



ΕΛΛΗΝΙΚΗ ΔΗΜΟΚΡΑΤΙΑ

ΕΠΙΤΡΟΠΗ ΚΕΦΑΛΑΙΑΓΟΡΑΣ

Ν.Π.Δ.Δ.

ΑΝΑΡΤΗΤΕΑ ΣΤΟ ΔΙΑΔΙΚΤΥΟ

ΑΠΟΦΑΣΗ

3/649/3.6.2013

του Διοικητικού Συμβουλίου

Θέμα: Τροποποίηση του Κανονισμού Εκκαθάρισης Συναλλαγών επί Παραγώγων.

**ΤΟ ΔΙΟΙΚΗΤΙΚΟ ΣΥΜΒΟΥΛΙΟ
ΤΗΣ ΕΠΙΤΡΟΠΗΣ ΚΕΦΑΛΑΙΑΓΟΡΑΣ**

Έχοντας υπόψη:

1. Τις διατάξεις του άρθρου 73 του ν. 3606/2007 «Αγορές χρηματοπιστωτικών μέσων και άλλες διατάξεις» (ΦΕΚ Α 195/17.08.2007).
2. Την απόφαση 7/556/8.07.2010 (ΦΕΚ Β 1172/4.8.2010) του Διοικητικού Συμβουλίου της Επιτροπής Κεφαλαιαγοράς «Χορήγηση άδειας λειτουργίας Συστήματος Παραγώγων στην ανώνυμη εταιρία με την επωνυμία Εταιρεία Εκκαθάρισης Συναλλαγών Χρηματιστηρίου Αθηνών Ανώνυμη Εταιρεία (ΕΤ.ΕΚ) και έγκριση Κανονισμού λειτουργίας».
3. 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).
4. Το απόσπασμα πρακτικών της 84/29.4.2013 συνεδρίασεως του Δ.Σ. της Εταιρείας Εκκαθάρισης Συναλλαγών Χρηματιστηρίου Αθηνών Ανώνυμη Εταιρεία.
5. Την επιστολή, με αρ. πρωτ. Ε.Κ. 7181/30.5.2013, της Εταιρείας Εκκαθάρισης Συναλλαγών Χρηματιστηρίου Αθηνών Ανώνυμη Εταιρεία.
6. Το άρθρο 90 του «Κώδικα της νομοθεσίας για την Κυβέρνηση και τα κυβερνητικά όργανα» που κυρώθηκε με το άρθρο Πρώτο του π.δ. 63/2005 (ΦΕΚ Α/98/22.4.2005).

ΑΠΟΦΑΣΙΖΕΙ ΟΜΟΦΩΝΑ

Την έγκριση των ακόλουθων τροποποιήσεων του «Κανονισμού Εκκαθάρισης Συναλλαγών επί Παραγώγων» όπως αναφέρονται στα πρακτικά της υπ' αριθμ. 84 συνεδρίασης του Δ.Σ. της ανώνυμης εταιρείας με την επωνυμία «Εταιρεία Εκκαθάρισης Συναλλαγών Χρηματιστηρίου Αθηνών Ανώνυμη Εταιρεία» της 29/4/2013 (Θέμα 1^ο):

1. Το στοιχείο (iii) της περίπτωσης β. της παραγράφου 4 του άρθρου 26 αντικαθίσταται ως ακολούθως:

«(iii) Για τη συνολική παρακολούθηση από την ΕΤ.ΕΚ. των ανοικτών θέσεων που προκύπτουν από τις παραπάνω πωλήσεις μετοχών με σύμφωνο επαναγοράς και αγορές μετοχών με σύμφωνο επαναπώλησης, ανά επενδυτή, μέσω του αντίστοιχου κωδικού εκκαθάρισης, η Ε.Χ.Α.Ε. ως Διαχειριστής του Σ.Α.Τ. τηρεί στους σχετικούς Λογαριασμούς των επενδυτών τα πληροφοριακά υπόλοιπα «προσδοκώμενες αξίες» και «οφειλόμενες αξίες», τα οποία η ΕΤ.ΕΚ. δύνата να συνεκτιμά κατά τον προσδιορισμό της ανοικτής θέσης επενδυτή για επαναγορά από την ΕΤ.ΕΚ. ή επαναπώληση στην ΕΤ.ΕΚ., αντίστοιχα, των υποκείμενων μετοχών.»

2. Το τελευταίο εδάφιο της δεύτερης υποπαραγράφου της παραγράφου 5 του άρθρου 26 αντικαθίσταται ως ακολούθως:

«Οι παραπάνω μεταφορές αξιών διενεργούνται από την Ε.Χ.Α.Ε. ως Διαχειριστής του Σ.Α.Τ. με την ιδιότητά της ως φορέα του Συστήματος Λογιστικής Παρακολούθησης Άυλων Τίτλων του Ελληνικού Δημοσίου κατ' εντολή της ΕΤ.ΕΚ.»

3. Το στοιχείο (iii) της περίπτωσης γ) της υποπαραγράφου Β) της παραγράφου 6 του άρθρου 29 αντικαθίσταται ως ακολούθως:

«(iii) πληρούν τα εκάστοτε οριζόμενα από την ΕΤ.ΕΚ. κριτήρια, όπως αυτά ορίζονται στις οικείες αποφάσεις της ΕΤ.ΕΚ.»

4. Στο τέλος της υποπαραγράφου Γ) της παραγράφου 6 του άρθρου 29 προστίθεται νέο εδάφιο ως ακολούθως:

«Οι παραπάνω αξίες θα εξαιρούνται από το παρασχεθέν περιθώριο ασφάλισης πριν από τη λήξη τους σε χρονική στιγμή που θα ορίζεται από την ΕΤ.ΕΚ.»

5. Η υποπαραγράφος Δ) της παραγράφου 6 του άρθρου 29 αντικαθίσταται ως ακολούθως:

«Δ) Σε περίπτωση παροχής περιθωρίου ασφάλισης σε άυλους τίτλους του Ελληνικού Δημοσίου από δικαιούχο κωδικού εκκαθάρισης μη φορέα, με τη μεταφορά άυλων τίτλων του Ελληνικού Δημοσίου από το λογαριασμό πελατείας του Μέλους της ΕΤ.ΕΚ., που τηρεί το σχετικό κωδικό εκκαθάρισης του δικαιούχου και είναι φορέας του Συστήματος Παρακολούθησης Άυλων Τίτλων της Τράπεζας της Ελλάδος, σε δεσμευμένο λογαριασμό πελατείας, που τηρείται στην Τράπεζα της Ελλάδος. Η ΕΤ.ΕΚ. θα συμπεριλαμβάνει στο παρασχεθέν περιθώριο ασφάλισης του δικαιούχου τις παραπάνω αξίες εφόσον λάβει σχετική επιβεβαίωση της μεταφοράς των τίτλων από την ίδια την Τράπεζα της Ελλάδος ή μέσω της Ε.Χ.Α.Ε. Η παροχή περιθωρίου ασφάλισης σε άυλους τίτλους του Ελληνικού Δημοσίου δεν αποκλείεται να διενεργείται μέσω του Σ.Α.Τ. σύμφωνα με τα προβλεπόμενα στην περίπτωση Β), εναλλακτικά του προβλεπόμενου ως άνω τρόπου. Οι παραπάνω αξίες θα εξαιρούνται από το παρασχεθέν περιθώριο ασφάλισης πριν από τη λήξη τους σε χρονική στιγμή που θα ορίζεται από την ΕΤ.ΕΚ.»

6. Στο τέλος της παραγράφου 3 του άρθρου 31 προστίθεται νέο εδάφιο ως ακολούθως:

«Αντίστοιχα, σε περίπτωση παροχής ως ασφάλειας τίτλων/ομολόγων με ημερομηνία λήξεως, η αντικατάσταση της ασφάλειας με νέα από το Μέλος πρέπει να διενεργείται πριν από την λήξη σε χρόνο που εκάστοτε ορίζεται από την ΕΤ.ΕΚ.»

7. Το τελευταίο εδάφιο της παραγράφου 7 του άρθρου 31 αντικαθίσταται ως ακολούθως:

«Η ΕΤ.ΕΚ. θα συμπεριλαμβάνει στην παρασχεθείσα ασφάλεια μέλους του δικαιούχου τις παραπάνω αξίες εφόσον λάβει σχετική επιβεβαίωση της ως άνω μεταφοράς των τίτλων από την ίδια την Τράπεζα της Ελλάδος ή μέσω της Ε.Χ.Α.Ε.»

Οι εγκριθείσες τροποποιήσεις ενσωματώνονται σε ενιαίο κείμενο στον «Κανονισμό Εκκαθάρισης Συναλλαγών Επί Παραγώγων» και αναρτώνται στην ηλεκτρονική ιστοσελίδα της «Εταιρείας Εκκαθάρισης Συναλλαγών Χρηματιστηρίου Αθηνών Ανώνυμη Εταιρεία».

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

Η παρούσα απόφαση ισχύει από τη λήψη της.

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

Η Γραμματέας

Χριστίνα Νικολιά

Ο Πρόεδρος

Η Α' Αντιπρόεδρος

Ο Β' Αντιπρόεδρος

Κωνσταντίνος Μμποτόπουλος

Βασιλική Λαζαράκου

Ξενοφών Αυλωνίτης

Τα μέλη

Γεώργιος Μούζουλας

Ιωάννα Σεληνιωτάκη

Δημήτριος Αυγητίδης

