



ΕΛΛΗΝΙΚΗ ΔΗΜΟΚΡΑΤΙΑ
ΕΠΙΤΡΟΠΗ ΚΕΦΑΛΑΙΑΓΟΡΑΣ
Ν.Π.Δ.Δ.

ΑΝΑΡΤΗΤΕΑ ΣΤΟ ΔΙΑΔΙΚΤΥΟ

ΑΠΟΦΑΣΗ
17/766/6.10.2016
του Διοικητικού Συμβουλίου

Θέμα: Έγκριση τροποποίησης του Κανονισμού του Χρηματιστηρίου Αθηνών Α.Ε.

**ΤΟ ΔΙΟΙΚΗΤΙΚΟ ΣΥΜΒΟΥΛΙΟ
ΤΗΣ ΕΠΙΤΡΟΠΗΣ ΚΕΦΑΛΑΙΑΓΟΡΑΣ**

Έχοντας υπόψη:

1. Την παρ. 2 του άρθρου 43 του ν. 3606/2007 (ΦΕΚ Α/195/17.8.2007) «Αγορές χρηματοπιστωτικών μέσων και άλλες διατάξεις».
2. Την παράγραφο 2 του άρθρου 13 του ν. 2166/1993 (ΦΕΚ Α' 137), όπως τροποποιήθηκε με την παρ. 3 του άρθρου 18 του ν. 2198/1994 (ΦΕΚ Α' 43) και αντικαταστάθηκε από την παρ. 6 του άρθρου 39 του ν. 2324/1995 (ΦΕΚ Α' 146).
3. Το άρθρο 90 του π.δ. 63/2005 (ΦΕΚ Α/98/22.4.2005) «Κωδικοποίηση της νομοθεσίας για την Κυβέρνηση και τα κυβερνητικά όργανα».
4. Την επιστολή, με αρ. πρωτ. ΕΚ 9334/11.8.2016, του Χρηματιστηρίου Αθηνών Α.Ε. με την οποία κοινοποιήθηκε στην Επιτροπή Κεφαλαιαγοράς το υπ. αριθμ. 109/14.7.2016 πρακτικό της συνεδρίασης της Διοικούσας Επιτροπής Χρηματιστηριακών Αγορών.
5. Την από 5.10.2016 εισήγηση της Διεύθυνσης Φορέων της Επιτροπής Κεφαλαιαγοράς.

ΑΠΟΦΑΣΙΖΕΙ ΟΜΟΦΩΝΑ

Άρθρο 1

Εγκρίνονται οι τροποποιήσεις του Κανονισμού Χρηματιστηρίου Αθηνών όπως αυτές αποφασίστηκαν στην υπ. αριθμ. 109 συνεδρίαση της Διοικούσας Επιτροπής Χρηματιστηριακών Αγορών της 14ης Ιουλίου 2016, ως ακολούθως:

1. Το δεύτερο εδάφιο της εσωτερικής παραγράφου 1) της παραγράφου 1.2.4 (Χρηματοοικονομικές απαιτήσεις) αντικαθίσταται ως εξής: «Τα Μέλη οφείλουν επίσης να αποστέλλουν στο Χ.Α., σε ηλεκτρονική μορφή τις ελεγμένες εξαμηνιαίες και ετήσιες οικονομικές καταστάσεις εντός μηνός από την δημοσίευσή τους».
2. Η εσωτερική παράγραφος 4) της παραγράφου 1.2.6 (Επαγγελματική επάρκεια) αντικαθίσταται ως εξής: «4) Τα Μέλη οφείλουν να δηλώνουν στο Χ.Α. τα στοιχεία των Πιστοποιημένων Διαπραγματευστών, ως και κάθε μεταβολή των στοιχείων αυτών.»

3. Η εσωτερική παράγραφος 2) της παραγράφου 1.2.9 (Επικοινωνία με τα Μέλη) αντικαθίσταται ως εξής: «2) Διεύθυνση του Μέλους για την επικοινωνία του με το Χ.Α. είναι αυτή που το Μέλος έχει καθορίσει στην αίτησή του για την απόκτηση της σχετικής ιδιότητας. Κάθε αλλαγή διεύθυνσης του Μέλους γνωστοποιείται εγγράφως στο Χ.Α. σύμφωνα με τις διαδικασίες του.».

4. Η εσωτερική παράγραφος 3) της παραγράφου 1.2.9 (Επικοινωνία με τα Μέλη) αντικαθίσταται ως εξής: «3) Το Χ.Α. δύναται με Απόφασή του να εξειδικεύει τις διαδικασίες και τα μέσα επικοινωνίας των Μελών του με αυτό θέτοντας ειδικά κριτήρια ανάλογα με την ιδιότητα του Μέλους ή του Ειδικού Διαπραγματευτή ή των υποψηφίων προς κτήση των σχετικών ιδιοτήτων, τις αρμοδιότητες των υπευθύνων επικοινωνίας του Μέλους και των θεμάτων που χειρίζονται σε σχέση με την ιδιότητα του Μέλους, ως και κάθε άλλο θέμα και σχετική τεχνική λεπτομέρεια που αφορά τις διαδικασίες αυτές. Η επικοινωνία του Μέλους με το Χ.Α. θεωρείται δεσμευτική και παράγει τα έννομα αποτελέσματά της μόνο εφόσον διενεργείται από τον υπεύθυνο επικοινωνίας του Μέλους, όπως καθορίζεται κατά περίπτωση ανάλογα με τις αρμοδιότητες που ασκεί στο Μέλος.»

5. Η εσωτερική παράγραφος 4) της παραγράφου 1.2.9 καταργείται και η εσωτερική παράγραφος 5) αναριθμείται σε 4).

6. Τα στοιχεία iii) και iv) της περίπτωσης ε) της εσωτερικής παραγράφου 2) της παραγράφου 1.3.1 «Προϋποθέσεις για την απόκτηση και διατήρηση της ιδιότητας του Ειδικού Διαπραγματευτή» αντικαθίστανται ως εξής: «iii) να προβλέπει διαδικασίες ελέγχου των συναλλαγών σε Χρηματοπιστωτικά Μέσα, για τα οποία το Μέλος ενεργεί ως Ειδικός Διαπραγματευτής, ώστε οι εν λόγω συναλλαγές να συμφωνούν με τη στρατηγική ειδικής διαπραγμάτευσης και διαχείρισης κινδύνων του Μέλους, iv) να προβλέπει μέτρα ώστε να εξασφαλίζεται η διαφάνεια, η αντικειμενικότητα και ανεξαρτησία ενεργειών των απασχολούμενων στο Μέλος, ιδίως εκείνων που απασχολούνται στην Υπηρεσία Ειδικής Διαπραγμάτευσης, καθώς και των Μελών του Δ.Σ. και η αποφυγή σύγκρουσης συμφερόντων για τα πρόσωπα αυτά».

7. Η εσωτερική παράγραφος 4) της παραγράφου 1.3.1 αντικαθίσταται ως εξής: «4) Με Απόφαση του Χ.Α. μπορεί να εξειδικεύονται οι προϋποθέσεις για την απόκτηση και την διατήρηση της ιδιότητας του Ειδικού Διαπραγματευτή».

8. Η εσωτερική παράγραφος 2) της παραγράφου 1.3.4 (Παρακολούθηση της ειδικής διαπραγμάτευσης) αντικαθίσταται ως εξής: «2) Οι συναλλαγές των Ειδικών Διαπραγματευστών ανά Χρηματοπιστωτικό Μέσο παρακολουθούνται από το Χ.Α. σε διαρκή βάση. Τα αρμόδια όργανα του Χ.Α παρακολουθούν τη διενέργεια συναλλαγών του Ειδικού Διαπραγματευτή σύμφωνα με τον παρόντα Κανονισμό».

9. Η εσωτερική παράγραφος 3) της παραγράφου 1.3.4 (Παρακολούθηση της ειδικής διαπραγμάτευσης) αντικαθίσταται ως εξής: «3) Ο υπεύθυνος Ειδικός Διαπραγματευτής οφείλει να αιτιολογεί στα αρμόδια όργανα του Χ.Α., εφόσον του ζητηθεί, κάθε σημαντική διακύμανση τιμής Χρηματοπιστωτικού Μέσου, για το οποίο έχει αναλάβει την ειδική διαπραγμάτευση, ως και κάθε άλλο στοιχείο σχετικό με την διαπραγμάτευση αυτή».

10. Το πρώτο εδάφιο της εσωτερικής παραγράφου 2) της παραγράφου 1.3.5 (Διαφάνεια Ειδικής διαπραγμάτευσης) αντικαθίσταται ως εξής: «2) Το Μέλος ως Ειδικός Διαπραγματευτής οφείλει να τηρεί τα παραπάνω στοιχεία για πέντε (5) τουλάχιστον έτη, θέτει δε τα στοιχεία αυτά σε πρώτη ζήτηση στη διάθεση της Επιτροπής Κεφαλαιαγοράς και του Χ.Α.»

11. Το δεύτερο εδάφιο της εσωτερικής παραγράφου 1) της παραγράφου 1.4.3 (Έλεγχος Χρηστών) καταργείται.

12. Το στοιχείο vii) της περίπτωσης β) της εσωτερικής παραγράφου 1) της παραγράφου 2.2.1 (Στοιχεία εντολών) αντικαθίσταται ως εξής: «vii) Διάρκεια: Αν δεν οριστεί ορισμένη διάρκεια σύμφωνα με την § 2.2.5, η εντολή θεωρείται ότι έχει ημερήσια διάρκεια. Για την περίπτωση εντολών δανειοδοσίας των Μεθόδων 8-1 και 8-2 και 8-3-3, εάν δεν δηλωθεί όρος διάρκειας, είναι αορίστου διάρκειας.».

13. Η υποπαράγραφος 2.2.5.1 (Ορισμός διάρκειας) αντικαθίσταται ως εξής: «Η διάρκεια μιας εντολής δηλώνει το χρονικό διάστημα για το οποίο η εντολή παραμένει στο Σύστημα ενεργή προς εκτέλεση. Οι εντολές με βάση τη διάρκεια ορίζονται σύμφωνα με τις §§ 2.2.5.2 και 2.2.5.3. Οι εν λόγω εντολές απενεργοποιούνται υποχρεωτικά από το Σύστημα στις παρακάτω περιπτώσεις:

- α) εάν η τιμή τους βρίσκεται εκτός των επιτρεπόμενων ημερήσιων ορίων διαπραγμάτευσης ως ορίζονται στην §2.6.3. ή
- β) εάν το Πιστωτικό όριο του Μέλους που τις εισήγαγε δεν επαρκεί για την κάλυψη των σχετικών εντολών ή
- γ) εάν έχουν επιβληθεί μέτρα απαγόρευσης συμμετοχής στις συναλλαγές κατά του Μέλους ή χρήστη αυτού, που εισήγαγε τις σχετικές εντολές, με βάση τους όρους του παρόντος ή σύμφωνα με τις κείμενες διατάξεις.»

14. Η περίπτωση στ) της εσωτερικής παραγράφου 2 της παραγράφου 2.2.7.1 καταργείται και οι περιπτώσεις ζ) και η) αναριθμούνται σε στ) και ζ) αντίστοιχα.

15. Η εσωτερική παράγραφος 8 της παραγράφου 2.3.1 αντικαθίσταται ως εξής: «8) Με Απόφαση του Χ.Α. καθορίζονται για τις Αγορές του Χ.Α. και τον Μηχανισμό Δανεισμού Τίτλων του Χ.Α., οι μέθοδοι διαπραγμάτευσης που επιλέγονται κάθε φορά από τις οριζόμενες στην παρούσα § 2.3, οι περίοδοι κάθε μεθόδου, ή και οι πίνακες διαπραγμάτευσης, όπου συντρέχει περίπτωση, ή και τα είδη των εντολών που αντιστοιχούν σε κάθε Πίνακα ως και κάθε άλλο σχετικό θέμα και αναγκαία λεπτομέρεια.».

16. Οι παράγραφοι 2.4.1, 2.4.2, 2.4.3 και 2.4.4 του άρθρου 2.4. (Ειδική Διαπραγμάτευση) καταργούνται και το εν λόγω άρθρο 2.4 αντικαθίσταται ως εξής:

«2.4 Ειδική Διαπραγμάτευση

2.4.1 Υποχρεώσεις Ειδικού Διαπραγματευτή

- 1) Ο Ειδικός Διαπραγματευτής, ως ορίζεται ανά Αγορά και Χρηματοπιστωτικό Μέσο σύμφωνα με την παράγραφο 1.3.1, υποχρεούται να διαβιβάζει στην Αγορά εντολές ειδικής διαπραγμάτευσης επί του Χρηματοπιστωτικού Μέσου επί του οποίου αναλαμβάνει σχετικές υποχρεώσεις.
- 2) Ως εντολή ειδικής διαπραγμάτευσης ορίζεται, για τις ανάγκες του παρόντος, ζεύγος δεσμευτικών προσφορών αγοράς και πώλησης που διαβιβάζει ο Ειδικός Διαπραγματευτής για ίδιο λογαριασμό στην Αγορά σε συνεχή βάση επί του Χρηματοπιστωτικού Μέσου, επί του οποίου αναλαμβάνει σχετικές υποχρεώσεις, σύμφωνα με τα ειδικότερα οριζόμενα στις παρακάτω παραγράφους.
- 3) Ο Ειδικός Διαπραγματευτής οφείλει να διασφαλίζει την ύπαρξη των απαραίτητων ρευστών διαθεσίμων ή Χρηματοπιστωτικών Μέσων ώστε να καθίσταται εφικτή η εμπρόθεσμη εκπλήρωση των αντιστοιχών υποχρεώσεων του που αφορούν στο διακανονισμό των συναλλαγών του ειδικής διαπραγμάτευσης.
- 4) Προς εκπλήρωση των υποχρεώσεων του σύμφωνα με την προηγούμενη παράγραφο που αφορούν παράδοση Κινητών Αξιών, ο Ειδικός Διαπραγματευτής δύναται να συνάπτει Συμβάσεις δανεισμού τίτλων ή προσυμφωνημένες συναλλαγές σύμφωνα με τους όρους του παρόντος Κανονισμού.

2.4.2 Όροι Ειδικής Διαπραγμάτευσης

1) Οι εντολές ειδικής διαπραγμάτευσης επί Χρηματοπιστωτικού Μέσου εισάγονται στην Αγορά καθ' όλη τη διάρκεια των κανονικών ωρών ειδικής διαπραγμάτευσης που αφορούν το σχετικό Χρηματοπιστωτικό Μέσο.

2) Οι όροι της ειδικής διαπραγμάτευσης καθορίζονται από το Χ.Α. με Απόφασή του ανά Χρηματοπιστωτικό Μέσο και αφορούν ιδίως τα εξής:

α) Τη συχνότητα διαβίβασης εντολών ειδικής διαπραγμάτευσης: Στις περιπτώσεις όπου προβλέπεται υποχρέωση για συνεχή διαβίβαση εντολών, ο Ειδικός Διαπραγματευτής οφείλει να επανεισάγει εντολή ειδικής διαπραγμάτευσης εντός του σχετικώς προβλεπόμενου ως προς το Χρηματοπιστωτικό Μέσο χρόνου μετά την ολική ή μερική εκτέλεση προηγούμενης εντολής ειδικής διαπραγμάτευσης αυτού. Στις περιπτώσεις όπου προβλέπεται υποχρέωση για διαβίβαση εντολών κατόπιν αιτήματος παροχής τιμών (quote request), ο Ειδικός Διαπραγματευτής οφείλει να διαβιβάζει εντολές ειδικής διαπραγμάτευσης εντός του σχετικώς προβλεπόμενου ως προς το Χρηματοπιστωτικό Μέσο χρόνου από της εισαγωγής του αιτήματος.

β) Τη μέγιστη απόκλιση τιμής: Ο Ειδικός Διαπραγματευτής οφείλει να διαβιβάζει προσφορές αγοράς και πώλησης, σε εκτέλεση των υποχρεώσεων του ειδικής διαπραγμάτευσης, σε τιμές η διαφορά των οποίων δεν πρέπει να υπερβαίνει τη σχετικώς προβλεπόμενη ως προς το Χρηματοπιστωτικό Μέσο μέγιστη απόκλιση τιμής. Οι τιμές κυμαίνονται εντός των εκάστοτε επιτρεπτών ημερήσιων ορίων διακύμανσής τους ή της τυχόν επέκτασης των σχετικών ορίων, όπου συντρέχει περίπτωση, της παραγράφου 2.6.3.

γ) Την ελάχιστη ποσότητα τεμαχίων ή συμβολαίων: Ο Ειδικός Διαπραγματευτής οφείλει να διαβιβάζει εντολές ειδικής διαπραγμάτευσης για ποσότητα τεμαχίων ή συμβολαίων, ανάλογα με την περίπτωση, η οποία δεν πρέπει να υπολείπεται ανά εντολή της σχετικώς προβλεπόμενης ως προς το Χρηματοπιστωτικό Μέσο ελάχιστης ποσότητας τεμαχίων ή συμβολαίων αντίστοιχα. Προκειμένου για Κινητές Αξίες, η ελάχιστη ποσότητα τεμαχίων που πρέπει να ανακοινώνεται (ελάχιστη ανακοινώσιμη ποσότητα) για κάθε είδος Κινητής Αξίας υπολογίζεται από το Χ.Α. ανά ημερολογιακό τρίμηνο και δημοσιεύεται στο Η.Δ.Τ. τη δεύτερη (2η) εργάσιμη ημέρα μετά τη λήξη του ημερολογιακού τριμήνου. Για τον υπολογισμό της γίνεται στρογγυλοποίηση στο ανώτερο ακέραιο πολλαπλάσιο της μονάδας διαπραγμάτευσης της Κινητής Αξίας την οποία αφορά. Ως ημέρα έναρξης εφαρμογής των νέων τιμών της ελάχιστης ανακοινώσιμης ποσότητα κινητής αξίας ορίζεται η πρώτη εργάσιμη Δευτέρα μετά τη δημοσίευση στο Η.Δ.Τ.

δ) Το χρονικό διάστημα εντός του οποίου αναλαμβάνονται ανά συνεδρίαση οι υποχρεώσεις ειδικής διαπραγμάτευσης: Ο Ειδικός Διαπραγματευτής οφείλει να διαβιβάζει εντολές ειδικής διαπραγμάτευσης καθ' όλη τη διάρκεια των κανονικών ωρών ειδικής διαπραγμάτευσης επί του Χρηματοπιστωτικού Μέσου στο οποίο αφορά.

ε) Τις περιπτώσεις κατά τις οποίες αίρονται οι υποχρεώσεις ειδικής διαπραγμάτευσης.

στ) Τις Μεθόδους διαπραγμάτευσης σύμφωνα με τις οποίες εισάγονται εντολές ειδικής διαπραγμάτευσης.

ζ) Οι όροι καταχώρησης εντολών, πέραν των εντολών ειδικής διαπραγμάτευσης, για ίδιο λογαριασμό, που καταχωρούνται μέσω του ξεχωριστού κωδικού που προβλέπεται για τον Ειδικό Διαπραγματευτή σύμφωνα με τον παρόντα Κανονισμό

η) Τις εκάστοτε ποινικές ρήτρες ειδικής διαπραγμάτευσης. Οι ποινές αυτές τυποποιούνται και κλιμακώνονται ανάλογα με την περίπτωση παράβασης των υποχρεώσεων του Ειδικού Διαπραγματευτή ως και τις λουπές συνέπειες στις περιπτώσεις παράβασης των υποχρεώσεων αυτών.

3) Η ύπαρξη Ειδικού Διαπραγματευτή δε συνιστά προϋπόθεση για την εισαγωγή Χρηματοπιστωτικού Μέσου προς διαπραγμάτευση σε Αγορά, εκτός εάν τούτο ορίζεται ειδικά στον παρόντα Κανονισμό. Με Απόφαση του Χ.Α. δύναται να ορίζονται και άλλες περιπτώσεις Χρηματοπιστωτικών Μέσων στις οποίες η ύπαρξη Ειδικού Διαπραγματευτή είναι υποχρεωτική.

2.4.3 Ειδικές περιπτώσεις συναλλαγών Ειδικού Διαπραγματευτή

1) Σε περίπτωση που το Μέλος, πέραν της ιδιότητας του Ειδικού Διαπραγματευτή στην Αγορά Αξιών είναι Ειδικός Διαπραγματευτής και στην Αγορά Παραγώγων σε Παράγωγα με υποκείμενη αξία είτε Κινητές Αξίες της ειδικής διαπραγμάτευσής του στην Αγορά Αξιών είτε δείκτη, στον οποίο συμμετέχουν οι Κινητές Αξίες της ειδικής διαπραγμάτευσής του αυτής, το Μέλος δικαιούται να εισάγει εντολές και να διενεργεί συναλλαγές επί των σχετικών Κινητών Αξιών στο πλαίσιο της ειδικής διαπραγμάτευσης που διενεργεί στην Αγορά Παραγώγων. Στην περίπτωση αυτή, οι παραπάνω εντολές και συναλλαγές εισάγονται από το Μέλος υποχρεωτικά μέσω του κωδικού πελάτη (κωδικού ΟΑΣΗΣ) που διατηρεί αυτό για ίδιο λογαριασμό και όχι μέσω του ξεχωριστού κωδικού που διατηρεί ως Ειδικός Διαπραγματευτής Αξιών.

2) Ο Ειδικός Διαπραγματευτής επί Μεριδίων Δ.Α.Κ. μπορεί να διενεργεί συναλλαγές επί των υποκειμένων Κινητών Αξιών που συνθέτουν το δείκτη τον οποίο αναπαράγει το Δ.Α.Κ. μέσω του ξεχωριστού κωδικού που διατηρεί ως Ειδικός Διαπραγματευτής Δ.Α.Κ. , εφόσον οι συναλλαγές αυτές διενεργούνται για τις ανάγκες της ειδικής διαπραγμάτευσης (πχ. κάλυψη κινδύνων) ή για την δημιουργία ή εξαγορά Μεριδίων. Ο Ειδικός Διαπραγματευτής επί Σ.Χ.Π. μπορεί να διενεργεί συναλλαγές επί των υποκειμένων αξιών των Σ.Χ.Π. μέσω του ξεχωριστού κωδικού της ειδικής διαπραγμάτευσης επί Σ.Χ.Π.».

17. Μετά την εσωτερική παράγραφο 2) της υποπαράγραφου 2.6.9.1 προστίθενται εσωτερικές παράγραφοι 3), 4) και 5) ως εξής:

«3) Για την περίπτωση επαναδιαπραγμάτευσης Κινητών Αξιών που τελούν σε αναστολή εφαρμόζονται οι διατάξεις της § 5.4.

4) Αρμόδιο όργανο για την αναστολή της διαπραγμάτευσης Κινητής Αξίας είναι ο Πρόεδρος το Δ.Σ. του Χ.Α. ή άλλο εντεταλμένο προς τούτο όργανο του Χ.Α.

5) Το Χ.Α. μπορεί να εξειδικεύει με Απόφασή του τους όρους και τις προϋποθέσεις αναστολής Κινητής Αξίας.».

18. Η υποπαράγραφος 2.6.9.2 «Αναστολή Παραγώγων» αντικαθίσταται ως εξής:

«1) Στην περίπτωση των Παραγώγων, λόγος αναστολής είναι ιδίως η αναστολή της διαπραγμάτευσης ή της λειτουργίας της υποκείμενης αξίας του Παραγώγου και η προσωρινή μη διασφάλιση ή απειλή της ομαλής λειτουργίας της Αγοράς. Σε περίπτωση που η υποκείμενη αξία του Παραγώγου είναι δείκτης, ως αναστολή λειτουργίας του νοείται η προσωρινή διακοπή του υπολογισμού ή της δημοσίευσης του δείκτη.

2) Κατά τη διάρκεια της αναστολής δεν είναι δυνατή η άσκηση δικαιωμάτων προαίρεσης ή άλλων δικαιωμάτων εκ του Παραγώγου.

3) Εάν αρθεί η αναστολή της διαπραγμάτευσης του Παραγώγου, οι σειρές που δεν υπόκεινται σε λήξη έως και τη δεύτερη (2η) εργάσιμη ημέρα από την ημέρα άρσης της αναστολής αυτού, συνεχίζουν να τυγχάνουν διαπραγμάτευσης κανονικά σύμφωνα με τα χαρακτηριστικά εισαγωγής του Παραγώγου.

4) Σε περίπτωση σειρών που λήγουν πριν την άρση της αναστολής της διαπραγμάτευσης του Παραγώγου ή των οποίων η λήξη επέρχεται εντός των δύο (2) πρώτων εργασιμών ημερών από την ημέρα άρσης της αναστολής αυτού, η λήξη τους μετατίθεται αυτοδίκαια και οι σχετικές σειρές λήγουν αναγκαστικά κατά την τρίτη (3η) εργάσιμη ημέρα από την ημέρα άρσης της διαπραγμάτευσης του Παραγώγου.

5) Εάν ως συνέπεια της μετάθεσης της λήξης σειράς Παραγώγου σύμφωνα με την προηγούμενη παράγραφο η λήξη της συμπίσει με τη λήξη χρονικά προγενέστερης σειράς αυτού, η λήξη της μεταγενέστερης σειράς μετατίθεται αυτοδίκαια κατά μία εργάσιμη ημέρα.

6) Οι ανοικτές θέσεις επί των ως άνω σειρών διακανονίζονται κανονικά σε τιμή που καθορίζεται ως τελική τιμή εκκαθάρισης του Παραγώγου σύμφωνα με τα χαρακτηριστικά εισαγωγής του.

7) Σε περίπτωση διαγραφής του παραγώγου κατά την περίοδο που βρίσκεται σε αναστολή, εφαρμόζονται οι διατάξεις της παραγράφου 2.6.12.

8) Αρμόδιο όργανο για την αναστολή της διαπραγμάτευσης Παραγώγου είναι ο Πρόεδρος το Δ.Σ. του Χ.Α. ή άλλο εντεταλμένο προς τούτο όργανο του Χ.Α.

9) Το Χ.Α. μπορεί να εξειδικεύει με Απόφασή του τους όρους και τις προϋποθέσεις αναστολής Παραγώγου, ως και κάθε άλλο τεχνικό θέμα και αναγκαία λεπτομέρεια.».

19. Η εσωτερική παράγραφος 1 της παραγράφου 2.6.10 αντικαθίσταται ως εξής: «1) Το Χ.Α. μπορεί να αναστέλλει τη διεξαγωγή συναλλαγών σε Προϊόντα δανεισμού τίτλων στον Μηχανισμό Δανεισμού Τίτλων για λόγους προστασίας της αγοράς και των συμφερόντων των επενδυτών.». **Οι εσωτερικές παράγραφοι 2, ι), 3, 4) και 5) διορθώνονται στην ορθή αρίθμηση 2, 3, 4, 5 και 6 αντίστοιχα.**

20. Η περίπτωση γ) της εσωτερικής παραγράφου 1) της παραγράφου 2.6.11 (Παύση εισαγωγής ή διαγραφή σειρών παραγώγου) αντικαθίσταται ως εξής: «γ) εφόσον συντρέχουν λόγοι που σχετίζονται με τα χαρακτηριστικά εισαγωγής του Παραγώγου εκτός αυτών που συνεπάγονται διαγραφή του σύμφωνα με την παρ. 2.6.12.».

21. Η εσωτερική παράγραφος 2) της παραγράφου 2.6.11 αντικαθίσταται ως εξής: «2) Για τους αυτούς λόγους το Χ.Α. μπορεί να διαγράφει υφιστάμενες σειρές Παραγώγου. Το Χ.Α. προβαίνει σε διαγραφή των ως άνω σειρών μόνο εφόσον δεν υφίστανται ανοιχτές θέσεις επί των σχετικών Παραγώγων».

22. Η περίπτωση α) της εσωτερικής παραγράφου 3) της παραγράφου 2.6.12 «Διαγραφή Χρηματοπιστωτικού Μέσου» αντικαθίσταται ως εξής: «α) αναστολής διαπραγμάτευσης των σχετικών Κινητών Αξιών για διάστημα άνω των έξι (6) μηνών, εφόσον παρέλθει άπρακτη προθεσμία έξι (6) μηνών και εφόσον εξαντληθεί και η δυνατότητα παράτασης άλλων έξι (6) μηνών»

23. Μετά το τέλος της εσωτερικής παραγράφου 3 της παραγράφου 2.6.12 προστίθενται νέες εσωτερικές παράγραφοι 4), 5), 6), 7), 8) και 9) ως εξής:

«4) Λόγοι διαγραφής Παραγώγου συνιστούν ιδίως:

α) εάν η υποκείμενη αξία του Παραγώγου είναι Κινητή Αξία, η διαγραφή της υποκείμενης αξίας από τη διαπραγμάτευση, η ένταξή της σε Κατηγορία Διαπραγμάτευσης διαφορετική από αυτή που προβλέπεται στα χαρακτηριστικά εισαγωγής του Παραγώγου ή η διαγραφή της από δείκτη στον οποίο μετείχε σύμφωνα με τα σχετικά χαρακτηριστικά εισαγωγής του,

β) εάν η υποκείμενη αξία του Παραγώγου είναι δείκτης, η διακοπή του υπολογισμού ή της δημοσίευσης του δείκτη.

5) Σε περίπτωση διαγραφής Παραγώγου, οι σειρές του Παραγώγου, ακόμη και μη ληξιπρόθεσμες, λήγουν αναγκαστικά κατά τη σχετική ημέρα διαγραφής κατά τρόπο αυτοδίκαιο και το Παράγωγο διαγράφεται από τη διαπραγμάτευση.

6) Οι ανοικτές θέσεις επί του Παραγώγου που διαγράφεται, ακόμη και μη ληξιπρόθεσμες, λήγουν και αυτές αναγκαστικά κατά την ως άνω ημέρα διαγραφής και διακανονίζονται κανονικά σύμφωνα με τα χαρακτηριστικά εισαγωγής του Παραγώγου.

7) Εάν πρόκειται για Δικαίωμα προαίρεσης, η άσκηση του δικαιώματος διενεργείται κανονικά κατά την ημέρα της διαγραφής εφαρμοζομένων των όρων της παραγράφου 3.2.3.2.3 του παρόντος.

8) Για τον υπολογισμό των χρηματικών υποχρεώσεων των συμβαλλομένων μερών κατά τη φυσική παράδοση ή το χρηματικό διακανονισμό, ανάλογα με την περίπτωση, λαμβάνεται υπόψη η τελευταία δημοσιευμένη τιμή της υποκείμενης αξίας πριν τη διαγραφή του Παραγώγου ή η τελευταία δημοσιευμένη τιμή του δείκτη της υποκείμενης αξίας πριν από τη διακοπή υπολογισμού του ή τη διακοπή δημοσίευσής αυτού.

9) Κατά την περίοδο διακανονισμού των παραδόσεων Κινητών Αξιών των προηγούμενων υποπαραγράφων επιτρέπεται η διενέργεια προσυμφωνημένων συναλλαγών επί των σχετικών Κινητών Αξιών με τη Μέθοδο 6-2, ως ορίζονται στον παρόντα Κανονισμό, προς διευκόλυνση και μόνο του διακανονισμού των σχετικών παραδόσεων.».

24. Οι εσωτερικές παράγραφοι 8 και 9 της παραγράφου 2.6.12 αναριθμούνται σε 10 και 11 αντίστοιχα.

25. Η εσωτερική παράγραφοι 2) της παραγράφου 7.1.3 (Διοικούσα Επιτροπή Χρηματιστηριακών Αγορών) αντικαθίσταται ως εξής:

«2) Η Διοικούσα Επιτροπή Χρηματιστηριακών Αγορών απαρτίζεται κατ' ελάχιστο από εννέα (9) τακτικά μέλη και κατ' ανώτατο από 13 τακτικά μέλη, εκ των οποίων τρία (3) επιλέγονται μεταξύ των στελεχών του Χ.Α και των εταιρειών του Ομίλου του και τα οποία θεωρούνται εκτελεστικά και τα υπόλοιπα μεταξύ προσώπων που διαθέτουν εχέγγυα κύρους και εξειδίκευσης σε θέματα κεφαλαιαγοράς στην ημεδαπή ή στο εξωτερικό. Πέραν των παραπάνω τακτικών μελών η Επιτροπή δύναται να έχει και αναπληρωματικά μέλη. Τα Μέλη της Επιτροπής, τακτικά ή και αναπληρωματικά, ορίζονται με απόφαση του ΔΣ του Χ.Α.».

26. Μετά το τέλος της εσωτερικής παραγράφου 5) της παραγράφου 7.1.3 προστίθεται νέο εδάφιο ως εξής: «Η Επιτροπή δύναται να συστήνει επιτροπές και να αναθέτει σε αυτές καθώς και σε άλλα όργανα του Χ.Α. αρμοδιότητες που σχετίζονται με την εφαρμογή των διατάξεων του παρόντος Κανονισμού. Δεν ανατίθενται αρμοδιότητες οι οποίες αφορούν την τροποποίηση του παρόντος Κανονισμού ή την έκδοση αποφάσεων σε εκτέλεσή του σύμφωνα με την παράγραφο 7.3.1».

27. Μετά το τέλος της παραγράφου 7.4 προστίθεται νέα παράγραφος 7.5 «2^η τροποποίηση – Μεταβατικές διατάξεις» ως εξής:

1) Η ισχύς της 2ης τροποποίησης του Κανονισμού, όπως υιοθετήθηκε κατά την από 14.7.2016 συνεδρίαση της Δ.Ε. του Χ.Α., άρχεται από την ημερομηνία δημοσίευσης στην Εφημερίδα της Κυβερνήσεως της έγκρισης της ως άνω τροποποίησης από την Επιτροπή Κεφαλαιαγοράς.
2) Οι υφιστάμενες κατά την έναρξη ισχύος της 2ης τροποποίησης Αποφάσεις του Χ.Α. που αφορούν στην ειδική διαπραγμάτευση ισχύουν κανονικά μέχρι την έκδοση Απόφασης σύμφωνα με την παράγραφο 2.4.2 § 2 που αφορά την αντικατάσταση ή τροποποίησή τους.
3) Η θητεία της υφιστάμενης κατά την έναρξη ισχύος της 2ης τροποποίησης Διοικούσας Επιτροπής διαρκεί έως την αντικατάστασή της σύμφωνα με τα προβλεπόμενα στην παράγραφο 7.1.3, όπως τροποποιείται».

Άρθρο 2

Οι παραπάνω τροποποιήσεις, όπως αυτές εγκρίνονται με την παρούσα απόφαση, πρέπει να ενσωματωθούν σε ενιαίο κείμενο στον «Κανονισμό Χρηματιστηρίου Αθηνών» και να αναρτηθούν στην ηλεκτρονική ιστοσελίδα του Χρηματιστηρίου Αθηνών Α.Ε.

Άρθρο 3

Η παρούσα απόφαση ισχύει από τη λήψη της.

Από τις διατάξεις της παρούσας δεν προκαλείται δαπάνη σε βάρος του Κρατικού Προϋπολογισμού.

Η παρούσα απόφαση να δημοσιευθεί στην Εφημερίδα της Κυβερνήσεως (Τεύχος Β).

Η Γραμματέας

Αλεξάνδρα Νινάσιου

Ο Α' Αντιπρόεδρος

Ο Β' Αντιπρόεδρος

Νικόλαος Τρουλλινός

Ξενοφών Αυλωνίτης

Τα Μέλη

Δημήτριος Αυγητίδης

Πέτρος Ζενέλης

Ιωάννα Σεληνιωτάκη