

ΑΠΟΦΑΣΗ 11

«Τεχνικές διαδικασίες εκκαθάρισης»

Κωδικοποιημένη μετά τις από 8/11/2010, 18/4/2011, 27/6/2011, 5/3/2012, 18/9/2014, 18/5/2015 και 29/6/2015 αποφάσεις του Διοικητικού Συμβουλίου.

ΤΟ ΔΙΟΙΚΗΤΙΚΟ ΣΥΜΒΟΥΛΙΟ

ΤΗΣ ΕΤΑΙΡΕΙΑΣ ΕΚΚΑΘΑΡΙΣΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ ΧΡΗΜΑΤΙΣΤΗΡΙΟΥ ΑΘΗΝΩΝ ΑΝΩΝΥΜΗ ΕΤΑΙΡΕΙΑ (ΕΤ.Ε.Κ.)

(Συνεδρίαση 48/20.9.2010)

Αφού έλαβε υπόψη τις διατάξεις της § 2.5 της Ενότητας Ι, της § 5.9.4 της Ενότητας ΙΙ σε συνδ. με την § 1.1 (3) β) της Ενότητας ΙV, της παρ. 5.9.1 (2) και (3), της § 5.9.2, της § 5.9.3 και της § 5.8.1 της Ενότητας ΙΙ του Κανονισμού Εκκαθάρισης Συναλλαγών επί Κινητών Αξιών σε Λογιστική Μορφή (εφεξής ο «Κανονισμός»)

ΑΠΟΦΑΣΙΖΕΙ ΩΣ ΕΞΗΣ

ΜΕΡΟΣ 1. Γνωστοποίηση Λογαριασμών Διακανονισμού Αξιών

1.1 Ωράριο γνωστοποίησης

Η γνωστοποίηση Λογαριασμού Διακανονισμού Αξιών διενεργείται από:

- α) τα Εκκαθαριστικά Μέλη, το αργότερο μέχρι την έναρξη του τελευταίου κύκλου διακανονισμού στις 17:00¹.
- β) τους Χειριστές, το αργότερο μέχρι την 16:00 της ημέρας διακανονισμού και στις περιπτώσεις της παραγράφου 3.3, της παρούσης μέχρι την 17:00 της ημέρας διακανονισμού².

1.2 Παράλειψη γνωστοποίησης

Σε περίπτωση μη εμπρόθεσμης κατά τα ανωτέρω γνωστοποίησης από το Εκκαθαριστικό Μέλος ή το Χειριστή επέρχονται οι συνέπειες που προβλέπονται στην § 1.1 (3) β) της Ενότητας IV του Κανονισμού.

ΜΕΡΟΣ 2. Διαδικασία Διάρθρωσης Συναλλαγών και Διόρθωσης Λογαριασμών Εκκαθάρισης³

2.1 Διαδικασία Διάρθρωσης από Μέλη Αγοράς του Χ.Α. και Εκκαθαριστικά Μέλη⁴

1. Τα Μέλη Αγοράς του Χ.Α. μπορούν να έχουν πρόσβαση στο Σύστημα (υποσύστημα διάρθρωσης των συναλλαγών) για την εξυπηρέτηση ενεργειών διάρθρωσης των πράξεων που έχουν αναλάβει Εκκαθαριστικά Μέλη α) με την συμπλήρωση πληροφοριακών στοιχείων σε συναλλαγές που έχουν καταρτίσει στο ΟΑΣΗΣ και β) με την αντικατάσταση ενός συνόλου συναλλαγών με ένα νέο.
2. Τα ενημερωτικά πεδία που μπορεί να καταχωρήσει το Μέλος Αγοράς του Χ.Α. κατά τη διαδικασία της πρότασης διάρθρωσης σε Εκκαθαριστικό Μέλος είναι τα παρακάτω:
 1. Μικτή Αξία Συναλλαγής
 2. Νόμισμα Μικτής Αξίας
 3. Εντολέας Εκκαθαριστικού Μέλους -Θεματοφύλακας
 4. Προτεινόμενος Θεματοφύλακας
 5. Κωδικός Αναφοράς 1
3. Σε περίπτωση αντικατάστασης ενός συνόλου συναλλαγών με ένα νέο, η συνολική ποσότητα και Αξία θα πρέπει να είναι ίσες και τα βασικά στοιχεία των συναλλαγών στο νέο και το παλιό σύνολο θα πρέπει να είναι τα ίδια. Συγκεκριμένα θα πρέπει να είναι τα ίδια τα εξής πεδία:
 1. Ημερομηνία συναλλαγής
 2. Ημερομηνία εκκαθάρισης
 3. Είδος συναλλαγής (αγορά ή πώληση)
 4. Μέλος Διαπραγμάτευσης
 5. Εκκαθαριστικό Μέλος
 6. Θεματοφύλακας
 7. ISIN Χρεογράφου

8. Τύπος Συναλλαγής
 9. Αν έχει σημειωθεί ως ανοιχτή αγορά ή πώληση
 10. Αν αφορά ομάδα (group) επενδυτών
 11. Αγορά Διαπραγμάτευσης
 12. Κωδικός ΣΔΧ
 13. Νόμισμα Συναλλαγής
 14. Λογαριασμός Εκκαθάρισης
 15. Υπολογαριασμός Εκκαθάρισης
4. Το Εκκαθαριστικό Μέλος έχει το δικαίωμα ορισμού των πράξεων που έχει υπό τον χειρισμό του σε κατάσταση εκκαθάρισης με την οποία δεν μπορούν να τροποποιηθούν οι πράξεις προς εκκαθάριση από τα Μέλη Αγοράς του Χ.Α.
 5. Η συνένωση πράξης αγοράς ή πώλησης σε προσυμφωνημένη συναλλαγή – πακέτο δεν επιτρέπεται.
 6. Δεν επιτρέπεται η διάρθρωση όταν αυτή συνεπάγεται μεταφορά συναλλαγής μεταξύ Κωδικών Διαπραγμάτευσης, Ειδικού Διαπραγματευτή ανεξαρτήτου κατηγορίας, ή μεταφορά συναλλαγής από κωδικό Ειδικού Διαπραγματευτή σε Κωδικό διαπραγμάτευσης Επενδυτή ή Διαχειριστή ή Διαμεσολαβητή και αντίστροφα.⁵
 7. Η διαδικασία της πρότασης διάρθρωσης από Μέλος Αγοράς του Χ.Α. είναι ενεργή προς αποδοχή της από το Εκκαθαριστικό Μέλος, στο οποίο απευθύνεται, από τη λήξη της συνεδρίασης της ημέρας Τ έως και την Τ+1 στις 16:00.

2.2 Διαδικασία Διόρθωσης Λογαριασμών Εκκαθάρισης από Μέλη Αγοράς του Χ.Α.

1. Τα Μέλη Αγοράς του Χ.Α. δικαιούνται να προβαίνουν στη διόρθωση Κωδικού Λογαριασμού Εκκαθάρισης ή Υπολογαριασμού Εκκαθάρισης σύμφωνα με τα προβλεπόμενα στο άρθρο 6.3 του Κανονισμού και κατά τους παρακάτω ειδικότερους όρους:

α) Το Μέλος Αγοράς του Χ.Α. προβαίνει σε δήλωση διόρθωσης το αργότερο εντός προθεσμίας τριάντα λεπτών (30΄) από τη γνωστοποίηση των στοιχείων συναλλαγών του άρθρου 6.2 της Ενότητας II του Κανονισμού.

β) Η διόρθωση θα πρέπει να αφορά συναλλαγές που έχουν διενεργηθεί κατά την ίδια ημέρα.

γ) Η διόρθωση μπορεί να συνεπάγεται και αλλαγή του Εκκαθαριστικού Μέλους.⁶

2. Η δήλωση διόρθωσης γίνεται αποδεκτή εφόσον:

α) υφίσταται ενεργή συσχέτιση του Μέλους Αγοράς του Χ.Α. με το Εκκαθαριστικό Μέλος που θα αναλάβει τη συναλλαγή συνεπεία της διόρθωσης

β) έκαστο εκ των συμμετεχόντων στη διόρθωση Εκκαθαριστικό Μέλος έχει διαθέσει Πιστωτικό Όριο στο Μέλος Αγοράς ισόποσο με το Πιστωτικό Όριο που έχει καταναλωθεί για την κατάρτιση της σχετικής συναλλαγής.

Δεν επιτρέπεται η διόρθωση Κωδικού Λογαριασμού Εκκαθάρισης ή Υπολογαριασμού Εκκαθάρισης ή και Εκκαθαριστικού Μέλους σε προσυμφωνημένη συναλλαγή – πακέτο εφόσον η συναλλαγή έχει προκύψει από διάρθρωση.⁷

ΜΕΡΟΣ 3. Μετάθεση διακανονισμού

3.1 Ωράριο μετάθεσης

Η μετάθεση πράξης για το διακανονισμό της διενεργείται το αργότερο έως την 16:00 της T+2, αν ο διακανονισμός της πράξης γίνεται την T+2, Στην περίπτωση της παρ. 3.3. της παρούσης το Εκκαθαριστικό Μέλος δικαιούται να προβεί σε νέα μετάθεση της πράξης μεταξύ 16:00 και 17:00 της ημέρας διακανονισμού.⁸

3.2 Μετάθεση

Πέραν των όρων που προβλέπονται στην παρ. 5.9.3. της Ενότητας II του Κανονισμού, για τη μετάθεση αγοράς ή πώλησης απαιτείται επιπλέον να έχει προηγηθεί κοινή δήλωση του Χειριστή και του Εκκαθαριστικού Μέλους προς την ΕΤ.ΕΚ ότι ο μεν Χειριστής αποδέχεται μεταθέσεις από το συγκεκριμένο Εκκαθαριστικό Μέλος, το δε Εκκαθαριστικό Μέλος ότι επιθυμεί να μεταθέτει στον συγκεκριμένο Χειριστή (Τυποποιημένο κείμενο του Παραρτήματος Α της παρούσας).

3.3 Ανάκληση – Εκ νέου μετάθεση⁹

1. Εντός του ωραρίου της παρ. 3.1 της παρούσας το Εκκαθαριστικό Μέλος δικαιούται να ανακαλέσει τη μετάθεση της πράξης και να μεταθέσει εκ νέου την πράξη στον ίδιο ή σε διαφορετικό Χειριστή μέχρι την 16:00 της ημέρας διακανονισμού στις περιπτώσεις που ο Χειριστής:

α) είτε δεν έχει διαθέσει στο διακανονισμό τις οφειλόμενες αξίες ολικά σύμφωνα με την παρ. 5.9.3 (4) β) της Ενότητας II του Κανονισμού σε περίπτωση πώλησης,

β) είτε δεν έχει προβεί σε γνωστοποίηση Λογαριασμού Διακανονισμού Αξιών της πράξης στην οποία αφορά η μετάθεση σύμφωνα με την παρ. 5.9.3 (4) β) της Ενότητας II του Κανονισμού σε περίπτωση αγοράς,

2. Στις 16:00 της ημέρας διακανονισμού η ΕΤ.ΕΚ προβαίνει σε επιστροφή από τους Χειριστές στα Εκκαθαριστικά Μέλη των μετατεθεισών συναλλαγών για τις οποίες, είτε, κατά τα ανωτέρω υπό 1α) δεν έχουν διατεθεί από το Χειριστή στο διακανονισμό οι οφειλόμενες αξίες ολικά, είτε, κατά τα ανωτέρω υπό 1β) δεν έχει γνωστοποιηθεί από το Χειριστή Λογαριασμός Διακανονισμού Αξιών
3. Μετά την επιστροφή αυτή το Εκκαθαριστικό Μέλος δύναται να μεταθέσει εκ νέου την πράξη στον ίδιο ή σε διαφορετικό Χειριστή μεταξύ 16:00 και 17:00 της ημέρας διακανονισμού¹⁰.
4. Η γνωστοποίηση Λογαριασμού Διακανονισμού από το Χειριστή θεωρείται ως αποδοχή της μετάθεσης. Με την αποδοχή της μετάθεσης αγοράς ή πώλησης, το Εκκαθαριστικό Μέλος υποκαθίσταται από το Χειριστή στο σύνολο των απαιτήσεων και υποχρεώσεων του ως προς το διακανονισμό.

ΜΕΡΟΣ 4. Διάσπαση και συνένωση πράξεων

4.1 Ωράριο διάσπασης

Η διάσπαση και συνένωση πράξης διενεργείται το αργότερο έως την 17:00 της T+2, αν ο διακανονισμός της πράξης γίνεται την T+2,¹¹.

4.2 Ανάκληση – Εκ νέου διάσπαση ή συνένωση

Εντός του ωραρίου της παρ. 4.1 της παρούσας και με την προϋπόθεση ότι ο Χειριστής δεν έχει διαθέσει στο διακανονισμό τις οφειλόμενες αξίες, το Εκκαθαριστικό Μέλος δικαιούται να ανακαλέσει τη διάσπαση ή και συνένωση της πράξης και να προβεί σε νέα εντός του ως άνω ωραρίου.

4.3 Τεχνικά πεδία δηλώσεων διάσπασης και συνένωσης πράξεων

Η διάσπαση ή συνένωση διενεργείται με βάση τα παρακάτω πεδία, τα οποία πρέπει να είναι ίδια:

1. Ημερομηνία συναλλαγής
2. Ημερομηνία εκκαθάρισης
3. Είδος συναλλαγής (αγοράς ή πώλησης)

4. Μέλος Αγοράς του Χ.Α.
5. Εκκαθαριστικό Μέλος
6. Χειριστής
7. Κινητή αξία (ISIN)
8. Τύπος συναλλαγής (απλή/ πακέτο)
9. Ένδειξη ανοιχτής αγοράς / πώλησης, εφόσον επιτρέπεται από τις κείμενες διατάξεις
10. Ένδειξη αν πρόκειται για πράξη που προήλθε από εντολή που δόθηκε για λογαριασμό Ομάδας επενδυτών (basket order)
11. Αγορά Διαπραγμάτευσης
12. Κωδικός ΣΔΧ
13. Νόμισμα συναλλαγής
14. Λογαριασμός Εκκαθάρισης
15. Υπολογαριασμός Εκκαθάρισης.

ΜΕΡΟΣ 5. Πιστωτικά Όρια

5.1 Ενημέρωση ΟΑΣΗΣ για στοιχεία Λογαριασμών Εκκαθάρισης μέσω του Συστήματος

Προκειμένου για την καταχώριση και παρακολούθηση μέσω του ΟΑΣΗΣ των Πιστωτικών Ορίων των Εκκαθαριστικών Μελών και των Μελών Αγοράς του Χ.Α. ως προς κάθε ημέρα συνεδρίασης, η ΕΤ.ΕΚ. διαβιβάζει μέσω του Συστήματος στο ΟΑΣΗΣ του Χ.Α. μετά τις 20:00 της προηγούμενης αυτής εργάσιμης ημέρας (εκκαθάρισης) κάθε τεχνικό στοιχείο προσδιοριστικό των Λογαριασμών και Υπολογαριασμών Εκκαθάρισης και των Εκκαθαριστικών Μελών και των Μελών Αγοράς του Χ.Α. των σχετικών Λογαριασμών και Υπολογαριασμών αντίστοιχα, όπως αυτά έχουν προσδιοριστεί μέχρι την λήξη της συνεδρίασης του ΧΑ. Τα Πιστωτικά Όρια δηλώνονται μέσω του Συστήματος σύμφωνα με τα προβλεπόμενα στην επόμενη παράγραφο στο ΟΑΣΗΣ με ευθύνη των Εκκαθαριστικών Μελών.

5.2 Δήλωση-κατανομή Πιστωτικών Ορίων

1. Η δήλωση και κατανομή σε Υπολογαριασμούς Εκκαθάρισης διενεργείται από κάθε Εκκαθαριστικό Μέλος το αργότερο μέχρι τις 20:00 της προηγούμενης ημέρας κάθε ημέρας συνεδρίασης. Για τη σχετική κατανομή το Εκκαθαριστικό Μέλος μπορεί εναλλακτικά είτε να χρησιμοποιεί πάγιες εντολές

ποσοστιαίου επιμερισμού του συνολικού διαθέσιμου Πιστωτικού Ορίου του σχετικού Λογαριασμού Εκκαθάρισης αυτού ανά Υπολογαριασμό Εκκαθάρισης και Μέλος Αγοράς του Χ.Α. είτε να το επιμερίζει ανά Υπολογαριασμό Εκκαθάρισης και Μέλος Αγοράς του Χ.Α. βάσει εντολών που καθορίζει κατά περίπτωση ως προς το μέγεθος του σχετικού επιμερισμού.

2. Το Εκκαθαριστικό Μέλος δύναται να μεταβάλλει τα ποσοστά κατανομής σύμφωνα με τα προβλεπόμενα στην παρ. 5.8.1 (4) δ) της Ενότητας II του Κανονισμού.
3. Σε κάθε περίπτωση, μετά την κατανομή και μεταβολή σύμφωνα με τις προηγούμενες υποπαραγράφους του Πιστωτικού Ορίου βάσει των δηλώσεων των Εκκαθαριστικών Μελών διενεργείται μέσω του Συστήματος αυτόματη καταχώριση των Πιστωτικών Ορίων ανά Υπολογαριασμό Εκκαθάρισης και Μέλος Αγοράς του Χ.Α. στο ΟΑΣΗΣ. Η ΕΤ.ΕΚ. ευθύνεται μόνο για την ορθή καταχώριση των σχετικών Ορίων.

ΜΕΡΟΣ 6. Ειδικές οδηγίες εντολών διακανονισμού

Οι τεχνικές και διαδικαστικές λεπτομέρειες εφαρμογής, σχετικά με τις ειδικές οδηγίες διακανονισμού (stock EX), προσδιορίζονται ως εξής:¹²

Ημέρες λειτουργίας	Οι ημέρες λειτουργίας του Σ.Α.Τ. σύμφωνα με το ημερολόγιο συναλλαγών του Χ.Α. http://www.athex.gr/content/gr/ann.asp?AnnID=55000B (ΗΜΕΡΟΛΟΓΙΟ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ)
Ωράριο λειτουργίας	09:00 – 20:00 (τοπική ώρα) 08:00 – 19:00 (Central European Time-CET)
Εισαγωγή Εντολών Διακανονισμού	
Εισαγωγή εντολών από Χειριστές	09:00 – 20:00 08:00 – 19:00 (CET)
Εισαγωγή εντολών με ημερομηνία διακανονισμού την ίδια ημέρα (SD) έως:	SD 16:45 (τοπική ώρα) SD 15:45 (CET) ¹³
Μέγιστη διαφορά Ημερομηνίας Εισαγωγής (HE) με Ημερομηνία Συναλλαγής (ΗΣ)	2 εργάσιμες ημέρες (HE – ΗΣ <=2)
Μέγιστη διαφορά Ημερομηνίας Διακανονισμού (ΗΔ) με Ημερομηνία Εισαγωγής (HE)	2 εργάσιμες ημέρες (ΗΔ – HE <=2)

Διαφορά Ημερομηνίας Διακανονισμού (ΗΔ) με Ημερομηνία Συναλλαγής (ΗΣ)	2 εργάσιμες ημέρες (ΗΔ - ΗΣ= 2)
	0 έως 1 εργάσιμες ημέρες σε περίπτωση που η ειδική εντολή διακανονισμού αφορά το διακανονισμό προσυμφωνημένης χρηματιστηριακής συναλλαγής που διακανονίσθηκε νωρίτερα από T+2 για μετοχές ή ομόλογα
Ταύτιση εντολών	
Κύκλοι Ταύτισης εντολών διακανονισμού	09:00 – 19:30 (τοπική ώρα) 08:00 – 18:30 (CET) Κύκλοι Ταύτισης εκτελούνται ανά 15 λεπτά
Ποσό ανοχής κατά την ταύτιση	0,00€
Διακανονισμός	
Κύκλοι Διακανονισμού	09:30 – 17:15 (τοπική ώρα) 08:30 – 16:15 (CET) Κύκλοι Διακανονισμού εκτελούνται σε συνεχή βάση. Η αρμόδια υπηρεσία της ΕΤΕΚ δύναται να διενεργεί και έκτακτους κύκλους, διακανονισμού εκτός του άνω ωραρίου
Μέγιστος αριθμός ημερών μεταφοράς προς διακανονισμό σε επόμενη ημέρα	0 εργάσιμες ημέρες

Η ταύτιση εντολών διακανονισμού διενεργείται εφόσον έχουν πληρωθεί τα κριτήρια ταύτισης συμφωνά με προβλεπόμενα στην παρ. 6.5 της Ενότητας III του Κανονισμού και με την προϋπόθεση ότι στο ένα σκέλος της εντολής διακανονισμού πρέπει ο Λογαριασμός Αξιών να αντιστοιχεί σε Λογαριασμό Διαμεσολαβητή.

Το πεδίο «αιτία κίνησης» συμπληρώνεται με τον όρο «Συναλλαγή» και, εάν πρόκειται για παράδοση αξιών στην εκκαθάριση από την Μερίδα Επενδυτή του Διαμεσολαβητή στον αντίστοιχο Λογαριασμό Διαμεσολαβητή για την τεχνική διευκόλυνση της εκκαθάρισης, θα χρησιμοποιείται ο όρος: «Τεχνική Κίνηση Εκκαθάρισης».¹⁴

ΜΕΡΟΣ 7. Πίνακες ωραρίου τεχνικών διαδικασιών εκκαθάρισης

7.1 Τεχνικές διαδικασίες για εκκαθάριση κινητών αξιών

Ημέρα Συναλλαγής T	Πρώτη ημέρα T+1	Ημ. Διακανονισμού T+2 ¹⁵
Ενημέρωση από το ΧΑ ηλεκτρονικά με το αρχείο συναλλαγών	Μετάθεση πράξεων από Εκκαθαριστικό Μέλος σε Χειριστή / Θεματοφύλακα για διακανονισμό	Γνωστοποίηση από τους Χειριστές του Λογαριασμού Αξιών του επενδυτή και σύνδεσή του με συγκεκριμένη πράξη συναλλαγής στο ΧΑ
Εισαγωγή του αρχείου στο ΣΑΤ	Γνωστοποίηση από τους Χειριστές του Λογαριασμού Αξιών του επενδυτή και σύνδεσή του με συγκεκριμένη πράξη συναλλαγής στο ΧΑ	Εκτέλεση πολλαπλών κύκλων διακανονισμού- Διακανονισμός πράξεων- Χρηματικός διακανονισμός
Σύμπτυξη και οριστικοποίηση συναλλαγών προς εκκαθάριση		
Υπολογισμός Κινδύνου και απαιτήσεων ασφαλειών		
Δυνατότητα πρότασης για διάρθρωση του αρχείου συναλλαγών προς τα Εκκαθαριστικά Μέλη από Μέλη Διαπραγμάτευσης	Λήξη δυνατότητας πρότασης για διάρθρωση του αρχείου συναλλαγών προς τα Εκκαθαριστικά Μέλη από Μέλη Διαπραγμάτευσης στις 16:00	
Μετάθεση πράξεων από Εκκαθαριστικό Μέλος σε Χειριστή για διακανονισμό	Συνέχεια μετάθεσης πράξεων από Εκκαθαριστικό Μέλος σε Χειριστή για διακανονισμό έως τις 20:00	Συνέχεια μετάθεσης πράξεων από Εκκαθαριστικό Μέλος σε Χειριστή για διακανονισμό έως τις 16:00. Επιστροφή μετατεθεισών συναλλαγών από Χειριστές σε Εκκαθαριστικά Μέλη στις 16:00.
		Δυνατότητα εκ νέου μετάθεσης από Εκκαθαριστικό Μέλος σε Χειριστή για διακανονισμό από 16:00 έως τις 17:00. Επιστροφή μετατεθεισών συναλλαγών από Χειριστές σε Εκκαθαριστικά Μέλη στις 17:00. ¹⁶

Ημέρα Συναλλαγής T	Πρώτη ημέρα T+1	Ημ. Διακανονισμού T+2 ¹⁵
Διάσπαση και συνένωση πράξεων από Εκκαθαριστικό Μέλος	Συνέχεια διάσπασης και συνένωσης πράξεων από Εκκαθαριστικό Μέλος	Συνέχεια διάσπασης και συνένωσης πράξεων από Εκκαθαριστικό Μέλος έως τις 17:00. ¹⁷
Γνωστοποίηση από τους Χειριστές του Λογαριασμού Αξιών του επενδυτή και σύνδεσή του με συγκεκριμένη πράξη συναλλαγής στο ΧΑ		Τελευταίος κύκλος διακανονισμού 17:00 και δύναται να παραταθεί σε περίπτωση πακέτου διακανονισμού (spot1) ή stra. ¹⁸
Καταχώριση Ειδικών εντολών Διακανονισμού σε Λογαριασμό Εκκαθάρισης Διαμεσολαβητή		Καταχώριση Ειδικών εντολών Διακανονισμού σε Λογαριασμό Εκκαθάρισης Διαμεσολαβητή έως στις 16:45 αν η ημερομηνία διακανονισμού είναι για την ίδια ημέρα (SD). Τελευταίος κύκλος διακανονισμού 17:15. ¹⁹
		Μεταφορά ποσοτήτων από τη μερίδα του Διαμεσολαβητή στη συνδεδεμένη κύρια μερίδα επενδυτή του Διαμεσολαβητή διενεργείται μετά τη λήξη του διακανονισμού. ²⁰

7.2 Τεχνικές διαδικασίες για εκκαθάριση/διακανονισμό προσυμφωνημένης συναλλαγής – πακέτου²¹

Σε περίπτωση προσυμφωνημένης συναλλαγής – πακέτου που προβλέπεται στην παρ. 5.1.1. α) του Μέρους 5 της Ενότητας ΙΙΙ του Κανονισμού ο διακανονισμός δύναται να διενεργείται T+0 ή T+1 . Σε ό,τι αφορά αυθημερόν διακανονισμό (T+0) το Μέλος του ΧΑ, κατά την εισαγωγή της συναλλαγής στο ΟΑΣΗΣ, οφείλει να εισάγει ειδική σήμανση. Διακανονισμός T+1 θα διενεργείται κατόπιν σχετικού αιτήματος των εμπλεκομένων Εκκαθαριστικών Μελών ή και Χειριστή του Σ.Α.Τ. που θα υποβάλλεται σύμφωνα με το Παράρτημα Β της παρούσας.

Η διαδικασία διάρθρωσης εκκαθάρισης διενεργείται από τα Εκκαθαριστικά Μέλη έως τις 17:00 της εκάστοτε ημέρας διακανονισμού, όπως αυτή έχει οριστεί κατά τα ανωτέρω, η δε αρμόδια υπηρεσία της ΕΤ.ΕΚ. δύναται να διενεργεί και έκτακτους κύκλους διακανονισμού εκτός του άνω ωραρίου.

ΜΕΡΟΣ 8. Λοιπά θέματα

8.1 Συναλλαγή κάλυψης υποχρεώσεων παράδοσης από υπερήμερο Εκκαθαριστικό Μέλος

Συναλλαγές κάλυψης γίνονται δεκτές από την ΕΤ.ΕΚ. μέχρι τη λήξη του ωραρίου διενέργειας πακέτων διακανονισμού, ως ορίζονται στον Κανονισμό Χ.Α. και τις Αποφάσεις του Χ.Α.

8.2 Εκτέλεση Πράξεων Διαμεσολαβητή

1. Ο Λογαριασμός Διαμεσολαβητή συνδέεται με μία και μόνον Μερίδα Επενδυτή, η οποία είναι υποχρεωτικώς η Μερίδα Επενδυτή του Διαμεσολαβητή στο Σ.Α.Τ.
2. Δίνεται η δυνατότητα καταχώρισης εντολών διακανονισμού παράδοσης ή παραλαβής αξιών καθ όλη την διάρκεια του ενεργού κύκλου μιας συναλλαγής μέχρι 16:45.²²
3. Είναι δυνατή η διαδοχική μεσολάβηση περισσότερων του ενός Λογαριασμών Διαμεσολαβητή για το διακανονισμό πράξεων που εκτελέστηκαν επ' ονόματι του με την καταχώριση των σχετικών εντολών διακανονισμού με την προϋπόθεση ότι υποχρεωτικά για το ένα σκέλος της εντολής αντισυμβαλλόμενος είναι Λογαριασμός Διαμεσολαβητή.
4. Μεταφορές από την ΕΤ.ΕΚ. υπολοίπων του Λογαριασμού Διαμεσολαβητή στη συνδεδεμένη Μερίδα Επενδυτή του Διαμεσολαβητή στο Σ.Α.Τ. διενεργούνται μετά το πέρας των διαδικασιών διακανονισμού της ημέρας διακανονισμού μετά τις 17:45.²³
5. Ανάλυση στη συνδεδεμένη Μερίδα Επενδυτή του Διαμεσολαβητή στο Σ.Α.Τ. επιτρέπεται μόνο αν υπάρχει ενεργή συσχέτιση του κωδικού ΟΑΣΗΣ του Διαμεσολαβητή στο Μέλος Χ.Α. με τον κωδικό Λογαριασμού Διαμεσολαβητή.
6. Σε περίπτωση που η προς διακανονισμό πράξη είναι πώληση, γνωστοποίηση Λογαριασμού Διαμεσολαβητή για το διακανονισμό της επιτρέπεται μόνο την ημέρα διακανονισμού της σχετικής πράξης.

8.3 Ασφάλειες με τη μορφή Κινητών Αξιών

Για τη λήψη από την ΕΤ.ΕΚ. ασφάλειας σύμφωνα με το άρθρο 4.5 της Ενότητας II του Κανονισμού, το Εκκαθαριστικό Μέλος δηλώνει μέσω του Συστήματος την κατανομή της ασφάλειας ανά Λογαριασμό Εκκαθάρισης. Η ΕΤ.ΕΚ. αποτιμά, μετά την οριστικοποίηση των θέσεων ανά Λογαριασμό Εκκαθάρισης Εκκαθαριστικού Μέλους, τις ασφάλειες με τη μορφή Κινητών Αξιών που έχουν παρασχεθεί υπέρ αυτής για κάθε Λογαριασμό Εκκαθάρισης από τις 9:00 έως 18:00.

Εάν προκύψει απαίτηση Περιθωρίου ασφάλισης της ΕΤ.ΕΚ σε σχέση με Λογαριασμό Εκκαθάρισης Εκκαθαριστικού Μέλους, μετά την οριστικοποίηση των θέσεων Λογαριασμού Εκκαθάρισης, το

Εκκαθαριστικό Μέλος υποχρεούται να προβεί στην κάλυψή της με καταβολή μετρητών εντός προθεσμίας πριν από την έναρξη της επόμενης συνεδρίασης της Αγοράς.

Για την αποδέσμευση από την ΕΤ.ΕΚ ασφάλειας με τη μορφή Κινητών Αξιών σύμφωνα με το άρθρο 4.5 παρ. 5 της Ενότητας II του Κανονισμού, απαιτείται έγγραφη δήλωση του Εκκαθαριστικού Μέλους διαβιβαζόμενη με φάξ προς την ΕΤ.ΕΚ. σύμφωνα με το Έντυπο «Αίτηση Αποδέσμευσης ασφαλειών επί Κινητών Αξιών στην Αγορά Αξιών», που τυποποιείται από την ΕΤ.ΕΚ. και ανακοινώνεται στο διαδικτυακό της τόπο. Η επιστροφή της ασφάλειας διενεργείται κατά την ημέρα της δήλωσης και έως τις 17:15, εκτός εάν οι αρμόδιες υπηρεσίες της ΕΤ.ΕΚ κρίνουν αναγκαία την επιστροφή των Κινητών Αξιών μετά τον οριζόμενο χρονισμό για λόγους κάλυψης υποχρεώσεων σχετιζόμενες με το Σύστημα²⁴.

Παράρτημα Α²⁵

ΠΡΟΣ ΤΗΝ

Εταιρεία Εκκαθάρισης Συναλλαγών Χρηματιστηρίου Αθηνών Α.Ε. (ΕΤ.ΕΚ.)

(Σύστημα Αξιών)

Η ανώνυμη εταιρεία, με την επωνυμία....., που εκπροσωπείται νόμιμα από τον είναι Εκκαθαριστικό Μέλος της ΕΤ.ΕΚ (καλούμενη εφεξής το «Μέλος») και έχει κωδικό Χειριστή στο ΣΑΤ δηλώνει ρητά προς την ανώνυμη εταιρεία, με την επωνυμία που εκπροσωπείται νόμιμα από τον είναι Χειριστής (θεματοφύλακας) στο Σ.Α.Τ. (καλούμενη εφεξής ο «Χειριστής») και έχει κωδικό Χειριστή στο Σ.Α.Τ., και ο Χειριστής αποδέχεται, ότι το Εκκαθαριστικό Μέλος θα προβαίνει σε μεταθέσεις διακανονισμού προς το Χειριστή σύμφωνα με τα προβλεπόμενα στον Κανονισμό Εκκαθάρισης Συναλλαγών επί Κινητών Αξιών σε Λογιστική Μορφή και τις Αποφάσεις του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ που εκδίδονται σε εφαρμογή του, ως και τον Κανονισμό του Χρηματιστηρίου Αθηνών.

ΓΙΑ ΤΟ ΕΚΚΑΘΑΡΙΣΤΙΚΟ ΜΕΛΟΣ

ΓΙΑ ΤΟ ΧΕΙΡΙΣΤΗ

Παράρτημα Β²⁶

Αριθμός Εντύπου 17-007

ΑΙΤΗΣΗ ΓΙΑ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟ ΠΑΚΕΤΟΥ T+1

Προς: Εταιρεία Εκκαθάρισης Συναλλαγών Χρηματιστηρίου Αθηνών Α.Ε. (ΕΤ.ΕΚ)
 Λ. Αθηνών 110, Τ.Κ 104 42 Αθήνα
 Τμήμα Εκκαθάρισης Αξιών και Παραγώγων
Τηλ: +30 210 3366766 & 3366620
Fax: +30 210 3366237
e-mail: Clearing&SettlementDpt@helex.gr

Ημερομηνία: _____**Γενικές Πληροφορίες**

Επωνυμία Εκκαθαριστικού Μέλους/ Χειριστή
Κωδικός Χειριστή
Στοιχεία Επικοινωνίας

Σύμφωνα με την Απόφαση 11 του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ «Τεχνικές Διαδικασίες Εκκαθάρισης», παρακαλούμε όπως προβείτε στον διακανονισμό του παρακάτω πακέτου στις (ημερομηνία διακανονισμού) T+1 που πραγματοποιήθηκε κατά τη συνεδρίαση της (ημερομηνία) μέσω του Μέλους ΧΑ .

A/A	ΕΠΩΝΥΜΙΑ ΕΚΚΑΘΑΡΙΣΤΙΚΟΥ ΜΕΛΟΥΣ	ΧΡΕΩΓΡΑΦΟ	ΠΟΣΟΤΗΤΑ	ΑΓΟΡΑ / ΠΩΛΗΣΗ	ΧΕΙΡΙΣΤΗ
1
2
3
4
5
6
7
8
9
10

Ονοματεπώνυμο Νόμιμου Εκπροσώπου – Υπογραφή – Σφραγίδα Εταιρείας

-
- ¹ Το στοιχείο α) της παρ. 1.1 αντικαταστάθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 70/5.3.2012 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ.
- ² Το στοιχείο β) της παρ. 1.1 αντικαταστάθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 70/5.3.2012 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ.
- ³ Η επικεφαλίδα του Μέρους 2 αντικαταστάθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 120/29.6.2015 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ.
- ⁴ Η παρ. 2.1 του Μέρους 2 τροποποιήθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 120/29.6.2015 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ.
- ⁵ Η παρ. 6 αντικαταστάθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 120/29.6.2015 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ.
- ⁶ Η παρ. 2.2. προστέθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 120/29.6.2015 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ.
- ⁷ Η τελευταία παράγραφος προστέθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 120/29.6.2015 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ.
- ⁸ Η παρ. 3.1 αντικαταστάθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 105/18.9.2014 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ. και εφαρμόζεται για την εκκαθάριση των συναλλαγών που θα πραγματοποιηθούν από την ημερομηνία της 6.10.2014 και εφεξής.
- ⁹ Η παρ. 3.3 αντικαταστάθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 51/8.11.2010 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ. και εφαρμόζεται από 1.10.2010
- ¹⁰ Η υποπαρ.3 της παρ. 3.3 αντικαταστάθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 70/5.3.2012 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ.
- ¹¹ Η παρ. 4.1. αντικαταστάθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 105/18.9.2014 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ. και εφαρμόζεται για την εκκαθάριση των συναλλαγών που θα πραγματοποιηθούν από την ημερομηνία της 6.10.2014 και εφεξής.
- ¹² Ο Πίνακας των τεχνικών και διαδικαστικών λεπτομερειών εφαρμογής, σχετικά με τις ειδικές οδηγίες διακανονισμού (stock EX), του Μέρους 6 της απόφασης αντικαταστάθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 105/18.9.2014 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ. και εφαρμόζεται για την εκκαθάριση των συναλλαγών που θα πραγματοποιηθούν από την ημερομηνία της 6.10.2014 και εφεξής.
- ¹³ Το πεδίο αντικαταστάθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 70/5.3.2012 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ.
- ¹⁴ Η τελευταία παράγραφος του Μέρους 6 προστέθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 56/18.4.2011 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ.
- ¹⁵ Στην επικεφαλίδα της τρίτης στήλης του Πίνακα με τις Τεχνικές διαδικασίες για εκκαθάριση κινητών αξιών της παρ. 7.1 του Μέρους 7 της απόφασης ο όρος «Τ+3» αντικαταστάθηκε με τον όρο «Τ+2» με την υπ' αριθμ. 105/18.9.2014 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ. και εφαρμόζεται για την εκκαθάριση των συναλλαγών που θα πραγματοποιηθούν από την ημερομηνία της 6.10.2014 και εφεξής.
- ¹⁶ Το πεδίο αντικαταστάθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 70/5.3.2012 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ.
- ¹⁷ Το πεδίο αντικαταστάθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 70/5.3.2012 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ.
- ¹⁸ Το πεδίο αντικαταστάθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 70/5.3.2012 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ.
- ¹⁹ Το πεδίο αντικαταστάθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 70/5.3.2012 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ.
- ²⁰ Το πεδίο αντικαταστάθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 51/8.11.2010 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ. και εφαρμόζεται από 1.10.2010
- ²¹ Η προηγούμενη παρ. 7.2. του Μέρους 7 της απόφασης καταργήθηκε και η υφιστάμενη παρ. 7.3. αναριθμήθηκε σε 7.2. και αντικαταστάθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 105/18.9.2014 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ. και εφαρμόζεται για την εκκαθάριση των συναλλαγών που θα πραγματοποιηθούν από την ημερομηνία της 6.10.2014 και εφεξής.
- ²² Η υποπαρ.2 της παρ. 8.2. αντικαταστάθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 70/5.3.2012 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ.
- ²³ Η υποπαρ.4 της παρ. 8.2. αντικαταστάθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 70/5.3.2012 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ.
- ²⁴ Το άρθρο 8.3 προστέθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 117/18.5.2015 απόφαση του Δ.Σ. και ισχύει από 2.6.2015

-
- ²⁵ Το Παράρτημα Α αντικαταστάθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 51/8.11.2010 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ. και εφαρμόζεται από 1.10.2010
- ²⁶ Το έντυπο/αίτηση του Παραρτήματος Β' της απόφασης αντικαταστάθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 105/18.9.2014 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ. και εφαρμόζεται για την εκκαθάριση των συναλλαγών που θα πραγματοποιηθούν από την ημερομηνία της 6.10.2014 και εφεξής.