEDET
98C	DATE/TIME	SETT//20011126103000
98A	DATE	TRAD//20011122
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRXXXXXXXXXX
70E	NARRATIVE	SPRO//10-0007-34345
16S	END OF BLOCK	TRADEDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/300000000,
97A	ACCOUNT	SAFE//100800070178
16S	END OF BLOCK	FIAC
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P ή Q	PARTY	REAG//ETHNGRAA ή REAG//0001
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E3 AMOUNTS		
16R	START OF BLOCK	AMT
19A	AMOUNT	SETT//EUR29351989,35
16S	END OF BLOCK	AMT
16S	END OF BLOCK	SETDET

Αντίστοιχα η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ ως αγοράστρια, αν στείλει την δική της ειδοποίηση προς το Σύστημα μέσω SWIFT, θα χρησιμοποιήσει το MT 541 όπως περιγράφεται πιο πάνω (στην αγορά τίτλων).

4.3) ΠΑΡΑΛΑΒΗ ΤΙΤΛΩΝ ΧΩΡΙΣ ΤΑΜΕΙΑΚΗ ΚΙΝΗΣΗ MT 540 RECEIVE FREE

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//16AN
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADEDET
98A ή C	DATE/TIME	SETT//YYYYMMDD ή SETT//YYYYMMDDHHMMSS
98A	DATE	TRAD//YYYYMMDD
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRNNNNNNNNYYZ
70E	NARRATIVE	SPRO//21-ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ-ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
16S	END OF BLOCK	TRADEDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE ή - COUPON UNITS	SETT//FAMT/15N,2 decimals ή SETT//UNIT/15N,
97A	ACCOUNT	SAFE//ΑΡΙΘΜΟΣ ΛΟΓ/ΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ
16S	END OF BLOCK	FIAC
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P ή Q	PARTY	DEAG//BIC ή DEAG//ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNGRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16S	END OF BLOCK	SETDET

Για να **ταυτοποιηθεί** το μήνυμα αυτό πρέπει το Σύστημα να λάβει και μια αντίστοιχη ειδοποίηση από τον αντισυμβαλλόμενο που παραλαμβάνει τους τίτλους. Αν η ειδοποίηση αυτή σταλεί μέσω SWIFT, τότε πρέπει να είναι μήνυμα τύπου 542 (MT 542)

ΠΑΡΑΔΕΙΓΜΑ

Την 22 Νοεμβρίου 2001 η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ συμφωνεί να παραλάβει για το λογαριασμό τίτλων ιδίου χαρτοφυλακίου της αρ. 100800010160, από την ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ, χωρίς ταμειακή κίνηση, με ημερομηνία διακανονισμού (valeur) την 26 Νοεμβρίου 2001, έντοκα γραμμάτια ISIN GRXXXXXXXXXX ονομαστικής αξίας 15.000.000 ευρώ.

Η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ αποστέλλει προς το Σύστημα ένα MT 540 με αριθμό αποστολής 54762.

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//ANANANAN.....
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADEDET
98A	DATE/TIME	SETT//20011126
98A	DATE	TRAD//20011122
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRXXXXXXXXXX
70E	NARRATIVE	SPRO//21-0001-54762
16S	END OF BLOCK	TRADEDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/15000000,
97A	ACCOUNT	SAFE//100800010160
16S	END OF BLOCK	FIAC
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P ή Q	PARTY	DEAG//EMPOGRAA ή DEAG//0007
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16S	END OF BLOCK	SETDET

Αντίστοιχα η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ, αν στείλει τη δική της ειδοποίηση προς το Σύστημα μέσω SWIFT, θα χρησιμοποιήσει το MT 542 όπως περιγράφεται πιο κάτω (στην παράδοση τίτλων χωρίς ταμειακή κίνηση).

4.4) ΠΑΡΑΔΟΣΗ ΤΙΤΛΩΝ ΧΩΡΙΣ ΤΑΜΕΙΑΚΗ ΚΙΝΗΣΗ MT 542 DELIVER FREE

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//16AN
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADEDET
98A ή C	DATE/TIME	SETT//YYYYMMDD ή SETT//YYYYMMDDHHMMSS
98A	DATE	TRAD//YYYYMMDD

35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRNNNNNNNNYYZ
70E	NARRATIVE	SPRO//21-ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ-ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
16S	END OF BLOCK	TRADDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE ή - COUPON UNITS	SETT//FAMT/15N,2 decimals ή SETT//UNIT/15N,
97A	ACCOUNT	SAFE//ΑΡΙΘΜΟΣ ΛΟΓ/ΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ
16S	END OF BLOCK	FIAC
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P ή Q	PARTY	REAG//BIC ή REAG//ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16S	END OF BLOCK	SETDET

Για να **ταυτοποιηθεί** το μήνυμα αυτό πρέπει το Σύστημα να λάβει και μια αντίστοιχη ειδοποίηση από τον αντισυμβαλλόμενο που λαμβάνει τους τίτλους. Αν η ειδοποίηση αυτή σταλεί μέσω SWIFT τότε, όπως προαναφέρθηκε, πρέπει να είναι μήνυμα τύπου 540 (MT 540)

ΠΑΡΑΔΕΙΓΜΑ

Χρησιμοποιούμε το παράδειγμα της παραλαβής τίτλων χωρίς ταμειακή κίνηση. Η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ δίνει τους τίτλους αυτούς από το λογαριασμό τίτλων ιδίου χαρτοφυλακίου της αρ. 100800070178.

Η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ αποστέλλει προς το Σύστημα ένα MT 542 με αριθμό αποστολής 59768.

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//ANAN.....
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADDET
98A	DATE	SETT//20011126
98A	DATE	TRAD//20011122
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRXXXXXXXXXX
70E	NARRATIVE	SPRO//21-0007-59768

16S	END OF BLOCK	TRADDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/15000000,
97A	ACCOUNT	SAFE//100800070178
16S	END OF BLOCK	FIAC
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P ή Q	PARTY	REAG//ETHNGRAA ή REAG//0001
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNGRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16S	END OF BLOCK	SETDET

Αντίστοιχα η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ, αν στείλει τη δική της ειδοποίηση προς το Σύστημα μέσω SWIFT, θα χρησιμοποιήσει το MT 542 όπως περιγράφεται πιο πάνω (στην παραλαβή τίτλων χωρίς ταμειακή κίνηση).

4.5) ΕΣΩΤΕΡΙΚΗ ΜΕΤΑΒΙΒΑΣΗ ΤΙΤΛΩΝ MT 542 DELIVER FREE

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//16AN
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADDET
98A ή C	DATE/TIME	SETT//YYYYMMDD ή SETT//YYYYMMDDHHMMSS
98A	DATE	TRAD//YYYYMMDD
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRNNNNNNNNYYZ
70E	NARRATIVE	SPRO//22-ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ-ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
16S	END OF BLOCK	TRADDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE ή - COUPON UNITS	SETT//FAMT/15N,2 decimals ή SETT//UNIT/15N,
97A	ACCOUNT	SAFE//ΑΡΙΘΜΟΣ ΛΟΓ/ΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ
16S	END OF BLOCK	FIAC
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		

16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95Q	PARTY	REAG//ΑΡΙΘΜΟΣ ΛΟΓ/ΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNGRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16S	END OF BLOCK	SETDET

Το μήνυμα **δεν απαιτείται να ταυτοποιηθεί** με άλλη ειδοποίηση.

ΠΑΡΑΔΕΙΓΜΑ

Την 22 Νοεμβρίου 2001 η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ ζητά να πραγματοποιηθεί στις 26 Νοεμβρίου 2001 και ώρα 10.30 πμ μια εσωτερική μεταβίβαση εντόκων γραμματίων ISIN GRXXXXXXXXXX ονομαστικής αξίας 13.535,79 ευρώ από το λογαριασμό τίτλων χαρτοφυλακίου πελατείας της αρ. 100800011069 στο λογαριασμό τίτλων ιδίου χαρτοφυλακίου αρ. 100800010160. Η ειδοποίηση έχει αριθμό αποστολής 59768.

Η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ αποστέλλει προς το Σύστημα ένα MT 542.

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//NANANA.....
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADEDET
98C	DATE/TIME	SETT//20011126103000
98A	DATE	TRAD//20011122
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRXXXXXXXXXX
70E	NARRATIVE	SPRO//22-0001-59768
16S	END OF BLOCK	TRADEDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/13535,79
97A	ACCOUNT	SAFE//100800011069
16S	END OF BLOCK	FIAC
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95Q	PARTY	REAG//100800010160
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY

95P	PARTY	PSET//BNGRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16S	END OF BLOCK	SETDET

4.6) REPOS ΕΠΙ ΤΙΤΛΩΝ – ΑΓΟΡΑ MT 541 RECEIVE AGAINST PAYMENT

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//16AN
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADDET
98A ή C	DATE/TIME	SETT//YYYYMMDD ή SETT//YYYYMMDDHHMMSS
98A	DATE	TRAD//YYYYMMDD
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRNNNNNNNNYYZ
70E	NARRATIVE	SPRO//70-ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ-ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
16S	END OF BLOCK	TRADDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/15N,2 decimals
97A	ACCOUNT	SAFE//ΑΡΙΘΜΟΣ ΛΟΓ/ΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ
16S	END OF BLOCK	FIAC
OPTIONAL SEQUENCE D REPO DETAILS		
16R	START OF BLOCK	REPO
98A ή C	REPURCHASE DATE/TIME	TERM//YYYYMMDD ή TERM//YYYYMMDDHHMMSS
19A	REPURCHASE AMOUNT	REPA//EUR15N,2 decimals
16S	END OF BLOCK	REPO
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P ή Q	PARTY	DEAG//BIC ή DEAG//ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNGRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E3 AMOUNTS		
16R	START OF BLOCK	AMT
19A	AMOUNT	SETT//EUR15N,2 decimals
16S	END OF BLOCK	AMT
16S	END OF BLOCK	SETDET

Για να **ταυτοποιηθεί** το μήνυμα αυτό (repos τίτλων-αγορά), πρέπει το Σύστημα να λάβει και μια αντίστοιχη ειδοποίηση από τον αντισυμβαλλόμενο πωλητή. Αν η ειδοποίηση του σταλεί μέσω SWIFT, τότε πρέπει να είναι μήνυμα τύπου 543 (MT 543).

ΠΑΡΑΔΕΙΓΜΑ

Την 22 Νοεμβρίου 2001 η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ συμφωνεί με την ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ να αγοράσει με “repos” τίτλους ISIN GRXXXXXXXXXX για το λογαριασμό ιδίου χαρτοφυλακίου της αρ. 100800010160, με ημερομηνία διακανονισμού (valeur) την 26 Νοεμβρίου 2001 και λήξης του “repos” την 6 Δεκεμβρίου 2001 ονομαστικής αξίας 5.000.000 ευρώ, αξία διακανονισμού στην έναρξη 5.005.000 ευρώ και αξία διακανονισμού στη λήξη 5.010.000 ευρώ.

Η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ αποστέλλει προς το Σύστημα ένα MT 541 με αριθμό αποστολής 54765.

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//ANANANA.....
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADEDET
98A	DATE	SETT//20011126
98A	DATE	TRAD//20011122
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRXXXXXXXXXX
70E	NARRATIVE	SPRO//70-0001-54765
16S	END OF BLOCK	TRADEDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED -NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/5000000,
97A	ACCOUNT	SAFE//100800010160
16S	END OF BLOCK	FIAC
OPTIONAL SEQUENCE D REPO DETAILS		
16R	START OF BLOCK	REPO
98A	REPURCHASE DATE/TIME	TERM//20011206
19A	REPURCHASE AMOUNT	REPA//EUR5010000,
16S	END OF BLOCK	REPO
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	DEAG//EMPOGRAA
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNGRGRAASSS

16S	END OF BLOCK	SETPRTY
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E3 AMOUNTS		
16R	START OF BLOCK	AMT
19A	AMOUNT	SETT//EUR5005000,
16S	END OF BLOCK	AMT
16S	END OF BLOCK	SETDET

Αντίστοιχα η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ, αν στείλει τη δική της ειδοποίηση προς το Σύστημα μέσω SWIFT, θα χρησιμοποιήσει το MT 543 όπως περιγράφεται πιο κάτω (repos επί τίτλων – πώληση).

4.7) REPOS ΕΠΙ ΤΙΤΛΩΝ – ΠΩΛΗΣΗ MT 543 DELIVER AGAINST PAYMENT

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//16AN
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADEDET
98A ή C	DATE/TIME	SETT//YYYYMMDD ή SETT//YYYYMMDDHHMMSS
98A	DATE	TRAD//YYYYMMDD
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRNNNNNNNNYYZ
70E	NARRATIVE	SPRO//70-ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ-ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
16S	END OF BLOCK	TRADEDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/15N,2 decimals
97A	ACCOUNT	SAFE//ΑΡΙΘΜΟΣ ΛΟΓ/ΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ
16S	END OF BLOCK	FIAC
OPTIONAL SEQUENCE D REPO DETAILS		
16R	START OF BLOCK	REPO
98A ή C	REPURCHASE DATE/TIME	TERM//YYYYMMDD ή TERM//YYYYMMDDHHMMSS
19A	REPURCHASE AMOUNT	REPA//EUR15N,2 decimals
16S	END OF BLOCK	REPO
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P ή Q	PARTY	REAG//BIC ή REAG//ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNGRGRAASSS

16S	END OF BLOCK	SETPRTY
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E3 AMOUNTS		
16R	START OF BLOCK	AMT
19A	AMOUNT	SETT//EUR15N,2 decimals
16S	END OF BLOCK	AMT
16S	END OF BLOCK	SETDET

Για να **ταυτοποιηθεί** το μήνυμα αυτό (repos τίτλων-πώληση), πρέπει το Σύστημα να λάβει και μια αντίστοιχη ειδοποίηση από τον αντισυμβαλλόμενο αγοραστή. Αν η ειδοποίηση του σταλεί μέσω SWIFT, τότε πρέπει να είναι μήνυμα τύπου 541 (MT 541).

ΠΑΡΑΔΕΙΓΜΑ

Χρησιμοποιούμε το παράδειγμα του “repos” επί τίτλων - αγορά. Η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ παραδίδει τους τίτλους από το λογαριασμό τίτλων ιδίου χαρτοφυλακίου της αρ. 100800070178.

Η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ αποστέλλει προς το Σύστημα ένα MT 543 με αριθμό αποστολής 35647.

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//NAAA...
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADEDET
98A	DATE	SETT//20011126
98A	DATE	TRAD//20011122
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRXXXXXXXXXX
70E	NARRATIVE	SPRO//70-0007-35647
16S	END OF BLOCK	TRADEDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/5000000,
97A	ACCOUNT	SAFE//100800070178
16S	END OF BLOCK	FIAC
OPTIONAL SEQUENCE D REPO DETAILS		
16R	START OF BLOCK	REPO
98A	REPURCHASE DATE	TERM//20011206
19A	REPURCHASE AMOUNT	REPA//EUR5010000,
16S	END OF BLOCK	REPO
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	REAG//ETHNGRAA

16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNGRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E3 AMOUNTS		
16R	START OF BLOCK	AMT
19A	AMOUNT	SETT//EUR5005000,
16S	END OF BLOCK	AMT
16S	END OF BLOCK	SETDET

Αντίστοιχα η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ, αν στείλει τη δική της ειδοποίηση προς το Σύστημα μέσω SWIFT, θα χρησιμοποιήσει το MT 541 όπως περιγράφεται πιο πάνω (repo επί τίτλων – αγορά).

4.8) BUY/SELL BACK – ΑΓΟΡΑ MT 541 RECEIVE AGAINST PAYMENT

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//16AN
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADDET
98A ή C	DATE/TIME	SETT//YYYYMMDD ή SETT//YYYYMMDDHHMMSS
98A	DATE	TRAD//YYYYMMDD
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRNNNNNNNNYYZ
70E	NARRATIVE	SPRO//78-ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ-ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
16S	END OF BLOCK	TRADDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/15N,2 decimals
97A	ACCOUNT	SAFE//ΑΡΙΘΜΟΣ ΛΟΓ/ΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ
16S	END OF BLOCK	FIAC
OPTIONAL SEQUENCE D REPO DETAILS		
16R	START OF BLOCK	REPO
98A ή C	REPURCHASE DATE/TIME	TERM//YYYYMMDD ή TERM//YYYYMMDDHHMMSS
19A	REPURCHASE AMOUNT	REPA//EUR15N,2 decimals
16S	END OF BLOCK	REPO
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR/TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P ή Q	PARTY	DEAG//BIC ή DEAG//ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ

16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNGRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E3 AMOUNTS		
16R	START OF BLOCK	AMT
19A	AMOUNT	SETT//EUR15N,2 decimals
16S	END OF BLOCK	AMT
16S	END OF BLOCK	SETDET

Για να **ταυτοποιηθεί** το μήνυμα αυτό (buy/sell back-αγορά), πρέπει το Σύστημα να λάβει και μια αντίστοιχη ειδοποίηση από τον αντισυμβαλλόμενο πωλητή. Αν η ειδοποίηση του σταλεί μέσω SWIFT, τότε πρέπει να είναι μήνυμα τύπου 543 (MT 543).

ΠΑΡΑΔΕΙΓΜΑ

Την 22 Νοεμβρίου 2001 η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ συμφωνεί με την ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ να αγοράσει με “buy/sell back” τίτλους ISIN GRXXXXXXXXXX για το λογαριασμό ιδίου χαρτοφυλακίου της αρ. 100800010160, με ημερομηνία διακανονισμού (valeur) την 26 Νοεμβρίου 2001 και λήξης του “buy/sell back” την 6 Δεκεμβρίου 2001, ονομαστικής αξίας 5.000.000 ευρώ, αξία διακανονισμού στην έναρξη 5.005.000 ευρώ και αξία διακανονισμού στη λήξη 5.010.000 ευρώ.

Η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ αποστέλλει προς το Σύστημα ένα MT 541 με αριθμό αποστολής 54768.

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//ANANAAN.....
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADEDET
98A	DATE	SETT//20011126
98A	DATE	TRAD//20011122
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRXXXXXXXXXX
70E	NARRATIVE	SPRO//78-0001-54768
16S	END OF BLOCK	TRADEDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/5000000,
97A	ACCOUNT	SAFE//100800010160
16S	END OF BLOCK	FIAC
OPTIONAL SEQUENCE D REPO DETAILS		
16R	START OF BLOCK	REPO
98A	REPURCHASE DATE/TIME	TERM//20011206

19A	REPURCHASE AMOUNT	REPA//EUR5010000,
16S	END OF BLOCK	REPO
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	DEAG//EMPOGRAA
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNGRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E3 AMOUNTS		
16R	START OF BLOCK	AMT
19A	AMOUNT	SETT//EUR5005000,
16S	END OF BLOCK	AMT
16S	END OF BLOCK	SETDET

Αντίστοιχα η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ, αν στείλει τη δική της ειδοποίηση προς το Σύστημα μέσω SWIFT, θα χρησιμοποιήσει το MT 543 όπως περιγράφεται πιο κάτω (στο “buy/sell back” επί τίτλων – πώληση).

4.9) BUY/SELL BACK – ΠΩΛΗΣΗ MT 543 DELIVER AGAINST PAYMENT

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//16AN
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADEDET
98A ή C	DATE/TIME	SETT//YYYYMMDD ή SETT//YYYYMMDDHHMMSS
98A	DATE	TRAD//YYYYMMDD
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRNNNNNNNNYYZ
70E	NARRATIVE	SPRO//78-ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ-ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
16S	END OF BLOCK	TRADEDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/15N,2 decimals
97A	ACCOUNT	SAFE//ΑΡΙΘΜΟΣ ΛΟΓ/ΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ
16S	END OF BLOCK	FIAC
OPTIONAL SEQUENCE D REPO DETAILS		
16R	START OF BLOCK	REPO
98A ή C	REPURCHASE DATE/TIME	TERM//YYYYMMDD ή TERM//YYYYMMDDHHMMSS

19A	REPURCHASE AMOUNT	REPA//EUR15N,2 decimals
16S	END OF BLOCK	REPO
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P ή Q	PARTY	REAG//BIC ή REAG//ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E3 AMOUNTS		
16R	START OF BLOCK	AMT
19A	AMOUNT	SETT//EUR15N,2 decimals
16S	END OF BLOCK	AMT
16S	END OF BLOCK	SETDET

Για να **ταυτοποιηθεί** το μήνυμα αυτό (buy/sell back-πώληση), πρέπει το Σύστημα να λάβει και μια αντίστοιχη ειδοποίηση από τον αντισυμβαλλόμενο αγοραστή. Αν η ειδοποίηση του σταλεί μέσω SWIFT, τότε πρέπει να είναι μήνυμα τύπου 541 (MT 541).

ΠΑΡΑΔΕΙΓΜΑ

Χρησιμοποιούμε το παράδειγμα του “buy/sell back” επί τίτλων. Η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ παραδίδει τους τίτλους από το λογαριασμό τίτλων ιδίου χαρτοφυλακίου της αρ. 100800070178.

Η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ αποστέλλει προς το Σύστημα ένα MT 543 με αριθμό αποστολής 36714.

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//NANANA...
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADEDET
98A	DATE	SETT//20011126
98A	DATE	TRAD//20011122
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRXXXXXXXXXX
70E	NARRATIVE	SPRO//78-0007-36714
16S	END OF BLOCK	TRADEDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/5000000,
97A	ACCOUNT	SAFE//100800070178

16S	END OF BLOCK	FIAC
OPTIONAL SEQUENCE D REPO DETAILS		
16R	START OF BLOCK	REPO
98A	REPURCHASE DATE	TERM//20011206
19A	REPURCHASE AMOUNT	REPA//EUR5010000,
16S	END OF BLOCK	REPO
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	REAG//ETHNGRAA
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNGRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E3 AMOUNTS		
16R	START OF BLOCK	AMT
19A	AMOUNT	SETT//EUR5005000,
16S	END OF BLOCK	AMT
16S	END OF BLOCK	SETDET

Αντίστοιχα η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ, αν στείλει τη δική της ειδοποίηση προς το Σύστημα μέσω SWIFT, θα χρησιμοποιήσει το MT 541 όπως περιγράφεται πιο πάνω (στο “buy/sell back” επί τίτλων – αγορά).

4.10) ΔΑΝΕΙΣΜΟΣ ΤΙΤΛΩΝ – ΔΑΝΕΙΖΟΜΕΝΟΣ ΤΙΤΛΟΥΣ MT 540 RECEIVE FREE

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//16AN
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADEDET
98A ή C	DATE/TIME	SETT//YYYYMMDD ή SETT//YYYYMMDDHHMMSS
98A	DATE	TRAD//YYYYMMDD
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRNNNNNNNNYYZ
70E	NARRATIVE	SPRO//41-ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ-ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
16S	END OF BLOCK	TRADEDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/15N,2 decimals

97A	ACCOUNT	SAFE//ΑΡΙΘΜΟΣ ΛΟΓ/ΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ
16S	END OF BLOCK	FIAC
OPTIONAL SEQUENCE D REPO DETAILS		
16R	START OF BLOCK	REPO
98A ή C*	REPURCHASE DATE/TIME	TERM//YYYYMMDD ή TERM//YYYYMMDDHHMMSS
19A*	REPURCHASE AMOUNT	REPA//EUR15N,2 decimals
70C*	NARRATIVE	REPO//15N-3N,4 decimals
16S	END OF BLOCK	REPO
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P ή Q	PARTY	DEAG//BIC ή DEAG//ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16S	END OF BLOCK	SETDET

* Σημείωση : Αν το **δάνειο** είναι **καθορισμένης διάρκειας** συμπληρώνονται απαραίτητα τα πεδία **98A ή C** και **19A** (στο Sequence D – Repo details) και όχι το 70C. Αν το **δάνειο** είναι **αόριστης διάρκειας**, συμπληρώνεται **μόνο το πεδίο 70C** στο ίδιο sequence και όχι τα πεδία 98A (ή C) και 19A.

Για να **ταυτοποιηθεί** το μήνυμα αυτό (δανεισμός τίτλων-δανειζόμενος), πρέπει το Σύστημα να λάβει και μια αντίστοιχη ειδοποίηση από τον αντισυμβαλλόμενο δανειστή. Αν η ειδοποίηση του σταλεί μέσω SWIFT, τότε πρέπει να είναι μήνυμα τύπου 542 (MT 542).

ΠΑΡΑΔΕΙΓΜΑ

Την 22 Νοεμβρίου 2001 η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ συμφωνεί με την ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ να δανειστεί τίτλους ISIN GRXXXXXXXXXX για το λογαριασμό ιδίου χαρτοφυλακίου της αρ. 100800010160, με ημερομηνία διακανονισμού (valeur) την 26 Νοεμβρίου 2001 και λήξης του δανείου την 6 Δεκεμβρίου 2001, ονομαστικής αξίας 5.000.000 ευρώ. Με τη λήξη του δανείου η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ θα καταβάλει στην ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ τόκο 3.000 ευρώ.

Η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ αποστέλλει προς το Σύστημα ένα MT 540 με αριθμό αποστολής 56788.

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//ANANNNN...
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADEDET
98A	DATE	SETT//20011126
98A	DATE	TRAD//20011122

35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRXXXXXXXXXX
70E	NARRATIVE	SPRO//41-0001-56788
16S	END OF BLOCK	TRADDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/5000000,
97A	ACCOUNT	SAFE//100800010160
16S	END OF BLOCK	FIAC
OPTIONAL SEQUENCE D REPO DETAILS		
16R	START OF BLOCK	REPO
98A	REPURCHASE DATE	TERM//20011206
19A	REPURCHASE AMOUNT	REPA//EUR3000,
16S	END OF BLOCK	REPO
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	DEAG//EMPOGRAA
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNGRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16S	END OF BLOCK	SETDET

Αντίστοιχα η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ, αν στείλει τη δική της ειδοποίηση προς το Σύστημα μέσω SWIFT, θα χρησιμοποιήσει το MT 542 όπως περιγράφεται πιο κάτω (στο Δανεισμός τίτλων – δανειστής).

4.11) ΔΑΝΕΙΣΜΟΣ ΤΙΤΛΩΝ – ΔΑΝΕΙΣΤΗΣ ΤΙΤΛΩΝ MT 542 DELIVER FREE

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//16AN
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADDET
98A ή C	DATE/TIME	SETT//YYYYMMDD ή SETT//YYYYMMDDHHMMSS
98A	DATE	TRAD//YYYYMMDD
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRNNNNNNNNYYZ

70E	NARRATIVE	SPRO//41-ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ-ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
16S	END OF BLOCK	TRADDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/15N,2 decimals
97A	ACCOUNT	SAFE//ΑΡΙΘΜΟΣ ΛΟΓ/ΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ
16S	END OF BLOCK	FIAC
OPTIONAL SEQUENCE D REPO DETAILS		
16R	START OF BLOCK	REPO
98A ή C*	REPURCHASE DATE/TIME	TERM//YYYYMMDD ή TERM//YYYYMMDDHHMMSS
19A*	REPURCHASE AMOUNT	REPA//EUR15N,2 decimals
70C*	NARRATIVE	REPO//15N-3N,4 decimals
16S	END OF BLOCK	REPO
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P ή Q	PARTY	REAG//BIC ή REAG//ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNGRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16S	END OF BLOCK	SETDET

* Σημείωση : Αν το **δάνειο** είναι **καθορισμένης διάρκειας** συμπληρώνονται απαραίτητα τα πεδία **98A ή C** και **19A** (στο Sequence D – Repo details) και όχι το 70C. Αν το **δάνειο** είναι **αόριστης διάρκειας**, συμπληρώνεται **μόνο το πεδίο 70C** στο ίδιο sequence και όχι τα πεδία 98A (ή C) και 19A.

Για να **ταυτοποιηθεί** το μήνυμα αυτό (δανεισμός τίτλων-δανειστής), πρέπει το Σύστημα να λάβει και μια αντίστοιχη ειδοποίηση από τον αντισυμβαλλόμενο δανειζόμενο. Αν η ειδοποίηση του σταλεί μέσω SWIFT, τότε πρέπει να είναι μήνυμα τύπου 540 (MT 540).

ΠΑΡΑΔΕΙΓΜΑ

Χρησιμοποιούμε το παράδειγμα του Δανεισμού τίτλων – δανειζόμενος. Η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ παραδίδει τους τίτλους από το λογαριασμό τίτλων ιδίου χαρτοφυλακίου της αρ. 100800070178.

Η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ αποστέλλει προς το Σύστημα ένα MT 542 με αριθμό αποστολής 36709.

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//NANNNN...

23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADEDET
98A	DATE	SETT//20011126
98A	DATE	TRAD//20011122
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRXXXXXXXXXX
70E	NARRATIVE	SPRO//41-0007-36709
16S	END OF BLOCK	TRADEDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/50000000,
97A	ACCOUNT	SAFE//100800070178
16S	END OF BLOCK	FIAC
OPTIONAL SEQUENCE D REPO DETAILS		
16R	START OF BLOCK	REPO
98A	REPURCHASE DATE	TERM//20011206
19A	REPURCHASE AMOUNT	REPA//EUR3000,
16S	END OF BLOCK	REPO
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	REAG//ETHNGRAA
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNGRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16S	END OF BLOCK	SETDET

Αντίστοιχα η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ, αν στείλει τη δική της ειδοποίηση προς το Σύστημα μέσω SWIFT, θα χρησιμοποιήσει το MT 540 όπως περιγράφεται πιο πάνω (στο Δανεισμός τίτλων – δανειζόμενος).

4.12) ΕΝΕΧΥΡΑΣΗ ΤΙΤΛΩΝ ΓΙΑ ΣΥΝΑΛΛΑΓΕΣ ΕΚΤΟΣ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ – ΕΝΕΧΥΡΑΖΩΝ ΤΙΤΛΟΥΣ MT 542 DELIVER FREE

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//16AN
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADEDET

98A ή C	DATE/TIME	SETT//YYYYMMDD ή SETT//YYYYMMDDHHMMSS
98A	DATE	TRAD//YYYYMMDD
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRNNNNNNNNYYZ
70E	NARRATIVE	SPRO//51-ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ-ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
16S	END OF BLOCK	TRADEDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/15N,2 decimals
97A	ACCOUNT	SAFE//ΑΡΙΘΜΟΣ ΛΟΓ/ΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ
16S	END OF BLOCK	FIAC
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P ή Q	PARTY	REAG//BIC ή REAG//ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16S	END OF BLOCK	SETDET

Για να **ταυτοποιηθεί** το μήνυμα αυτό (ενεχύραση τίτλων-ενεχυράζων), πρέπει το Σύστημα να λάβει και μια αντίστοιχη ειδοποίηση από τον αντισυμβαλλόμενο ενεχυρούχο δανειστή. Αν η ειδοποίηση του σταλεί μέσω SWIFT, τότε πρέπει να είναι μήνυμα τύπου 540 (MT 540).

ΠΑΡΑΔΕΙΓΜΑ

Στις 25 Νοεμβρίου 2001 η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ, με σκοπό να εγγυηθεί μια συναλλαγή της με την ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ ζητά να ενεχυράσει τίτλους έντοκων γραμματίων ISIN GR0XXXXXXX από το λογαριασμό τίτλων ιδίου χαρτοφυλακίου αρ. 100800070178, ονομαστικής αξίας 5.000.000 ευρώ. Η ενεχύραση θα αρχίσει στις 28 Νοεμβρίου 2001.

Η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ αποστέλλει προς το Σύστημα ένα μήνυμα MT 542 με αριθμό αποστολής 67432.

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//ANANN...
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADEDET
98A	DATE	SETT//20011128

98A	DATE	TRAD//20011125
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GR0XXXXXXXXX
70E	NARRATIVE	SPRO//51-0007-67432
16S	END OF BLOCK	TRADEDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/5000000,
97A	ACCOUNT	SAFE//100800070178
16S	END OF BLOCK	FIAC
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	REAG//ETHNGRAA
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNGRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16S	END OF BLOCK	SETDET

Αντίστοιχα η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ, αν στείλει τη δική της ειδοποίηση προς το Σύστημα μέσω SWIFT, θα χρησιμοποιήσει το MT 540 όπως περιγράφεται πιο κάτω (Ενεχύραση τίτλων για συναλλαγές εκτός συστήματος – ενεχυρούχος δανειστής).

4.13) ΕΝΕΧΥΡΑΣΗ ΤΙΤΛΩΝ ΓΙΑ ΣΥΝΑΛΛΑΓΕΣ ΕΚΤΟΣ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ – ΕΝΕΧΥΡΟΥΧΟΣ ΔΑΝΕΙΣΤΗΣ MT 540 RECEIVE FREE

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//16AN
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADEDET
98A ή C	DATE/TIME	SETT//YYYYMMDD ή SETT//YYYYMMDDHHMMSS
98A	DATE	TRAD//YYYYMMDD
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRNNNNNNNYYZ
70E	NARRATIVE	SPRO//51-ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ-ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ
16S	END OF BLOCK	TRADEDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		

16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/15N,2 decimals
97A	ACCOUNT	SAFE//PLEDGE
16S	END OF BLOCK	FIAC
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P ή Q	PARTY	DEAG//BIC ή DEAG//ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNGRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16S	END OF BLOCK	SETDET

Για να **ταυτοποιηθεί** το μήνυμα αυτό (ενεχύραση τίτλων-ενεχυρούχος δανειστής), πρέπει το Σύστημα να λάβει και μια αντίστοιχη ειδοποίηση από τον αντισυμβαλλόμενο ενεχυράζοντα. Αν η ειδοποίηση του σταλεί μέσω SWIFT, τότε πρέπει να είναι μήνυμα τύπου 542 (MT 542).

ΠΑΡΑΔΕΙΓΜΑ

Χρησιμοποιούμε το παράδειγμα της ενεχύρασης τίτλων για συναλλαγές εκτός συστήματος. Η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ ως δικαιούχος του ενεχύρου αποστέλλει προς το Σύστημα μήνυμα MT 540 με αριθμό αποστολής 58240.

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//ANANAN...
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADEDET
98A	DATE	SETT//20011128
98A	DATE	TRAD//20011125
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GR0XXXXXXXXXX
70E	NARRATIVE	SPRO//51-0001-58240
16S	END OF BLOCK	TRADEDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/5000000,

97A	ACCOUNT	SAFE//PLEDGE
16S	END OF BLOCK	FIAC
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	DEAG//EMPOGRAA
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNGRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16S	END OF BLOCK	SETDET

Αντίστοιχα η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ, αν στείλει τη δική της ειδοποίηση προς το Σύστημα μέσω SWIFT, θα χρησιμοποιήσει το MT 542 όπως περιγράφεται πιο ΠΑΝΩ (Ενεχύραση τίτλων για συναλλαγές εκτός συστήματος – ενεχυράζων τίτλους).

4.14) ΑΝΤΙΚΑΤΑΣΤΑΣΗ ΕΝΕΧΥΡΟΥ ΤΙΤΛΩΝ – ΕΝΕΧΥΡΑΖΩΝ ΤΙΤΛΟΥΣ MT 542 DELIVER FREE

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//16AN
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADEDET
98A ή C	DATE/TIME	SETT//YYYYMMDD ή SETT//YYYYMMDDHHMMSS
98A	DATE	TRAD//YYYYMMDD
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRNNNNNNNNYYZ 15N,2 decimals ISIN GRXXXXXXXXYYZ 15N,2 decimals
70E	NARRATIVE	SPRO//58-ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ-ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ PREV//ΚΣ-ΑΡ. ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ ΑΡΧΙΚΗΣ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΗΣ/ΕΤΟΣ
16S	END OF BLOCK	TRADEDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/15N,2 decimals
97A	ACCOUNT	SAFE//ΑΡΙΘΜΟΣ ΛΟΓ/ΣΜΟΥ ΤΙΤΛΩΝ
16S	END OF BLOCK	FIAC
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD

REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P ή Q	PARTY	REAG//BIC ή REAG//ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNRGRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16S	END OF BLOCK	SETDET

Σημείωση 1 : Το μήνυμα αυτό θα σταλεί και στην περίπτωση **μερικής αποδέσμευσης ενεχύρου τίτλων** οπότε στο πεδίο 35B θα συμπληρωθεί ως εξής :

1. στην 1η και 3η γραμμή θα καταχωρηθεί το ίδιο ISIN των τίτλων
2. στη 2η γραμμή η συνολική ονομαστική αξία από τους τίτλους αυτούς που έχει απομείνει από τυχόν προηγούμενες δεσμεύσεις-αποδεσμεύσεις και αντικαταστάσεις
3. στην 4η γραμμή η ονομαστική αξία των τίτλων που πρέπει να δεσμευτεί.

Σημείωση 2 : Για τα μηνύματα που αφορούν σε αντικατάσταση ή μερική αποδέσμευση ενεχύρου τίτλων δεν λαμβάνονται υπόψη οι πληροφορίες που καταχωρούνται στο πεδίο 36B αλλά οι πληροφορίες που καταχωρούνται στο πεδίο 35B του sequence B.

Για να **ταυτοποιηθεί** το μήνυμα αυτό (αντικατάσταση ενεχύρου-ενεχυράζων), πρέπει το Σύστημα να λάβει και μια αντίστοιχη ειδοποίηση από τον αντισυμβαλλόμενο ενεχυρούχο δανειστή. Αν η ειδοποίηση του σταλεί μέσω SWIFT, τότε πρέπει να είναι μήνυμα τύπου 540 (MT 540).

ΠΑΡΑΔΕΙΓΜΑ

Χρησιμοποιούμε το παράδειγμα Ενεχύρασης τίτλων για συναλλαγές εκτός Συστήματος. Στις 30 Νοεμβρίου 2001 η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ ζητά να αντικαταστήσει 4.000.000 ευρώ από τους τίτλους εντόκων γραμματίων ISIN GR0XXXXXXX με τίτλους εντόκων γραμματίων με ISIN GR0XAXAXAXX ονομαστικής αξίας 3.000.000, με ημερομηνία διακανονισμού (valeur) της συναλλαγής την 5 Δεκεμβρίου 2001.

Η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ αποστέλλει προς το Σύστημα ένα μήνυμα MT 542 με αριθμό αποστολής 67450.

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//AAAAN...
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADEDET
98A	DATE	SETT//20011205
98A	DATE	TRAD//20011130
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GR0XXXXXXX 4000000, ISIN GR0XAXAXAXX 3000000,
70E	NARRATIVE	SPRO//58-0007-67450 PREV//51-67432/2001

16S	END OF BLOCK	TRADDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/4000000,
97A	ACCOUNT	SAFE//100800070178
16S	END OF BLOCK	FIAC
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	REAG//ETHNGRAA
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNGRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16S	END OF BLOCK	SETDET

Αντίστοιχα η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ, αν στείλει τη δική της ειδοποίηση προς το Σύστημα μέσω SWIFT, θα χρησιμοποιήσει το MT 540 όπως περιγράφεται πιο κάτω (Αντικατάσταση ενεχύρου τίτλων– ενεχυρούχος δανειστής).

4.15) ΑΝΤΙΚΑΤΑΣΤΑΣΗ ΕΝΕΧΥΡΟΥ ΤΙΤΛΩΝ – ΕΝΕΧΥΡΟΥΧΟΣ ΔΑΝΕΙΣΤΗΣ MT 540 RECEIVE FREE

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//16AN
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADDET
98A ή C	DATE/TIME	SETT//YYYYMMDD ή SETT//YYYYMMDDHHMMSS
98A	DATE	TRAD//YYYYMMDD
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRNNNNNNNNYYZ 15N,2 decimals ISIN GRXXXXXXXYYZ 15N,2 decimals
70E	NARRATIVE	SPRO//58-ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ-ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ PREV//ΚΣ-ΑΡ. ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ ΑΡΧΙΚΗΣ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΗΣ/ΕΤΟΣ
16S	END OF BLOCK	TRADDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC

36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/15N,2 decimals
97A	ACCOUNT	SAFE//PLEDGE
16S	END OF BLOCK	FIAC
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P ή Q	PARTY	DEAG//BIC ή DEAG//ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16S	END OF BLOCK	SETDET

Σημείωση 1 : Το μήνυμα αυτό θα σταλεί και στην περίπτωση **μερικής αποδέσμευσης ενεχύρου τίτλων** οπότε στο πεδίο 35B θα συμπληρωθεί ως εξής :

4. στην 1η και 3η γραμμή θα καταχωρηθεί το ίδιο ISIN των τίτλων
5. στη 2η γραμμή η συνολική ονομαστική αξία από τους τίτλους αυτούς που έχει απομείνει από τυχόν προηγούμενες δεσμεύσεις-αποδεσμεύσεις και αντικαταστάσεις
6. στην 4η γραμμή η ονομαστική αξία των τίτλων που πρέπει να δεσμευτεί.

Σημείωση 2 : Για τα μηνύματα που αφορούν σε αντικατάσταση ή μερική αποδέσμευση ενεχύρου τίτλων δεν λαμβάνονται υπόψη οι πληροφορίες που καταχωρούνται στο πεδίο 36B αλλά οι πληροφορίες που καταχωρούνται στο πεδίο 35B του sequence B.

Για να **ταυτοποιηθεί** το μήνυμα αυτό (αντικατάσταση ενεχύρου-ενεχυρούχος δανειστής), πρέπει το Σύστημα να λάβει και μια αντίστοιχη ειδοποίηση από τον αντισυμβαλλόμενο ενεχυράζοντα. Αν η ειδοποίηση του σταλεί μέσω SWIFT, τότε πρέπει να είναι μήνυμα τύπου 542 (MT 542).

ΠΑΡΑΔΕΙΓΜΑ

Χρησιμοποιούμε τα παραδείγματα της ενεχύρασης τίτλων για συναλλαγές εκτός Συστήματος και αντικατάστασης ενεχύρου τίτλων – ενεχυράζων τίτλους. Η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ ως δικαιούχος του ενεχύρου αποστέλλει προς το Σύστημα μήνυμα MT 540 με αριθμό αποστολής 58280.

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//NANAAN...
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADEDET
98A	DATE	SETT//20011205
98A	DATE	TRAD//20011130

35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GR0XXXXXXXXX 4000000, ISIN GR0XAXAXAX 3000000,
70E	NARRATIVE	SPRO//58-0001-58280 PREV//51-58240/2001
16S	END OF BLOCK	TRADDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/4000000,
97A	ACCOUNT	SAFE//PLEDGE
16S	END OF BLOCK	FIAC
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	DEAG//EMPOGRAA
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNRGRRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16S	END OF BLOCK	SETDET

Αντίστοιχα η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ, αν στείλει τη δική της ειδοποίηση προς το Σύστημα μέσω SWIFT, θα χρησιμοποιήσει το MT 542 όπως περιγράφεται πιο πάνω (Ενεχύραση τίτλων για συναλλαγές εκτός συστήματος – ενεχυράζων τίτλους).

4.16) ΟΛΙΚΗ ΑΠΟΔΕΣΜΕΥΣΗ ΕΝΕΧΥΡΟΥ ΤΙΤΛΩΝ – ΕΝΕΧΥΡΑΖΩΝ ΤΙΤΛΟΥΣ MT 542 DELIVER FREE

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//16AN
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADDET
98A ή C	DATE/TIME	SETT//YYYYMMDD ή SETT//YYYYMMDDHHMMSS
98A	DATE	TRAD//YYYYMMDD
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRNNNNNNNNYYZ
70E	NARRATIVE	SPRO//59-ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ-ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ PREV//ΚΣ-ΑΡ. ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ ΑΡΧΙΚΗΣ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΗΣ/ΕΤΟΣ
16S	END OF BLOCK	TRADDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		

16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/15N,2 decimals
97A	ACCOUNT	SAFE//PLEDGE
16S	END OF BLOCK	FIAC
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P ή Q	PARTY	REAG//BIC ή REAG//ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16S	END OF BLOCK	SETDET

Σημείωση 1 : Στο πεδίο 35B η αναφορά του ISIN είναι ενδεικτική. Το Σύστημα θα αποδεσμεύσει όλους τους τυχόν εναπομείναντες τίτλους και από τα άλλα ISIN που πιθανόν να έχουν δεσμευτεί νωρίτερα.

Σημείωση 2 : Για τα μηνύματα που αφορούν σε ολική αποδέσμευση τίτλων δεν λαμβάνονται υπόψη οι πληροφορίες που καταχωρούνται στο πεδίο 36B αλλά το Σύστημα θα αποδεσμεύσει όλους τους τυχόν εναπομείναντες τίτλους και από τα άλλα ISIN που πιθανόν να έχουν δεσμευτεί νωρίτερα.

Για να **ταυτοποιηθεί** το μήνυμα αυτό (αποδέσμευση ενεχύρου-ενεχυράζων), πρέπει το Σύστημα να λάβει και μια αντίστοιχη ειδοποίηση από τον αντισυμβαλλόμενο ενεχυρούχο δανειστή. Αν η ειδοποίηση του σταλεί μέσω SWIFT, τότε πρέπει να είναι μήνυμα τύπου 540 (MT 540).

ΠΑΡΑΔΕΙΓΜΑ

Χρησιμοποιούμε το παράδειγμα Ενεχύρασης τίτλων για συναλλαγές εκτός Συστήματος. Στις 7 Δεκεμβρίου 2001 η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ ζητά να αποδεσμεύσει τους τίτλους εντόκων γραμματίων ISIN GR0XXXXXXX με ημερομηνία διακανονισμού (valeur) της συναλλαγής την 10 Δεκεμβρίου 2001.

Η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ αποστέλλει προς το Σύστημα ένα μήνυμα MT 542 με αριθμό αποστολής 67453.

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//ANANN...
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADDET
98A	DATE	SETT//20011210
98A	DATE	TRAD//20011207

35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GR0XXXXXXXXX
70E	NARRATIVE	SPRO//59-0007-67453 PREV//51-67432/2001
16S	END OF BLOCK	TRADEDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/5000000,
97A	ACCOUNT	SAFE//PLEDGE
16S	END OF BLOCK	FIAC
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	REAG//ETHNGRAA
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16S	END OF BLOCK	SETDET

Αντίστοιχα η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ, αν στείλει τη δική της ειδοποίηση προς το Σύστημα μέσω SWIFT, θα χρησιμοποιήσει το MT 540 όπως περιγράφεται πιο κάτω (Αποδέσμευση ενεχύρου τίτλων– ενεχυρούχος δανειστής).

4.17) ΟΛΙΚΗ ΑΠΟΔΕΣΜΕΥΣΗ ΕΝΕΧΥΡΟΥ ΤΙΤΛΩΝ – ΕΝΕΧΥΡΟΥΧΟΣ ΔΑΝΕΙΣΤΗΣ MT 540 RECEIVE FREE

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//16AN
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADEDET
98A ή C	DATE/TIME	SETT//YYYYMMDD ή SETT//YYYYMMDDHHMMSS
98A	DATE	TRAD//YYYYMMDD
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRNNNNNNNNYYZ
70E	NARRATIVE	SPRO//59-ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ-ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ PREV//ΚΣ-ΑΡ. ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ ΑΡΧΙΚΗΣ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΗΣ/ΕΤΟΣ
16S	END OF BLOCK	TRADEDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		

16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/15N,2 decimals
97A	ACCOUNT	SAFE//PLEDGE
16S	END OF BLOCK	FIAC
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P ή Q	PARTY	DEAG//BIC ή DEAG//ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNGRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16S	END OF BLOCK	SETDET

Σημείωση 1 : Στο πεδίο 35B η αναφορά του ISIN είναι ενδεικτική. Το Σύστημα θα αποδεσμεύσει όλους τους τυχόν εναπομείναντες τίτλους και από τα άλλα ISIN που πιθανόν να έχουν δεσμευτεί νωρίτερα.

Σημείωση 2 : Για τα μηνύματα που αφορούν σε ολική αποδέσμευση τίτλων δεν λαμβάνονται υπόψη οι πληροφορίες που καταχωρούνται στο πεδίο 36B αλλά το Σύστημα θα αποδεσμεύσει όλους τους τυχόν εναπομείναντες τίτλους και από τα άλλα ISIN που πιθανόν να έχουν δεσμευτεί νωρίτερα.

Για να **ταυτοποιηθεί** το μήνυμα αυτό (αποδέσμευση ενεχύρου-ενεχυρούχος δανειστής), πρέπει το Σύστημα να λάβει και μια αντίστοιχη ειδοποίηση από τον αντισυμβαλλόμενο ενεχυράζοντα. Αν η ειδοποίηση του σταλεί μέσω SWIFT, τότε πρέπει να είναι μήνυμα τύπου 542 (MT 542).

ΠΑΡΑΔΕΙΓΜΑ

Χρησιμοποιούμε το παράδειγμα της ενεχύρασης τίτλων για συναλλαγές εκτός Συστήματος. Η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ ως δικαιούχος του ενεχύρου αποστέλλει προς το Σύστημα μήνυμα MT 540 με αριθμό αποστολής 58282.

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//ANANAN...
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	NEWM
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADEDET
98A	DATE	SETT//20011210
98A	DATE	TRAD//20011207
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GR0XXXXXXX
70E	NARRATIVE	SPRO//59-0001-58282 PREV//51-58240/2001

16S	END OF BLOCK	TRADDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/5000000,
97A	ACCOUNT	SAFE//PLEDGE
16S	END OF BLOCK	FIAC
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	DEAG//EMPOGRAA
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNGRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16S	END OF BLOCK	SETDET

Αντίστοιχα η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ αν στείλει τη δική της ειδοποίηση προς το Σύστημα μέσω SWIFT, θα χρησιμοποιήσει το MT 542 όπως περιγράφεται πιο πάνω (Ολική αποδέσμευση ενεχύρου τίτλων – ενεχυράζων τίτλους).

4.18) ΕΛΕΥΘΕΡΟ ΚΕΙΜΕΝΟ MT 599 FREE FORMAT

Σύμφωνα με τα "standards" του SWIFT, ο τύπος του μηνύματος αυτού χρησιμοποιείται για τη μετάδοση πληροφοριών και κειμένου. Στο Σύστημα όμως, χρησιμοποιείται για την αποστολή ειδοποιήσεων που αναφέρονται σε συναλλαγές για τις οποίες δεν υπάρχει ειδικός τύπος μηνύματος όπως :

- Περιθώρια πράξης "repos" επί τίτλων (αγοραστής ή πωλητής) - ΚΣ 75
- Λήξη δανείου τίτλων αόριστης διάρκειας (δανειζόμενος ή δανειστής) - ΚΣ 49
- Δανεισμός τίτλων έναντι ενεχύρου (δανειζόμενος ή δανειστής) - ΚΣ 42
- Αναγγελία απόκτησης τίτλων στην Πρωτογενή αγορά - ΚΣ 81
- Εγγραφή τίτλων σε λογαριασμό - ΚΣ 31
- Μετατροπή φυσικών τίτλων σε τίτλους με λογιστική μορφή - ΚΣ 31

Πεδίο	Τίτλος πεδίου	Χωρητικότητα N/AN
20	TRN	16AN
21	RELATED REFERENCE	16AN
79	NARRATIVE	35 γραμμές των 50 στοιχείων

(Βλέπε και συνημμένο έντυπο αρ. S1)

Κάθε γραμμή του ελεύθερου κειμένου αρχίζει με μια αριθμητική σήμανση που ξεκινά από την αρχή της γραμμής και είναι αύξουσα με πρώτο αριθμό το ένα (1). Ακολουθεί άνω και κάτω τελεία (:). Στην πρώτη γραμμή αναγράφεται ο κωδικός του συμμετέχοντα φορέα και τα λοιπά στοιχεία των υπόλοιπων γραμμών λαμβάνονται (ανάλογα με την περίπτωση) από το συνημμένο Πίνακα S1. Οι κενές γραμμές παραλείπονται.

Για να **ταυτοποιηθεί** το μήνυμα αυτό πρέπει το Σύστημα να λάβει και μια αντίστοιχη ειδοποίηση από τον αντισυμβαλλόμενο εκτός στην περίπτωση λήξης δανείου αόριστης διάρκειας (ΚΣ 49) όπου αρκεί μήνυμα μόνο από τον δανειστή τίτλων.

ΠΑΡΑΔΕΙΓΜΑ 1. ΔΑΝΕΙΣΜΟΣ ΤΙΤΛΩΝ ΕΝΑΝΤΙ ΕΝΕΧΥΡΟΥ-ΔΑΝΕΙΣΤΗΣ

Στις 26 Νοεμβρίου 2001 η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ συμφώνησε με την ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ να της χορηγήσει δάνειο τίτλων έναντι ενέχυρου (τίτλων). Το δάνειο είναι από τον τίτλο ISIN GR0YYYYYYYYY ονομαστικής αξίας 5.000.000 ευρώ και το ενέχυρο τίτλων είναι από το ISIN GR0XXXXXXXXX ονομαστικής αξίας 5.500.000 ευρώ. Το δάνειο θα αρχίσει στις 28 Νοεμβρίου 2001 με ημερομηνία λήξης την 28 Δεκεμβρίου 2001 και ο τόκος που θα πληρωθεί με τη λήξη του δανείου ανέρχεται σε 8.235,59 ευρώ.

Η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ αποστέλλει προς το Σύστημα ένα μήνυμα MT 599 με αριθμό αποστολής 67435.

Πεδίο	Τίτλος πεδίου	Περιεχόμενο
20	TRN	NANAN....
79	NARRATIVE	1:0007 2:42 3:20011126 4:67435 8:100800070178 9:P 10:20011128 11:20011228 12:0001 14:GR0YYYYYYYYY 15:5000000, 18:8235,59 21:GR0XXXXXXXXX 22:5500000,

Σημείωση : Τα ποσά αναγράφονται χωρίς διαχωριστικές τελείες μεταξύ των χιλιάδων.

Αντίστοιχα η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ αν στείλει τη δική της ειδοποίηση προς το Σύστημα μέσω SWIFT, θα χρησιμοποιήσει το μήνυμα τύπου 599 (MT 599).

ΠΑΡΑΔΕΙΓΜΑ 2. ΠΕΡΙΘΩΡΙΑ ΠΡΑΞΗΣ “REPOS” ΕΠΙ ΤΙΤΛΩΝ – ΑΓΟΡΑ

Χρησιμοποιούμε τα στοιχεία του παραδείγματος “repos” επί τίτλων – αγορά. Επί πλέον, έστω ότι η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ συμφωνεί στις 29 Νοεμβρίου 2001 με την ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ, να τροποποιήσουν το “repos” που έχουν πραγματοποιήσει (και ακόμα δεν έχει λήξει). Η συμφωνία περιλαμβάνει τα εξής :

- i) Στις 30 Νοεμβρίου 2001 (ημερομηνία διακανονισμού – valeur της νέας συμφωνίας) η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ να αυξήσει τους τίτλους (ίδιο ISIN) που παρέδωσε στην ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ κατά 1.000.000 ευρώ και αντίστοιχα η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ να πληρώσει στην ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ 1.001.000 ευρώ.

- ii) Με τη λήξη του αρχικού “repos” (6 Δεκεμβρίου 2001) η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ θα επιστρέψει στην ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ όλο το ποσό των τίτλων (6.000.000 ευρώ πλέον) και η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ θα επιστρέψει στην ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ συμπληρωματικό ποσό 1.002.000 ευρώ.

Η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ αποστέλλει προς το Σύστημα ένα MT 599 με αριθμό αποστολής 62590.

Πεδίο	Τίτλος πεδίου	Περιεχόμενο
20	TRN	NANAN....
21	RELATED REFERENCE	ANANANA....
79	NARRATIVE	1:0001 2:75 3:20011129 4:62590 5:ANANANA.... 6:2001 7:54765 10:20011130 31:1001000, 32:D 33:1002000, 34:C 35:1000000, 36:A

Αντίστοιχα η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ αν στείλει τη δική της ειδοποίηση προς το Σύστημα μέσω SWIFT, θα χρησιμοποιήσει το μήνυμα τύπου 599 (MT 599).

4.19) ΑΚΥΡΩΣΕΙΣ ΜΗΝΥΜΑΤΩΝ

Η ακύρωση μηνύματος γίνεται αποδεκτή εφόσον **η αντίστοιχη συναλλαγή δεν έχει διακανονιστεί.**

- για τα MT 540, 541, 542, 543

Χρησιμοποιείται ο ίδιος τύπος μηνύματος με το μήνυμα που πρέπει να ακυρωθεί, με τις εξής μετατροπές :

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//16AN
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	CANC
REPETITIVE OPTIONAL SEQUENCE A1 LINKAGES		
16R	START OF BLOCK	LINK
20C	REFERENCE	PREV//REFER. ΑΡΧΙΚΟΥ ΜΗΝ/ΤΟΣ
16S	END OF BLOCK	LINK
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADDET

98A ή C	DATE/TIME	SETT//YYYYMMDD ή SETT//YYYYMMDDHHMMSS
98A	DATE	TRAD//YYYYMMDD
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRNNNNNNNNYYZ
70E	NARRATIVE	SPRO//90-ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ-ΑΡΙΘΜΟΣ ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ PREV//ΚΣ-ΑΡ. ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ ΑΡΧΙΚΗΣ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΗΣ/ΕΤΟΣ
16S	END OF BLOCK	TRADEDET

Για να **ταυτοποιηθεί** το μήνυμα αυτό (ακύρωση), πρέπει το Σύστημα να λάβει και μια αντίστοιχη ειδοποίηση από τον αντισυμβαλλόμενο. Αν η ειδοποίηση του αντισυμβαλλόμενου σταλεί μέσω SWIFT, τότε πρέπει να είναι ακυρωτικό μήνυμα ίδιου τύπου με το αρχικό.

ΠΑΡΑΔΕΙΓΜΑ 1

Χρησιμοποιούμε το παράδειγμα της Αγοράς τίτλων (MT 541 RECEIVE AGAINST PAYMENT).

Η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ αποστέλλει προς το Σύστημα ένα MT 541 με αριθμό αποστολής 60404.

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//ANAAAAA
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	CANC
REPETITIVE OPTIONAL SEQUENCE A1 LINKAGES		
16R	START OF BLOCK	LINK
20C	REFERENCE	PREV//ANANANAN...
16S	END OF BLOCK	LINK
16S	END OF BLOCK	GENL
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADEDET
98C	DATE/TIME	SETT//20011126103000
98A	DATE	TRAD//20011122
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GRXXXXXXXXXX
70E	NARRATIVE	SPRO//90-0001-60404 PREV//10-50007/2001
16S	END OF BLOCK	TRADEDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/30000000,
97A	ACCOUNT	SAFE//100800010160
16S	END OF BLOCK	FIAC
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		
16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD

REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	DEAG//EMPOGRAA
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNGRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E3 AMOUNTS		
16R	START OF BLOCK	AMT
19A	AMOUNT	SETT//EUR29351989,35
16S	END OF BLOCK	AMT
16S	END OF BLOCK	SETDET

Αντίστοιχα η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ αν στείλει τη δική της ειδοποίηση προς το Σύστημα μέσω SWIFT, θα χρησιμοποιήσει το MT 543 (Ακύρωση μηνύματος πώλησης τίτλων).

ΠΑΡΑΔΕΙΓΜΑ 2

Χρησιμοποιούμε το παράδειγμα ενεχύρασης τίτλων για συναλλαγές εκτός Συστήματος – ενεχυρούχος δανειστής (MT 540 RECEIVE FREE).

Η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ αποστέλλει προς το Σύστημα μήνυμα 540 με αριθμό αποστολής 62580.

MANDATORY SEQUENCE A GENERAL INFORMATION		
16R	START OF BLOCK	GENL
20C	SENDER'S REFERENCE	SEME//NANAN..
23G	FUNCTION OF THE MESSAGE	CANC
16S	END OF BLOCK	GENL
REPETITIVE OPTIONAL SEQUENCE A1 LINKAGES		
16R	START OF BLOCK	LINK
20C	REFERENCE	PREV//ANANAN...
16S	END OF BLOCK	LINK
MANDATORY SEQUENCE B TRADE DETAILS		
16R	START OF BLOCK	TRADEDET
98A	DATE	SETT//20011128
98A	DATE	TRAD//20011125
35B	IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT	ISIN GR0XXXXXXX
70E	NARRATIVE	SPRO//90-0001-62580 PREV//59-58240/2001
16S	END OF BLOCK	TRADEDET
REPETITIVE MANDATORY SEQUENCE C FINANCIAL INSTRUMENT/ACCOUNT		
16R	START OF BLOCK	FIAC
36B	QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED - NOMINAL VALUE	SETT//FAMT/5000000,
97A	ACCOUNT	SAFE//PLEDGE
16S	END OF BLOCK	FIAC
MANDATORY SEQUENCE E SETTLEMENT DETAILS		

16R	START OF BLOCK	SETDET
22F	INDICATOR	SETR//TRAD
REPETITIVE MANDATORY SUBSEQUENCE E1 SETTLEMENT PARTIES		
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	DEAG//EMPOGRAA
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16R	START OF BLOCK	SETPRTY
95P	PARTY	PSET//BNGRGRAASSS
16S	END OF BLOCK	SETPRTY
16S	END OF BLOCK	SETDET

Αντίστοιχα η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ αν στείλει τη δική της ειδοποίηση προς το Σύστημα μέσω SWIFT, θα χρησιμοποιήσει το MT 542 (Ακύρωση μηνύματος ολικής αποδέσμευσης ενεχύρου τίτλων – ενεχυράζων τίτλους).

- για το MT 599

MT 592 REQUEST FOR CANCELLATION

Πεδίο	Τίτλος πεδίου	Χωρητικότητα/N/AN
20	TRN	16AN
21	RELATED REFERENCE (reference του μην/τος προς ακύρωση)	16AN
11S	MT & ημερομηνία αποστολής αρχικού μηνύματος	3N & 6N
79	NARRATIVE SPRO//ΚΣ-ΚΩΔΙΚΟΣ ΣΑΤ-ΑΡ.ΑΠΟΣΤΟΛΗΣ PREV//ΚΣ ΑΡΧΙΚΗΣ ΕΙΔΟΠΟΙΗΣΗΣ- ΑΡ.ΑΠΟΣΤ./ΕΤΟΣ	SPRO//90-4N-5N PREV//2N-5N/4N

Στην 1η γραμμή του πεδίου 79 αναγράφεται :
SPRO//ο κωδικός συναλλαγής για ακύρωση (ΚΣ 90), - (παύλα), ο κωδικός αριθμός του συμμετέχοντα φορέα στο Σύστημα (4N) - (παύλα), ο αριθμός αποστολής του μηνύματος αυτού (5N) χωρίς κενά μεταξύ τους.

Στη 2η γραμμή του πεδίου αναγράφονται τα στοιχεία της αρχικής συναλλαγής που πρέπει να ακυρωθεί. Αρχίζει με τον κωδικό PREV// και ακολουθούν : ο κωδικός συναλλαγής της αρχικής ειδοποίησης (2N), - (παύλα), ο αριθμός αποστολής της αρχικής ειδοποίησης (5N), / (κάθετος), το έτος αποστολής της αρχικής ειδοποίησης (4N) χωρίς κενά μεταξύ τους. Αν υπάρχει ασυμφωνία μεταξύ του TRN του μηνύματος προς ακύρωση (στο πεδίο 21) και του TRN του αρχικού μηνύματος, το στοιχείο αυτό (TRN) δεν λαμβάνεται υπόψη. Το Σύστημα ακυρώνει την συναλλαγή με βάση τον αριθμό αποστολής/έτος της αρχικής ειδοποίησης.

Για να **ταυτοποιηθεί** το μήνυμα αυτό (ακύρωση), πρέπει το Σύστημα να λάβει και μια αντίστοιχη ειδοποίηση από τον αντισυμβαλλόμενο. Αν η ειδοποίηση του αντισυμβαλλόμενου σταλεί μέσω SWIFT, τότε πρέπει να είναι ακυρωτικό μήνυμα τύπου 592 (MT 592).

ΠΑΡΑΔΕΙΓΜΑ

Έστω ότι η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ θέλει να ακυρώσει το μήνυμα MT 599 του παραδείγματος του δανεισμού τίτλων έναντι ενεχύρου.

Η ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ αποστέλλει προς το Σύστημα ένα MT 592 με αριθμό αποστολής 70814.

MT 592 – REQUEST FOR CANCELLATION

Πεδίο	Τίτλος πεδίου	Περιεχόμενο
20	TRN	AAAAAA...
21	RELATED REFERENCE	NANAN...
11S	MT	599
	DATE	011126
79	NARRATIVE	
	1η γραμμή	SPRO//90-0007-70814
	2η γραμμή	PREV//42-67435/2001

Αντίστοιχα η ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ αν στείλει τη δική της ειδοποίηση προς το Σύστημα μέσω SWIFT, θα χρησιμοποιήσει το MT 592 (Ακύρωση μηνύματος δανεισμού τίτλων έναντι ενεχύρου τίτλων – δανειζόμενος).

5. ΠΕΡΙΓΡΑΦΗ ΠΕΔΙΩΝ ΚΑΙ ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΕΓΚΥΡΟΤΗΤΑΣ ΤΩΝ

Πεδίο 11S : MT AND DATE OF ORIGINAL MESSAGE

Ισχύει για το MT 592

Περιγραφή

Το πεδίο πληροφορεί για τον τύπο του μηνύματος και την ημερομηνία που μπήκε στο SWIFT. Το Σύστημα δεν επεξεργάζεται το πεδίο αυτό.

Πεδίο 16R/16S : START OF BLOCK/END OF BLOCK

Ισχύει για τα MT 540, 541, 542, 543

Επιλογή κωδικών : GENL, TRADDET, FIAC, SETDET, SETPRTY, AMT, REPO, LINK.

Περιγραφή

Το πεδίο χαρακτηρίζει την έναρξη και τη λήξη της "ακολουθίας" (sequence) και "υποακολουθίας" (subsequence) πληροφοριών και χαρακτηρίζει το περιεχόμενό τους. Το Σύστημα δεν επεξεργάζεται το πεδίο αυτό.

Πεδίο 19 A : AMOUNT (Subsequence E3)

Ισχύει για τα MT 541, 543

Επιλογή κωδικών : SETT//EUR

Περιγραφή

Χρησιμοποιείται στα μηνύματα που αφορούν σε αγορά-πώληση (ΚΣ 10), έναρξη repos (ΚΣ 70), έναρξη buy/sell back (ΚΣ 78).

Στο πεδίο καταχωρείται το ποσό σε ευρώ στο οποίο διακανονίστηκε η συναλλαγή. Μετά τον κωδικό SET//EUR ακολουθούν μέχρι και 15 ακέραιοι αριθμοί (15N) και 2 δεκαδικοί (2D) αν υπάρχουν.

Πεδίο 19 A : REPURCHASE AMOUNT (Sequence D)

Ισχύει για τα MT 540, 541, 542, 543

Επιλογή κωδικών : REPA//EUR

Περιγραφή

Χρησιμοποιείται στα μηνύματα που αφορούν σε : λήξη repos (ΚΣ 70), λήξη buy/sell back (ΚΣ 78) και δανεισμό τίτλων καθορισμένης διάρκειας (ΚΣ 41).

Στο πεδίο καταχωρείται το ποσό σε ευρώ στο οποίο διακανονίστηκε η συναλλαγή. Μετά τον κωδικό SETT//EUR ακολουθούν μέχρι και 15 ακέραιοι αριθμοί (15N) και 2 δεκαδικοί (2D) αν υπάρχουν.

Σημείωση : Σε περίπτωση που το δάνειο είναι αόριστης διάρκειας συμπληρώνεται το πεδίο 70c στο ίδιο sequence και όχι τα 19A και 98A ή C.

Πεδίο 20 : TRN (TRANSACTION REFERENCE NUMBER)

Ισχύει για τα MT 592, 599

Περιγραφή

Το πεδίο μπορεί να περιέχει μέχρι και 16 αλφαριθμητικά (AN) στοιχεία. Το TRN (στοιχεία αποστολής) δίδεται στο μήνυμα από τον αποστολέα και πρέπει να είναι μοναδικό για όλες τις ειδοποιήσεις του προς το Σύστημα ανεξάρτητα από τον τρόπο μετάδοσής τους προς αυτό.

Πεδίο 20C : SENDER'S REFERENCE

1. Ισχύει για τα MT 540, 541, 542, 543 ως νέα μηνύματα (στο sequence A)
2. Ισχύει για τα MT 540, 541, 542, 543 ως ακυρωτικά μηνύματα (στο subsequence A1)

Επιλογή κωδικών : SEME//, PREV//

Περιγραφή

1) Αν το πεδίο αρχίζει με τον κωδικό SEME// τότε ο αποστολέας μπορεί να συμπληρώσει μέχρι και 16 αλφαριθμητικά (AN) στοιχεία, τα οποία πρέπει να είναι μοναδικά για όλες τις ειδοποιήσεις προς το Σύστημα ανεξάρτητα από τον τρόπο μετάδοσής τους προς αυτό.

2) Αν το πεδίο αρχίζει με τον κωδικό PREV// τότε ο αποστολέας μπορεί να συμπληρώσει μέχρι και 16 αλφαριθμητικά (AN) στοιχεία, τα οποία πρέπει να είναι μοναδικά για όλες τις ειδοποιήσεις προς το Σύστημα ανεξάρτητα από τον τρόπο μετάδοσής τους προς αυτό. Αν υπάρχει ασυμφωνία μεταξύ του TRN του μηνύματος που ορίζεται από το πεδίο αυτό και του TRN (στοιχεία αποστολής) της αρχικής ειδοποίησης (πεδίο 20C), το στοιχείο αυτό (TRN) δεν λαμβάνεται υπόψη, αλλά λαμβάνεται υπόψη ο αριθμός αποστολής.

Πεδίο 21 : RELATED REFERENCE

Ισχύει για το μήνυμα MT 592, MT 599

Περιγραφή

Στο πεδίο καταχωρούνται τα στοιχεία ενός άλλου μηνύματος που εστάλη προγενέστερα. Συγκεκριμένα, περιέχει το πεδίο 20 : TRN του προηγθέντος αρχικού μηνύματος. Αν υπάρχει ασυμφωνία μεταξύ του TRN του μηνύματος που ορίζεται από το πεδίο αυτό και του TRN (στοιχεία αποστολής) της αρχικής ειδοποίησης (πεδίο 79 : PREV//), το στοιχείο αυτό (TRN) δεν λαμβάνεται υπόψη, αλλά λαμβάνεται υπόψη ο αριθμός αποστολής.

Πεδίο 22F : INDICATOR

Ισχύει για τα MT 540, 541, 542, 543

Επιλογή κωδικών : SETR//TRAD Type of settlement transaction/Trade

Περιγραφή

Πληροφορεί για τον τύπο της συναλλαγής. Το Σύστημα δεν επεξεργάζεται το πεδίο αυτό.

Πεδίο 23G : FUNCTION OF THE MESSAGE

Ισχύει για τα MT 540, 541, 542, 543

Επιλογή κωδικών : NEWM, CANC

Περιγραφή

Χαρακτηρίζει τη λειτουργία του μηνύματος :

NEWM (New message) : Νέο μήνυμα

CANC (Cancellation) : Ακύρωση προηγούμενου μηνύματος

Πεδίο 35B : IDENTIFICATION OF THE FINANCIAL INSTRUMENT

Ισχύει για τα MT 540, 541, 542, 543

Περιγραφή

Το πεδίο αυτό είναι υποχρεωτικό και έχει τον τύπο ISIN GR10N. Στο πεδίο καταχωρείται ο κωδικός έκδοσης των τίτλων που αποτελούν το αντικείμενο της συναλλαγής.

Στοιχεία εγκυρότητας πεδίου

2. Στα μηνύματα που αφορούν σε αγορά-πώληση (ΚΣ 10), έναρξη-λήξη repos (ΚΣ 70), έναρξη-λήξη buy/sell back (ΚΣ 78), δανεισμός τίτλων (ΚΣ 41) και ενεχυρίαση τίτλων (ΚΣ 51), τα απαραίτητα στοιχεία καταχωρούνται στην πρώτη γραμμή. Οποιαδήποτε άλλη πληροφορία πρέπει να έπεται των παραπάνω στοιχείων. Η πληροφορία όμως αυτή, παρόλο που μπορεί να είναι υποχρεωτική για το SWIFT, δεν επεξεργάζεται από το Σύστημα.
3. Στα μηνύματα που αφορούν σε αντικατάσταση ή μερική αποδέσμευση ενεχύρου και ολική αποδέσμευση ενεχύρου τα απαραίτητα στοιχεία καταχωρούνται ως εξής :

α) Αντικατάσταση ενεχύρου ΚΣ 58, MT 540, 542 : Στην 1η γραμμή το ISIN των τίτλων που αντικαθίστανται, στη 2η γραμμή η ονομαστική αξία των τίτλων (μέχρι και 15 ακέραιοι αριθμοί (15N) και 2 δεκαδικοί (2D) αν υπάρχουν) που αντικαθίστανται, στην 3η γραμμή το ISIN των νέων τίτλων που δεσμεύονται και στην 4η γραμμή η ονομαστική αξία των νέων τίτλων (μέχρι και 15 ακέραιοι αριθμοί (15N) και 2 δεκαδικοί (2D) αν υπάρχουν) που δεσμεύονται.

β) Μερική αποδέσμευση ενεχύρου ΚΣ 58, MT 540, 542 : Στην 1η γραμμή το ISIN των τίτλων που αποδεσμεύονται, στη 2η γραμμή η ονομαστική αξία των τίτλων (μέχρι και 15 ακέραιοι αριθμοί (15N) και 2 δεκαδικοί (2D) αν υπάρχουν) που έχουν απομείνει, στην 3η γραμμή το ίδιο ISIN των τίτλων (1ης γραμμής) που δεσμεύονται και στην 4η γραμμή η ονομαστική αξία των πιο πάνω τίτλων (μέχρι και 15 ακέραιοι αριθμοί (15N) και 2 δεκαδικοί (2D) αν υπάρχουν) που δεσμεύονται.

γ) Ολική αποδέσμευση ενεχύρου ΚΣ 59, MT 540, 542 : Στην 1η γραμμή η αναφορά του ISIN είναι ενδεικτική. Το Σύστημα θα αποδεσμεύσει όλες τις ονομαστικές αξίες που έχουν απομείνει από όλους τους τίτλους που τυχόν έχουν δεσμευτεί νωρίτερα.

Οποιαδήποτε άλλη πληροφορία πρέπει να έπεται των παραπάνω στοιχείων. Η πληροφορία όμως αυτή, παρόλο που μπορεί να είναι υποχρεωτική για το SWIFT, δεν επεξεργάζεται από το Σύστημα.

Πεδίο 36B : QUANTITY OF FINANCIAL INSTRUMENT TO BE SETTLED

Ισχύει για τα MT 540, 541, 542, 543

Επιλογή κωδικών : SETT//FAMT, SETT//UNIT

Περιγραφή

- SETT//FAMT/ (Quantity of financial instrument to be settled – Face Amount) : καταχωρείται η ονομαστική αξία των τίτλων. Μετά τον κωδικό αυτό, αναγράφεται η ονομαστική αξία των τίτλων (μέχρι και 15 ακέραιοι αριθμοί (15N) και 2 δεκαδικοί (2D) αν υπάρχουν).

Σημείωση : Για τα μηνύματα που αφορούν σε αντικατάσταση ή μερική αποδέσμευση τίτλων και ολική αποδέσμευση τίτλων δεν λαμβάνονται υπόψη οι πληροφορίες που καταχωρούνται στο πεδίο αυτό αλλά οι πληροφορίες που καταχωρούνται στο πεδίο 35B του sequence B.

- SETT//UNIT/ (Quantity of financial instrument to be settled – Unit) : συμπληρώνεται στην περίπτωση που οι τίτλοι εκφράζονται σε μονάδες τοκομεριδίων. Συμπληρώνονται μέχρι και 15 ακέραιοι αριθμοί (15N) και ακολουθεί υποδιαστολή (,).

Πεδίο 70C : NARRATIVE (Sequence D)

Ισχύει για τα MT 540, 542

Επιλογή κωδικών : REPO//

Περιγραφή

Χρησιμοποιείται στα μηνύματα που αφορούν σε δανεισμό τίτλων αόριστης διάρκειας.

Το πεδίο αρχίζει με τον κωδικό REPO// και συμπληρώνεται με τη βάση υπολογισμού του τόκου (μέχρι και 15 ακέραιοι αριθμοί), - (παύλα), και το επιτόκιο υπολογισμού (μέχρι και 3 ακέραιοι αριθμοί (3N) και 4 δεκαδικοί (4D) χωρίς κενά μεταξύ τους.

Σημείωση : Σε περίπτωση που το δάνειο είναι ορισμένης διάρκειας συμπληρώνονται τα πεδία 98A ή C και 19A στο ίδιο sequence και όχι το 70C.

Πεδίο 70E : NARRATIVE

Ισχύει για τα MT 540, 541, 542, 543

Επιλογή κωδικών : SPRO//, PREV//

Περιγραφή

Στο πεδίο αυτό καταχωρούνται κωδικοποιημένες πληροφορίες για τις οποίες δεν υπάρχει ειδικό πεδίο.

- SPRO// Settlement instruction processing narrative
Το SPRO// καταχωρείται στην πρώτη γραμμή και ακολουθούν τα εξής στοιχεία :
ο κωδικός συναλλαγής (2N), - (παύλα), ο κωδικός αριθμός του συμμετέχοντα φορέα στο Σύστημα (4N), - (παύλα), ο αριθμός αποστολής (5N) χωρίς κενά μεταξύ τους.
- PREV// Previous reference (Αναφορά σε προηγούμενο μήνυμα).
Το PREV// καταχωρείται στη δεύτερη γραμμή και ακολουθούν τα στοιχεία ενός άλλου μηνύματος που εστάλη προγενέστερα, ως εξής:
ο κωδικός συναλλαγής της αρχικής ειδοποίησης (2N), - (παύλα), ο αριθμός αποστολής της αρχικής ειδοποίησης (5N), / (κάθετος), το έτος αποστολής της αρχικής ειδοποίησης (4N) χωρίς κενά μεταξύ τους.

Πεδίο 79 : NARRATIVE

1) Για το MT 592

Περιγραφή

Στο πεδίο καταχωρούνται πληροφορίες που είναι κωδικοποιημένες και για τις οποίες δεν υπάρχει ειδικό πεδίο.

Στοιχεία εγκυρότητας πεδίου

Στην 1η γραμμή του πεδίου 79 αναγράφεται :

SPRO//ο κωδικός συναλλαγής για ακύρωση (ΚΣ 90), - (παύλα), ο κωδικός αριθμός του συμμετέχοντα φορέα στο Σύστημα (4N), - (παύλα), ο αριθμός αποστολής του μηνύματος αυτού (5N) χωρίς κενά μεταξύ τους.

Στη 2η γραμμή του πεδίου αναγράφονται τα στοιχεία της αρχικής συναλλαγής που πρέπει να ακυρωθεί. Αρχίζει με τη λέξη PREV// και ακολουθούν : ο κωδικός συναλλαγής της αρχικής ειδοποίησης (2N), - (παύλα), ο αριθμός αποστολής της αρχικής ειδοποίησης (5N), / (κάθετος), το έτος αποστολής της αρχικής ειδοποίησης (4N) χωρίς κενά μεταξύ τους. Αν υπάρχει

ασυμφωνία μεταξύ του TRN του μηνύματος προς ακύρωση (στο πεδίο 21) και του TRN του αρχικού μηνύματος, το στοιχείο αυτό (TRN) δεν λαμβάνεται υπόψη. Το Σύστημα ακυρώνει την συναλλαγή με βάση τον αριθμό αποστολής της αρχικής ειδοποίησης.

2) Για το MT 599

Περιγραφή και στοιχεία εγκυρότητας των γραμμών

Στο πεδίο αυτό, που αναφέρεται σε ελεύθερο κείμενο, περιλαμβάνονται όλες οι απαραίτητες πληροφορίες για τη δημιουργία μιας ειδοποίησης.

Κάθε γραμμή του ελεύθερου κειμένου αρχίζει με μια αριθμητική σήμανση που ξεκινά από την αρχή της γραμμής και είναι αύξουσα με πρώτο αριθμό το ένα (1). Ακολουθεί άνω και κάτω τελεία (:). Στην πρώτη γραμμή αναγράφεται ο κωδικός αριθμός του συμμετέχοντα φορέα και τα λοιπά στοιχεία των υπόλοιπων γραμμών λαμβάνονται (ανάλογα με την περίπτωση) από το συνημμένο Πίνακα S1. Οι κενές γραμμές παραλείπονται.

Πεδίο 95P/95Q : PARTY

Ισχύει για τα μηνύματα MT 540, 541, 542, 543

Επιλογή κωδικών : DEAG//, REAG//

Περιγραφή

Στο πεδίο αυτό καταχωρούνται τα στοιχεία του αντισυμβαλλόμενου στη συναλλαγή. Στην περίπτωση που η αποστελλόμενη ειδοποίηση αφορά σε εσωτερική μεταβίβαση τίτλων (κωδικός συναλλαγής 22), στο πεδίο αυτό καταχωρούνται τα στοιχεία του λογαριασμού που πιστώνεται

Στοιχεία εγκυρότητας πεδίου

α) Για όλα τα μηνύματα εκτός της εσωτερικής μεταβίβασης :

95P : την ένδειξη DEAG// ή REAG// ακολουθεί η αναγραφή του κωδικού BIC (SWIFT) του αντισυμβαλλόμενου.

95Q : την ένδειξη DEAG// ή REAG// ακολουθεί ο κωδικός αριθμός του αντισυμβαλλόμενου με τη μορφή 4N,

β) Για τα μηνύματα της εσωτερικής μεταβίβασης :

95Q : την ένδειξη REAG// ακολουθεί ο αριθμός του λογ/σμού τίτλων που θα πιστωθεί με τη μορφή 12N.

Επιλογή κωδικού : PSET//

Περιγραφή

Επαναλαμβανόμενο υποχρεωτικό πεδίο στο οποίο καταχωρείται ο κωδικός BIC του Συστήματος Παρακολούθησης Συναλλαγών επί Τίτλων με Λογιστική Μορφή (BOGS) της Τράπεζας της Ελλάδος (BNGRGRAASSS).

Πεδίο 97A : ACCOUNT

Ισχύει για τα μηνύματα MT 540, 541, 542, 543

Επιλογή κωδικών : SAFE//

Περιγραφή

Στο πεδίο αυτό καταχωρείται ο αριθμός του λογ/σμού τίτλων που εμπλέκεται στη συναλλαγή ή η ένδειξη PLEDGE (ΚΣ 51 Ενεχύραση τίτλων για συναλλαγές εκτός Συστήματος – Ενεχυρούχος δανειστής, ΚΣ 58 Αντικατάσταση ενεχύρου τίτλων – Ενεχυρούχος δανειστής, ΚΣ 59 Ολική αποδέσμευση ενεχύρου τίτλων – Ενεχυράζων τίτλους και Ενεχυρούχος δανειστής).

Στοιχεία εγκυρότητας πεδίου

Η αναγραφή του αριθμού λογ/σμού τίτλων ή της ένδειξης PLEDGE (για συναλλαγές ενεχύρασης) είναι υποχρεωτική.

Πεδίο 98A/98C : DATE/TIME

Ισχύει για τα MT 540, 541, 542, 543

Επιλογή κωδικών : SETT//, TRAD//, TERM//

Περιγραφή

Καταχωρείται η ημερομηνία και ώρα της συναλλαγής, ως εξής :

98 A : καταχωρείται μόνο η ημερομηνία

98 C : καταχωρείται ημερομηνία και ώρα

- iii) SETT// Settlement date/time : ημερομηνία/ώρα διακανονισμού της συναλλαγής. Η ημερομηνία/ώρα πρέπει :
 - α) να είναι εργάσιμη ημέρα και ώρα για το Σύστημα.
 - β) να μην είναι προγενέστερη της ημερομηνίας λήψης του μηνύματος από το Σύστημα και
 - γ) να μην είναι ίδια ή μεταγενέστερη της ημερομηνίας λήξης των τίτλων.

- iv) TRAD// Trade date : ημερομηνία συμφωνίας της συναλλαγής.
Η ημερομηνία πρέπει να είναι προγενέστερη ή ίδια με την ημερομηνία λήψης του μηνύματος από το Σύστημα.

- ν) TERM// (Repurchase date/time) : ημερομηνία/ώρα λήξης της συναλλαγής.
Η ημερομηνία/ώρα πρέπει :
 - α) να είναι εργάσιμη ημέρα και ώρα για το Σύστημα.
 - β) να μην είναι προγενέστερη της ημερομηνίας λήψης του μηνύματος από το Σύστημα και
 - γ) να μην είναι ίδια ή μεταγενέστερη της ημερομηνίας λήξης των τίτλων.

Στοιχεία εγκυρότητας πεδίου

Η ημερομηνία και η ώρα πρέπει να γράφονται με την εξής μορφή : YYYYMMDD (έτος, μήνας, ημέρα) και HHMMSS (ώρα, λεπτά, δευτερόλεπτα). Π.χ. η 26 Νοεμβρίου 2001 και ώρα 1.30 μ.μ. καταχωρούνται : 20011126133000.

*
* *

Π Ι Ν Α Κ Α Σ S1

A/A	Χωρητικότητα/A/AN	ΠΕΡΙΓΡΑΦΗ
1	4N	Κ.Α. συμμετέχοντα φορέα
2	2N	Κωδικός συναλλαγής
3	8N	Ημερομηνία συμφωνίας της συναλλαγής ή αποστολής για ΚΣ 81
4	5N	Αριθμός αποστολής
5	16AN	Σχετικό ή TRN της αρχικής ειδοποίησης
6	4N	Έτος αποστολής της αρχικής ειδοποίησης
7	5N	Αριθμός αποστολής της αρχικής ειδοποίησης
8	12N	Αριθμός λογαριασμού τίτλων
9	1A	Θέση αποστολέα
10	8N ή 14N	Ημερομηνία/ώρα διακανονισμού (valeur) της συναλλαγής ή απόκτησης των τίτλων για ΚΣ 81
11	8N ή 14N	Ημερομηνία/ώρα λήξης
12	4N	Κ.Α. αντισυμβαλλομένου
13	12N	Λογαριασμός τίτλων που πιστώνεται (εσωτερική μεταβίβαση)
14	12N	Κωδικός ISIN των παραδοθέντων τίτλων
15	15N,2D	Ονομαστική αξία
16	15N,2D	Αξία διακανονισμού
17	15N,2D	Αξία διακανονισμού στη λήξη
18	15N,2D	Ποσό σε ευρώ του καταβαλλόμενου τόκου
19	15N,2D	Βάση υπολογισμού
20	3N,4D	Επιτόκιο
21	12N	Κωδικός ISIN ενεχυραζόμενων τίτλων
22	15N,2D	Ονομαστική αξία ενεχυραζόμενων τίτλων
23	12N	Κωδικός ISIN των αποδεσμευόμενων από το ενέχυρο τίτλων
24	15N,2D	Ονομαστική αξία των αποδεσμευόμενων από το ενέχυρο τίτλων
25	12N	Κωδικός ISIN των παραληφθέντων από τον αντισυμβαλλόμενο τίτλων
26	15N,2D	Ονομαστική αξία των παραληφθέντων από τον αντισυμβαλλόμενο τίτλων
27	15N,2D	Καταβλητέο ποσό σε ευρώ (για swap)
28	1A Δικαιούχος	
29		
30		
31	15N,2D	Χρηματικό ποσό την ημερομηνία διακανονισμού (valeur)
32	1A	Κατεύθυνση λογιστικοποίησης (Χρέωση=D / Πίστωση=C)
33	15N,2D	Χρηματικό ποσό στην λήξη
34	1A	Κατεύθυνση λογιστικοποίησης (Χρέωση=D / Πίστωση=C)
35	15N,2D	Συμπληρωματική ονομαστική αξία
36	1A	Κατεύθυνση λογιστικοποίησης (Αγορά=A / Πώληση=V)

ΕΠΕΞΗΓΗΣΗ ΚΩΔΙΚΩΝ

N	=	Ακέραιοι αριθμοί
D	=	Δεκαδικοί αριθμοί
A	=	Γράμματα
AN	=	Γράμματα-αριθμοί
ΚΣ	=	Κωδικός συναλλαγής