

**ΠΡΟΣ :** Μέλη, Θεματοφύλακες και Τράπεζες Διακανονισμού του Χρηματιστηρίου Αξιών Κύπρου - Χειριστές ΣΑΤ/ΧΑΚ

**ΑΠΟ :** Αναπληρωτή Γενικό Διευθυντή Χρηματιστηρίου Αξιών Κύπρου

**ΘΕΜΑ :** Ενημέρωση αναφορικά με το πλάνο μετάβασης Χρηματικού Διακανονισμού σε περιβάλλον T2-T2S Consolidation

**ΗΜΕΡ. :** 14 Ιουλίου, 2022

**ΑΡ. ΕΓΚ. :** 14-2022 / 11-2022

---

Κύριοι,

Στην παρούσα εγκύκλιο παραθέτουμε τις ενέργειες που θα πρέπει να εκτελέσουν οι Τράπεζες Διακανονισμού (ΤΔ) και τα Εκκαθαριστικά Μέλη και οι Θεματοφύλακες / Χειριστές του ΧΑΚ, σε συντονισμό με τις αντίστοιχες ενέργειες του Χρηματιστηρίου, προκειμένου να πραγματοποιηθούν οι δοκιμές **“Ancillary Systems Testing Campaign”** που έχουν προγραμματιστεί από το Ευρωσύστημα στα πλαίσια υλοποίησης του έργου **T2-T2S Consolidation project** και στα οποία θα συμμετέχουν τα Επικουρικά Συστήματα (ΕΣ) του Target2 με τους Συμμετέχοντες τους.

Σημειώνεται ότι οι δοκιμές στην Ευρωπαϊκή Ένωση έχουν ήδη ξεκινήσει, αφού έχουν προγραμματιστεί για το διάστημα **11/7/2022 – 29/7/2022** με εξαίρεση το διάστημα **15-17/07/2022** κατά το οποίο θα πραγματοποιηθούν οι δοκιμές μετάπτωσης «T2-T2S Migration Weekend Dress Rehearsal» προσομοιώνοντας το Σαββατοκύριακο της μετάβασης, από το υφιστάμενο περιβάλλον Target2 στο περιβάλλον Target consolidation. Ταυτόχρονα σημειώνεται ότι το Χρηματιστήριο βρίσκεται στα τελικά στάδια / οριστικοποίηση κάποιων τεχνικών αλλαγών και με την ολοκλήρωσή τους θα σας αποσταλούν οι ακριβείς ημερομηνίες διεξαγωγής των δοκιμών.

Το ΕΣ του Χρηματιστηρίου θα διατηρήσει την υφιστάμενη διαδικασία χρηματικού διακανονισμού στο νέο περιβάλλον T2-T2S Consolidation, με μετονομασία της διαδικασίας **«Settlement procedure 6 — Dedicated liquidity, real-time and cross-system settlement (AS6)»** που σήμερα χρησιμοποιεί σε διαδικασία **C (AS Settlement procedure C)**, με χρήση υπολογαριασμών (sub accounts) που θα ανοίγονται κάτω από τον RTGS DCA (Dedicated Cash Accounts) της Τράπεζας Διακανονισμού. Η βασική διαφορά που υπάρχει συγκριτικά με την υφιστάμενη διαδικασία, είναι ότι καταργείται η ημερήσια διαδικασία που σήμερα εκτελείται κάθε πρωί από το Χρηματιστήριο και αντικαθίσταται από μία αυτοματοποιημένη διαδικασία από το Target2 κατά την έναρξη της εργάσιμης ημέρας, ενώ πρόσθετα γίνεται χρήση και των μηνυμάτων ISO 20022.

Στο πιο κάτω πίνακα περιγράφονται τα σενάρια δοκιμών και οι χρονισμοί που θα πραγματοποιηθούν κατά την πραγματοποίηση δοκιμών από το Χρηματιστήριο με τη συμμετοχή των:

- Τραπεζών Διακανονισμού.
- Εκκαθαριστικών Μελών.
- Θεματοφυλάκων / Χειριστών.
- Χρηματιστήριο Αξιών Κύπρου.
- Κεντρική Τράπεζα της Κύπρου.

<b>Σενάρια Δοκιμών</b>			
<b>Έναρξη</b>	<b>Λήξη</b>	<b>Ενέργεια από</b>	<b>Ενέργειες</b>
	11:00	Τ.Δ.	<p><b><u>Εισαγωγή εντολών μεταφοράς ρευστότητας πριν την έναρξη κύκλου</u></b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Οι Τ.Δ. θα πρέπει να εισάγουν εντολές μεταφοράς ρευστότητας προς τους υπολογαριασμούς των Εκκαθαριστικών Μελών και των Θεματοφυλάκων που εξυπηρετούν από τους RTGS.</li> <li>• Οι εντολές μπορούν να πραγματοποιηθούν μέσω Liquidity Credit Transfer ή μέσω ESMIG (U2A).</li> </ul>
09:00	12:00	Μέλη και Θεματοφύλακες	<p><b><u>Καταχώριση εντολών OTC συναλλαγών (για same day settlement).</u></b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Τα Μέλη και οι Θεματοφύλακες θα πρέπει να έχουν διαθέσιμες τις ποσότητες ή το χρηματικό ποσό της εντολής για το διακανονισμό αυτής.</li> <li>• Τα Μέλη και οι Θεματοφύλακες θα πρέπει να επικοινωνήσουν με την Τ.Δ. ώστε να πιστωθεί ο χρηματικός λογαριασμός που διατηρεί με το απαιτητό ποσό της εντολής OTC.</li> </ul>
11:00	11:45	ΧΑΚ	<p><b><u>Έναρξη 1<sup>ου</sup> Κύκλου Διακανονισμού</u></b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Λήψη από το ΧΑΚ αρχείου δεσμευμένων υπολοίπων στους υπολογαριασμούς των Μελών και των Θεματοφυλάκων.</li> <li>• Αποστολή αρχείου χρηματικού διακανονισμού και εκτέλεση των σχετικών διακανονισμών από το Target.</li> </ul>

			<ul style="list-style-type: none"> <li>• Λήξη 1<sup>ου</sup> κύκλου διακανονισμού όπου απελευθερώνονται τα υπόλοιπα των υπολογαριασμών.</li> </ul>
11:00	11:45	Τ.Δ	Οι ΤΔ εισάγουν εντολές μεταφοράς ρευστότητας από τον RTGS προς τους υπολογαριασμούς μετά την έναρξη του 1ου κύκλου μέσω Liquidity Credit Transfer ή μέσω ESMIG (U2A).
12:00	12:45	ΧΑΚ	<p><b><u>Έναρξη 2ου Κύκλου Διακανονισμού</u></b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Λήψη από το ΧΑΚ αρχείου δεσμευμένων υπολοίπων στους υπολογαριασμούς των Μελών και των Θεματοφυλάκων.</li> <li>• Αποστολή αρχείου χρηματικού διακανονισμού και εκτέλεση των σχετικών διακανονισμών από το Target.</li> <li>• Λήξη 2<sup>ου</sup> κύκλου διακανονισμού όπου απελευθερώνονται τα υπόλοιπα των υπολογαριασμών.</li> </ul>
13:00	13:00	ΧΑΚ	<p><b><u>Λήξη Διαδικασίας AS Settlement procedure C</u></b></p> <p>Αυτόματη μεταφορά τυχόν υπολοίπων από τους υπολογαριασμούς στον αντίστοιχο RTGS λογαριασμό της ΤΔ.</p>
13:00	14:00	Τ.Δ	<p><b><u>Έλεγχος αποτελεσμάτων</u></b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Ελέγχουν ότι μετά τη λήξη της διαδικασίας δεν υπάρχουν υπόλοιπα στους υπολογαριασμούς</li> <li>• Έλεγχος λήψης των Bank To Customer Debit Credit Notification (camt.054) για την χρέωση / πίστωση στον υπολογαριασμό τους (για οσες Τ.Δ. το έχουν επιλέξει λαμβάνουν).</li> <li>• Συμφωνούν τις κινήσεις των υπολογαριασμών κατά την διάρκεια της μέρας</li> </ul>
13:00	14:00	ΧΑΚ	<p><b><u>Έλεγχος αποτελεσμάτων</u></b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Ελέγχει μέσω ESMIG (U2A) την απεικόνιση των πληρωμών, μηνυμάτων, κλπ. με τα κατάλληλα φίλτρα.</li> <li>• Ελέγχει τα σχετικά μηνύματα που έλαβε από το T2 και συμφωνεί με τις αντίστοιχες κινήσεις διακανονισμού που στάλθηκαν</li> </ul>

Για την πραγματοποίηση των δοκιμών θα πρέπει να συνδεθείτε στο ΣΑΤ μέσα από έναν web browser (Internet Explorer ή Firefox), χρησιμοποιώντας τα παρακάτω URL: <https://dssmock.cse.com.cy/>

Ταυτόχρονα σημειώνουμε ότι τα δεδομένα που υπάρχουν στο περιβάλλον δοκιμών είναι αυτά μέχρι τις **24 Αυγούστου 2020**. Κατά την περίοδο των δοκιμών εάν αντιμετωπίσετε οποιοδήποτε πρόβλημα, θα πρέπει να επικοινωνήσετε με το Χρηματιστήριο μέσω email στην ηλεκτρονική διεύθυνση [target2@cse.com.cy](mailto:target2@cse.com.cy).

**Επισημαίνεται ότι η συμβολή και η ενεργός συμμετοχή όλων των πιο πάνω συντελεστών της Αγοράς στις προγραμματισμένες δοκιμές αποτελεί σημαντικό και κρίσιμο παράγοντα για την ομαλή και επιτυχή μετάβαση στο νέο περιβάλλον T2-T2S Consolidation με έναρξη ισχύος στις 21 Νοεμβρίου 2022.**

Κλείνοντας σημειώνουμε ότι θα σας αποσταλεί ηλεκτρονικό μήνυμα με τις ακριβείς ημερομηνίες δοκιμών (οι οποίες νοείται ότι θα γίνουν μεταξύ 18 – 29 Ιουλίου 2022).

Παραμένουμε στη διάθεση σας για τυχόν διευκρινήσεις και ευχαριστούμε εκ' των προτέρων για τη συνεργασία σας.

Με εκτίμηση

Αγγελική Φράγκου  
Προϊστάμενη Διεύθυνσης Κεντρικού Μητρώου Αποθετηρίου  
(για Αναπληρωτή Γενικό Διευθυντή)

Κοιν.: Επιτροπή Κεφαλαιαγοράς

ΚΣΕΠΕΥ Επιτροπή Εκδοτών με βάση τον Κανονισμό Ε.Ε. 909/2014

Επιτροπή Συμμετεχόντων (Μέλη / Θεματοφύλακες) με βάση τον Κανονισμό

Ε.Ε. 909/2014