

ΠΡΟΣ : Μέλη και Θεματοφύλακες Χρηματιστηρίου Αξιών Κύπρου
ΑΠΟ : Αναπλ. Γενικό Διευθυντή Χρηματιστηρίου Αξιών Κύπρου
ΘΕΜΑ : **Ετήσιος Έλεγχος Κανονιστικής Συμμόρφωσης (ΕΕΚΣ) Μελών/ Θεματοφυλάκων ΧΑΚ για το έτος 2020**
ΗΜΕΡ. : 02 Ιουλίου 2021
ΑΡ. ΕΓΚ. : 09-2021/ 05-2021

Κύριοι,

Το Χρηματιστήριο Αξιών Κύπρου (ΧΑΚ) θα προχωρήσει στη διενέργεια του Ετήσιου Ελέγχου Κανονιστικής Συμμόρφωσης (ΕΕΚΣ) των Μελών και Θεματοφυλάκων ΧΑΚ, για το έτος 2020.

Ο έλεγχος αυτός (ΕΕΚΣ) εστιάζεται στη συμμόρφωση των Μελών ως προς τις προϋποθέσεις οργανωτικής επάρκειας που προκύπτουν από την εφαρμογή της Οδηγίας MiFID II. Ενδεχομένως δε να ζητηθούν συμπληρωματικές αξιολογήσεις, με σκοπό τη συνεχή πλήρωση των προϋποθέσεων απόκτησης και διατήρησης της ιδιότητας τους, ως Μέλη των Αγορών / του Κεντρικού Αποθετηρίου – Μητρώου του ΧΑΚ.

Στο πλαίσιο εφαρμογής του ΕΕΚΣ, θα πρέπει οι υπεύθυνοι Κανονιστικής Συμμόρφωσης Μελών/ Θεματοφυλάκων (Λειτουργοί Συμμόρφωσης) να υποβάλλουν συμπληρωμένα τα πιο κάτω επισυναπτόμενα:

- α)** Το Έντυπο Ετήσιου Ελέγχου Κανονιστικής Συμμόρφωσης (**E1**),
- β)** Το Έντυπο με τα Χρηματοοικονομικά Στοιχεία (**E2**) καθώς και,
- γ)** Το Έντυπο Due Diligence (**E3**).

Το έντυπο [E.1] για το έτος 2020 (επισυνάπτεται) περιλαμβάνει τις ακόλουθες ενότητες που θα τύχουν αξιολόγησης:

- Στοιχεία Μέλους
- Χρηματοοικονομικά Στοιχεία
- Οργανωτική Επάρκεια/Ερωτηματολόγιο
- Επικαιροποιημένα Νομιμοποιητικά Έντυπα, στα οποία συμπεριλαμβάνονται: α) οι Ελεγμένες Οικονομικές Καταστάσεις για το έτος 2020, καθώς και β) ο Εσωτερικός Κανονισμός, μόνο στην περίπτωση που υπάρχει τροποποίηση. Σημειώνεται ότι θα πρέπει με τις Οικονομικές καταστάσεις, να υποβάλλεται επίσης και η έκθεση Εγκεκριμένου Ελεγκτή, ο οποίος να έχει ελέγξει τους λογαριασμούς – οικονομικές καταστάσεις, σύμφωνα με τα Διεθνώς Αποδεκτά Ελεγκτικά Πρότυπα.

Το έντυπο [E.2] για το έτος 2020 (επισυνάπτεται) αναφέρεται στα Χρηματοοικονομικά Στοιχεία Θεματοφυλάκων και Μελών τα οποία προβαίνουν σε Εκκαθάριση Χρηματιστηριακών Συναλλαγών (Άμεσα, Έμμεσα).

Το έντυπο [E.3] (επισυνάπτεται) αφορά το Due Diligence Counter Terrorist Financing and Sanctions Questionnaire

Η συμπλήρωση των χρηματοοικονομικών στοιχείων στα έντυπα E.1 και E.2, θα πρέπει να γίνεται με βάση τις τελευταίες Ετήσιες Ελεγμένες Οικονομικές Καταστάσεις των Μελών.

Διαδικασία αποστολής και χρονοδιάγραμμα ενεργειών

Ημερομηνίες	Ενέργεια	Ηλεκτρονική Διεύθυνση
Από τη Δευτέρα, 5 Ιουλίου 2021 μέχρι τη Δευτέρα 6 Σεπτεμβρίου 2021	Υποβολή συμπληρωμένου Ερωτηματολογίου Έντυπο ([E.1])	membership.assessment@cse.com.cy
	Υποβολή συμπληρωμένου εντύπου [E.2] που αφορά στα Χρηματοοικονομικά Στοιχεία Μελών	
	Υποβολή υποστηρικτικού υλικού όπως Ελεγμένες Οικονομικές Καταστάσεις για το έτος 2020, καθώς και Εσωτερικός Κανονισμός Μέλους στην περίπτωση που έχει τροποποιηθεί.	
Από 5 Ιουλίου 2021 μέχρι 19 Ιουλίου 2021	Υποβολή εντύπου Due Diligence[E.3]	

Παρακαλούνται επίσης οι Θεματοφύλακες του ΧΑΚ όπως συμπληρώσουν τα ερωτηματολόγια με τον ίδιο τρόπο, για τα μέρη που τους αφορά.

Για οποιοσδήποτε επιπρόσθετες πληροφορίες ή επεξηγήσεις, παρακαλώ όπως επικοινωνείτε σχετικά, με τους συνάδελφους Λειτουργούς στο ΧΑΚ κα Μαρία Σολωμού, ή τον κ. Μιχάλη Μιχαήλ για θέματα Μελών Διαπραγμάτευσης στο τηλέφωνο 22712333, καθώς επίσης και με το Λειτουργό Α', κ. Φύτο Γαλαξή, ή το Λειτουργό κ. Γιώργο Χατζησπύρου στο τηλέφωνο 22712300, για θέματα Εκκαθάρισης και Θεματοφυλακής/ Due Diligence.

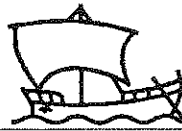
Σας ευχαριστώ για την ανταπόκριση σας.

Με εκτίμηση

Νίκος Τρυπάτσας
Αναπλ. Γενικός Διευθυντής

Εσώκλ.:

Κοιν: Επιτροπή Κεφαλαιαγοράς Κύπρου



Ετήσιος Έλεγχος Κανονιστικής Συμμόρφωσης Μελών 2020

Στοιχεία Μέλους

Κωδικός LEI (Legal Entity Identifier) :

Επωνυμία Μέλους :

Υπεύθυνος Κανονιστικής Συμμόρφωσης :

Χρηματοοικονομικά Στοιχεία

Μετοχικό Κεφάλαιο :

Ίδια Κεφάλαια :

Ίδια Εποπτικά Κεφάλαια :

Νόμισμα :

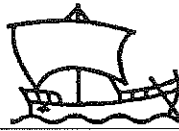
Οικονομικό Έτος :

Ερωτήσεις προς όλα τα Μέλη του Χρηματιστηρίου Αξιών Κύπρου

- 1 Περιγράψτε συνοπτικά πώς επιτυγχάνει η εταιρεία σας την οργανωτική και λειτουργική επάρκεια που απαιτείται βάσει των ιδιοτήτων Μέλους που κατέχει στο Χρηματιστήριο Αξιών Κύπρου τηρούμενων (ΧΑΚ) και των προβλέψεων του Κανονισμού (ΕΕ) 2017/584. Επιπρόσθετα, αναφέρετε κατά πόσον κύριες δραστηριότητες της εταιρείας σας έχουν ανατεθεί σε εξωτερικό συνεργάτη (outsourcing).
- 2 Περιγράψτε αναλυτικά τους μηχανισμούς/διαδικασίες που τηρείτε για την αποτροπή σύγκρουσης συμφερόντων, με σκοπό τη τήρηση των διατάξεων της νομοθεσίας περί κατάχρησης αγοράς και ελέγχου συναλλαγών.
- 3 Στα τμήματα που αναφέρονται στο υφιστάμενο οργανόγραμμα της εταιρείας σας και που σχετίζονται άμεσα με τις παραπάνω ιδιότητες που αφορούν το ΧΑΚ, απασχολούνται μόνο Πιστοποιημένα στελέχη;
Αν όχι, αιτιολογείστε γιατί.
- 4 Εξηγήστε πώς λαμβάνετε μέριμνα, ώστε όλα τα απασχολούμενα άτομα στα τμήματα με δραστηριότητες σχετικές με τις παραπάνω ιδιότητες, να τηρούν τις υποχρεώσεις που απορρέουν από τον Εσωτερικό σας Κανονισμό.
- 5 Περιγράψτε συνοπτικά τους μηχανισμούς ελέγχου και ασφαλείας στον τομέα ηλεκτρονικής επεξεργασίας δεδομένων που εφαρμόζετε.
- 6 Περιγράψτε αναλυτικά τον τρόπο με τον οποίο εξασφαλίζετε τη διάκριση μεταξύ των θέσεων για ΙΔΙΟ λογαριασμό (εάν έχετε) και αυτών των πελατών σας, από την στιγμή ολοκλήρωσης μιας συναλλαγής μέχρι και την οριστική εκκαθάρισή της.
- 7 Περιγράψτε συνοπτικά τη θεσπισμένη πολιτική αδιάλειπτης λειτουργίας και σχέδιο έγκαιρης αποκατάστασης λειτουργίας (Business Continuity Plan - BCP), με την οποία εξασφαλίζετε την συνεχή εκπλήρωση των υποχρεώσεων που απορρέουν από τις παραπάνω ιδιότητες. Πότε πραγματοποιήθηκε η τελευταία δοκιμή του Σχεδίου Επείξευρησιακής Συνέχειας της Εταιρείας σας;
- 8 Έχει γίνει έλεγχος στην εταιρεία σας από τον αρμόδιο Εποπτικό Φορέα εντός του 2020; Αν ναι,



- αναφέρατε συνοπτικά τα ευρήματα/αποτελέσματά του ελέγχου αυτού.
- 9 Σας έχει επιβληθεί κύρωση από τον αρμόδιο Εποπτικό Φορέα εντός του 2020; Αν ναι, περιγράψτε συνοπτικά τους λόγους, την επιβληθείσα κύρωση και τις δικές σας σχετικές ενέργειες.
- 10 Πότε διεξήχθηκε ο τελευταίος εσωτερικός έλεγχος στις διαδικασίες που σχετίζονται με τις παραπάνω ιδιότητες;
- 11 Από τον παραπάνω εσωτερικό έλεγχο έχουν προκύψει σχετικά ευρήματα ή περιστατικά με τις υποχρεώσεις της εταιρείας σας, αναφορικά με τις ιδιότητες δραστηριοποίησης σας στο ΧΑΚ τα οποία μπορούν να επηρεάσουν ουσιωδώς τη λειτουργία σας; Αν ναι, περιγράψτε αναλυτικά ποια ήταν αυτά τα ευρήματα και τις ενέργειες που ελήφθησαν.
- 12 Περιγράψτε συνοπτικά τις δοκιμές συμμόρφωσης στις API εφαρμογές που διαθέτετε (conformance testing) και τις διαδικασίες με τις οποίες επιβεβαιώνετε την προσβασιμότητα των χρηστών σας σε αυτές.
- 13 Περιγράψτε συνοπτικά τους προσυναλλακτικούς ελέγχους που εφαρμόζετε αναφορικά με την τιμή, τον όγκο και την αξία των εντολών στις API εφαρμογές που διαθέτετε.
- 14 Περιγράψτε συνοπτικά τις διαδικασίες που ακολουθείτε για την υποχρέωση ενημέρωσης του Χρηματιστηρίου με τις εμπλουτισμένες πληροφορίες ανά εντολή (Order Record Keeping).
- 15 Παρέχετε στους πελάτες σας Άμεση Ηλεκτρονική Πρόσβαση (DEA);
Εάν ναι, περιγράψτε συνοπτικά τις διαδικασίες εγκρίσεων πελατών και ελέγχου που ακολουθείτε.
- 16 Έχετε πελάτες που παρέχουν Άμεση Ηλεκτρονική Πρόσβαση (DEA) σε δικούς τους πελάτες;
Εάν ναι, περιγράψτε συνοπτικά τους ελέγχους που διενεργείτε σε αυτούς τους πελάτες.
- 17 Δραστηριοποιείστε μέσω Αλγοριθμικών Συναλλαγών (Algo Trading) στο Χρηματιστήριο Αξιών Κύπρου;
Αν ναι, περιγράψτε τις οργανωτικές ρυθμίσεις που διαθέτετε, τις διαδικασίες ελέγχου ανθεκτικότητας των συστημάτων σας, καθώς και την ετήσια αυτοαξιολόγηση που ακολουθείτε.
- 18 Πόσες περιπτώσεις υπερημερίας πελατών αντιμετωπίσατε τον τελευταίο χρόνο και ποιες διαδικασίες ακολουθήσατε για τη διευθέτησή τους;
Πόσες από αυτές τις περιπτώσεις οδήγησαν στη διενέργεια συναλλαγών κάλυψης;
- 19 Περιγράψτε συνοπτικά το μοντέλο διαχείρισης των παρεχόμενων από τους πελάτες σας εξασφαλίσεων για την κάλυψη θέσης προς την Υπηρεσία Εκκαθάρισης του ΧΑΚ. Εναλλακτικά, μπορείτε να επισυνάψετε το σχετικό κείμενο/διαδικασία.
- 20 Περιγράψτε συνοπτικά το μοντέλο διαχείρισης κινδύνου που εφαρμόζετε.
- 21 Περιγράψτε συνοπτικά τα κριτήρια/ρυθμίσεις/διαδικασίες πρόσβασης των πελατών, στις υπηρεσίες που σχετίζονται άμεσα με τις παραπάνω ιδιότητες.
- 22 Περιγράψτε συνοπτικά τον τρόπο συνεργασίας και σύμπραξης με Μέλη Διαπραγμάτευσης, όσον αφορά στη διενέργεια συναλλαγών, την διευθέτηση υπερημεριών και την κάλυψη του κινδύνου για τις εν λόγω συναλλαγές. (Να απαντηθεί από Θεματοφύλακες και Εκκαθαριστικά Μέλη)
- 23 Διεξάγετε ελέγχους με αντιπαραβολή των στοιχείων μερίδας των πελατών σας ή και των υπολοίπων, μεταξύ του Συστήματος Άυλων Τίτλων και των δικών σας συστημάτων; Παρακαλώ επεξηγήστε.
- 24 Διεξάγετε ετησίως διαδικασία επικαιροποίησης στοιχείων των μερίδων των πελατών σας; Παρακαλώ επεξηγήστε.
- 25 Περιγράψτε τον κύριο μηχανισμό/διαδικασία με τον οποίο επιβεβαιώνεται καθημερινά ο/η ομαλός/ή εκκαθάριση/διακανονισμός των συναλλαγών σας.
- 26 Ποιους μηχανισμούς διαθέτει η εταιρεία σας για την έγκαιρη αντιμετώπιση τυχόν προβλημάτων στην εκκαθάριση/διακανονισμό των συναλλαγών;
- 27 Υπάρχουν άλλα γεγονότα, ή στοιχεία, που μπορούν να επηρεάσουν τη λειτουργία της εταιρείας σας ως Μέλος και δεν έχουν αναφερθεί παραπάνω;
- 28 Υπάρχει οποιαδήποτε μεταβολή σε οποιαδήποτε από τα στοιχεία με βάση τα οποία η αίτηση σας



ως Μέλος του ΧΑΚ έγινε αποδεκτή; Αν ναι, ποια είναι αυτά;

Επικαιροποιημένα Νομιμοποιητικά Έντυπα

Θα πρέπει να αποσταλούν στην ακόλουθη ηλεκτρονική διεύθυνση membership.assessment@cse.com.cy τα ακόλουθα: α) οι Ελεγμένες Οικονομικές Καταστάσεις για το έτος 2020, καθώς και

Σε περίπτωση που κάποιο από τα παρακάτω έγγραφα έχει τροποποιηθεί σε σχέση με αυτά που έχουν ήδη κατατεθεί στο ΧΑΚ θα πρέπει να υποβληθούν ηλεκτρονικά εκ νέου στην προαναφερόμενη ηλεκτρονική διεύθυνση.

- Αντίγραφο της άδειας λειτουργίας που έχει παραχωρηθεί στο Μέλος από την αρμόδια Εποπτική Αρχή
- Ιδρυτικό Έγγραφο/ Καταστατικό εταιρείας
- Πιστοποιητικό Σύστασης
- Πιστοποιητικό Μετόχων
- Πιστοποιητικό Διευθυνόντων Συμβούλων
- Οργανόγραμμα
- Εσωτερικός Κανονισμός του Μέλους εφόσον έχει τροποποιηθεί



Χρηματοοικονομικά Στοιχεία Μελών

Γενικά Στοιχεία Μέλους

Όνομασία Μέλους στα Αγγλικά	:
Εκκαθαριστικό Μέλος αγοράς Αξιών	: Άμεσο / Γενικό / Όχι
LEI Code	:
Κατηγορία Μέλους:	: ΕΠΕΥ / Τράπεζα

Χρηματοοικονομικά Στοιχεία από τις ετήσιες & εξαμηνιαίες ελεγμένες οικονομικές καταστάσεις

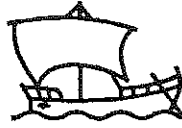
Ημερομηνία Οικονομικών καταστάσεων	:
Απαιτήσεις Από Πελάτες	:
Μετρητά – ως ταμειακά διαθέσιμα (+καταθέσεις)	:
Αγοραία Αξία Αξιών (ομόλογα, μετοχές, ΔΑΚ)	:
Καθαρή μεταβολή στα ταμειακά διαθέσιμα (free cash-flow)	:
Κυκλοφορούν Ενεργητικό	:
Σύνολο Ενεργητικού	:
Μετοχικό Κεφάλαιο	:
Σύνολο Ιδίων Κεφαλαίων	:
Σύνολο Μακροπρόθεσμων Υποχρεώσεων	:
Σύνολο Βραχυπρόθεσμων Υποχρεώσεων	:
Βραχυπρόθεσμες Δανειακές Υποχρεώσεις (<1Υ)	:
Μακροπρόθεσμες Δανειακές Υποχρεώσεις (>1Υ)	:
Κύκλος Εργασιών	:
Μικτά Κέρδη	:
Κέρδη μετά φόρων	:

Στοιχεία αναφορικά με την Κεφαλαιακή Επάρκεια

Δείκτης κεφαλαιακής επάρκειας (ή δείκτης φερεγγυότητας)	:
Ελάχιστο όριο δείκτη κεφαλαιακής επάρκειας	:
CET1 (αν δεν είναι διαθέσιμο τότε το λόγο που δεν είναι διαθέσιμο)	:
Tier1 στην περίπτωση που δεν είναι διαθέσιμο το CET1 (αν δεν είναι διαθέσιμο αναφέρατε το λόγο που δεν είναι διαθέσιμο)	:

Συνολική έκθεση από συμμετοχή σε τρίτους Κεντρικούς Αντισυμβαλλομένους (Κ.Α.) σε ισοδύναμο EUR - ECB Fixing¹

Ποσό προ-χρηματοδοτημένων πόρων (καταβληθείσα μερίδα στο κεφάλαιο εκκαθάρισης) σε τρίτους Κ.Α.	:
Μέγιστο ποσό απώλειας από υποχρέωση παροχής μη προ-χρηματοδοτημένων πόρων προς τρίτους Κ.Α., δηλ. υποχρέωση καταβολής επιπρόσθετων ποσών, πέραν της	:



καταβληθείσας μερίδας στο κεφάλαιο εκκαθάρισης, μετά από απαίτηση του Κ.Α. (π.χ. για κάλυψη ζημίας από χρεοκοπία άλλου εκκαθαριστικού μέλους στους διαφόρους Κ.Α. όπου συμμετέχει).

Δείκτης Κάλυψης Ρευστότητας (η ερώτηση αφορά αποκλειστικά τραπεζικά ιδρύματα)

LCR (%)

LCR Limit (%)

¹ Αφορά τα στοιχεία της Κεφαλαιακής Επάρκειας για το έτος 2020

Due Diligence Anti-Money Laundering, Counter Terrorist Financing and Sanctions Questionnaire

General Information SECTION A		
1	Company Name:	
	Address:	
	City:	
	Post Code:	
	Country:	
	Contact Information (Name):	
	Phone:	
	E-mail:	
2	Investment Services Firm <input type="checkbox"/>	Credit institution <input type="checkbox"/>
3	Regulatory Authority:	
4	Please specify the Country's legislative system under which your operations are subject to.	
5	Is your institution a branch or subsidiary?	YES <input type="checkbox"/> NO <input type="checkbox"/>
5a	If your answer in question 6 is 'Yes' please specify the ultimate parent company.	
Ownership and Management Information SECTION B		
6	Please provide a list of the major shareholders or natural person(s) who exercise control or ultimately have controlling ownership of more than 10% in your institution alone or together with other natural person(s)/ shareholders in any way (e.g. intermediary).	
General AML Policies, Practices and Procedures SECTION C		
7	Is your institution subject to specific Law or Regulations applicable to Anti-Money Laundering (AML), Counter-Terrorism Financing (CTF) and economic sanctions (sanctions)?	YES <input type="checkbox"/> NO <input type="checkbox"/>
7a	If 'Yes' please specify the relevant: <ul style="list-style-type: none"> • Laws and Regulations. • Jurisdiction under which these Laws are applicable. • Government Supervisors / Regulators responsible for its implementation and supervision. 	
8	Do you have AML, CTF and sanctions policy / framework and procedures?	YES <input type="checkbox"/> NO <input type="checkbox"/>
8a	If 'Yes' to Q8 are the AML, CTF and sanctions policy / framework and procedures approved by your institution's Board or Senior Management?	YES <input type="checkbox"/> NO <input type="checkbox"/>
8b	If 'Yes' to Q8a do you have a designated Compliance Officer responsible for AML, CTF and sanctions policy / framework and procedures?	YES <input type="checkbox"/> NO <input type="checkbox"/>
9	Does your institution use third parties or agents' services to carry out any of its AML, CTF and sanctions related functions?	YES <input type="checkbox"/> NO <input type="checkbox"/>
9a	If 'Yes' do you assess the adequacy of third party services on AML, CTF and sanctions controls?	YES <input type="checkbox"/> NO <input type="checkbox"/>
Customer Due Diligence SECTION D		
12	Does your institution implement due diligence and procedures to identify and regularly update the information of all clients?	YES <input type="checkbox"/>

	How Often	NO <input type="checkbox"/>
	
13	Does your institution periodically perform risk assessment arising from the provision of services (including custody) to each of your clients taking into consideration their activity?	YES <input type="checkbox"/> NO <input type="checkbox"/>
14	Does your institution make an AML / CTF and sanctions assessment of its clients and their transactions?	YES <input type="checkbox"/> NO <input type="checkbox"/>
15	Does your institution exclude and block, transactions by persons and entities sanctioned by Competent Authorities i.e. UN, EU, USA and UK?	YES <input type="checkbox"/> NO <input type="checkbox"/>
16	Does your institution exclude and block the execution of transactions that you may suspect that ultimately came from a person or entity under sanctions?	YES <input type="checkbox"/> NO <input type="checkbox"/>
17	Does your institution prohibit accounts / relationships with shell banks and/or shell companies?	YES <input type="checkbox"/> NO <input type="checkbox"/>
18	Do you operate omnibus accounts?	YES <input type="checkbox"/> NO <input type="checkbox"/>
18a	In cases where you operate omnibus accounts do you determine ultimate beneficiaries of securities?	YES <input type="checkbox"/> NO <input type="checkbox"/>
18b	If 'Yes' do you follow the same AML / CTF and sanctions policy as described in questions 12 to 17 above for the beneficiaries of the omnibus account ?	YES <input type="checkbox"/> NO <input type="checkbox"/>
19	Please indicate the percentage of your clients location (based on assets value): <ul style="list-style-type: none"> • Domestic Clients. • Foreign Clients. %%
20	Please confirm completion of Wolfsberg's CBDDQ or FCCQ	YES <input type="checkbox"/> NO <input type="checkbox"/>

Declaration

We certify and assure that our actions will not cause the CYPRUS CSD or linked CSDs to violate local and international / global AML, CTF and sanctions recommendations and standards. Additionally regardless of whether or not we fall under the EU jurisdiction we commit to all EU Laws and Regulations on AML, CTF and sanctions and will not engage in a client relationship that potentially may lead to the violation in anyway of EU and international / global AML, CTF and sanctions Laws Regulations, Recommendations and Standards.

Completed by Compliance Officer:

First Name:

Last Name:

Email Address:

Telephone:

Signature

Date

.....

.....

Compliance Officer