
ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ ΑΜΟΙΒΑΙΑ ΚΕΦΑΛΑΙΑ (Δ.Α.Κ.)

(Exchange Traded Funds – ETFs)

Διάχυση Πληροφόρησης



Χρηματιστήριο Αθηνών Α.Ε.

Σεπτέμβριος 2007

Σημαντική Παρατήρηση

Το Χρηματιστήριο Αθηνών (ΧΑ) πιστεύει ότι οι πληροφορίες που περιέχονται στο παρόν κείμενο είναι ακριβείς κατά την ημερομηνία της δημοσίευσης του και σε καμία περίπτωση δεν αντικαθιστά το ισχύον Κανονιστικό Πλαίσιο (Κανονισμός ΧΑ, Αποφάσεις ΔΣ ΧΑ, Αποφάσεις ΔΣ ΕΚ κτλ) το οποίο σε κάθε περίπτωση υπερισχύει. Το παρόν κείμενο μπορεί να αλλάξει χωρίς προειδοποίηση. Το ΧΑ δεν έχει καμιά ευθύνη για άμεσες ή έμμεσες συνέπειες από πιθανά λάθη του παρόντος κειμένου.

Το παρόν κείμενο είναι πιο ενημερωμένο σε σχέση με παλαιότερες εκδόσεις που περιέχουν αντίστοιχη πληροφορία.

Πίνακας Περιεχομένων

| | | |
|----------|-----------------------------------|----------|
| 1 | ΔΙΑΧΥΣΗ ΠΛΗΡΟΦΟΡΗΣΗΣ | 4 |
| 1.1 | ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΔΑΚ | 4 |
| 1.1.1 | ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΑΠΟ ΕΤΑΙΡΙΕΣ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΗΣ | 4 |
| 1.1.1.1 | Χαρακτηριστικά ΔΑΚ | 4 |
| 1.1.1.2 | Στοιχεία Ενεργητικού | 5 |
| 1.1.1.3 | Σύνθεση Ενεργητικού | 6 |
| 1.1.1.4 | Δημιουργία - Εξαγορά | 7 |
| 1.1.1.5 | Αποδόσεις ΔΑΚ | 7 |
| 1.1.2 | ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ | 8 |
| 1.1.2.1 | Διαπραγμάτευση | 8 |
| 1.1.2.2 | Προσυμφωνημένες Συναλλαγές | 10 |
| 1.1.2.3 | Ανοικτές Πωλήσεις | 10 |
| 1.1.2.4 | Εκποιήσεις | 11 |
| 1.2 | ΣΥΣΤΗΜΑ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ ΟΑΣΗΣ | 11 |
| 1.3 | ΣΥΣΤΗΜΑ ΕΡΜΗΣ | 12 |

1 Διάχυση Πληροφόρησης

1.1 Στοιχεία ΔΑΚ

Τα στοιχεία των παρακάτω παραγράφων θα συγκεντρώνονται από το ΧΑ είτε από τις Εταιρίες Διαχείρισης είτε από το σύστημα συναλλαγών και θα τροφοδοτούν το Ημερήσιο Δελτίο Τιμών, τα στατιστικά δελτία του ΧΑ και την ιστοσελίδα του.

Τα Στοιχεία από τις Εταιρίες Διαχείρισης (παρ. 1.1.1) που αφορούν την ημέρα συναλλαγών Τ θα αποστέλλονται το αργότερο 2 ώρες πριν την έναρξη της συνεδρίασης της ημέρας Τ. Οι Εταιρίες Διαχείρισης θα αποστέλλουν τα στοιχεία μέσω του συστήματος ΕΡΜΗΣ (βλ. παρ. 1.3).

1.1.1 Στοιχεία από Εταιρίες Διαχείρισης

1.1.1.1 Χαρακτηριστικά ΔΑΚ

Τα παρακάτω στοιχεία αποτελούν τα βασικά στοιχεία αναγνώρισης και προσδιορισμού του ΔΑΚ ως διαπραγματευόμενη αξία. Αλλαγές στα παρακάτω στοιχεία θα γίνονται σε συγκεκριμένες περιπτώσεις (όχι περιοδικά).

| A/A | Στοιχείο | Περιγραφή | Σχόλια |
|-----|----------------------------|---|--------|
| | Ημερομηνία | Η ημέρα συναλλαγών Τ | |
| | Σύμβολο ΔΑΚ (ελληνικό) | Το ελληνικό σύμβολο του ΔΑΚ | |
| | Σύμβολο ΔΑΚ (αγγλικό) | Το αγγλικό σύμβολο του ΔΑΚ | |
| | Ονομασία ΔΑΚ (ελληνική) | Η ελληνική ονομασία του ΔΑΚ | |
| | Ονομασία ΔΑΚ (αγγλική) | Η αγγλική ονομασία του ΔΑΚ | |
| | ISIN ΔΑΚ | Το ISIN του ΔΑΚ | |
| | Κατηγορία Διαπραγμάτευσης | Κατηγορία Διαπραγμάτευσης ΔΑΚ | |
| | Τύπος ΔΑΚ | Ανάλογα με το είδος της κινητής αξίας που συνθέτει τον Δείκτη που αναπαραγάγει το ΔΑΚ (μετοχές ή ομόλογα) | |
| | Επενδυτική στρατηγική | Ο στόχος (στρατηγική) του ΔΑΚ | |
| | Εκδότης | Ο Εκδότης του ΔΑΚ | |
| | Εταιρία Διαχείρισης | Η Εταιρία Διαχείρισης του ΔΑΚ | |
| | Ειδικοί Διαπραγματευτές | Τα Μέλη του ΧΑ που έχουν αναλάβει την Ειδική Διαπραγμάτευση του ΔΑΚ | |
| | Θεματοφύλακας | Ο θεματοφύλακας του ΔΑΚ | |
| | Σύμβολο Δείκτη (ελληνικό) | Το ελληνικό σύμβολο του Δείκτη που παρακολουθεί το ΔΑΚ | |
| | Σύμβολο Δείκτη (αγγλικό) | Το αγγλικό σύμβολο του Δείκτη | |
| | Ονομασία Δείκτη (ελληνική) | Η ελληνική ονομασία του Δείκτη | |

| A/A | Στοιχείο | Περιγραφή | Σχόλια |
|------------|---------------------------------------|--|---------------|
| | Ονομασία Δείκτη (αγγλική) | Η αγγλική ονομασία του Δείκτη | |
| | ISIN Δείκτη | Το ISIN του Δείκτη | |
| | Κλάσμα Δείκτη | Το κλάσμα της τιμής του δείκτη που αποτελεί η τιμή της πρώτης έκδοσης | |
| | Αρχική Τιμή Μεριδίου | Η τιμή του μεριδίου κατά την πρώτη έκδοση του ΔΑΚ | |
| | Συνολικός αριθμός μεριδίων | Ο συνολικός αριθμός μεριδίων που έχουν λάβει άδεια εισαγωγής | |
| | Ημερομηνία πρώτης έκδοσης | Η ημερομηνία της πρώτης έκδοσης μεριδίων ΔΑΚ | |
| | Ημερομηνία έναρξη διαπραγμάτευσης | Η ημερομηνία έναρξης διαπραγμάτευσης στο ΧΑ | |
| | Νόμισμα Διαπραγμάτευσης | Το νόμισμα διαπραγμάτευσης | |
| | Νόμισμα Ενεργητικού | Το νόμισμα των κινητών αξιών από τις οποίες αποτελείται το ενεργητικό | |
| | Αρχική αξία ενεργητικού | Αξία ενεργητικού κατά την πρώτη έκδοση | |
| | Μονάδα δημιουργίας/ εξαγοράς | Ο αριθμός μεριδίων που απαιτείται κατά τη διαδικασία δημιουργίας/ εξαγοράς | |
| | Αμοιβές διαχείρισης και Θεματοφυλακής | Η αμοιβές εκφρασμένες ως ποσοστό για τις υπηρεσίες διαχείρισης και θεματοφυλακής | |

1.1.1.2 Στοιχεία Ενεργητικού

Τα παρακάτω στοιχεία θα πρέπει να αποστέλλονται από τον Εκδότη σε καθημερινή βάση.

| A/A | Στοιχείο | Περιγραφή | Σχόλια |
|------------|---------------------------------------|--|---------------|
| | Ημερομηνία | Η ημέρα συναλλαγών T | |
| | Σύμβολο ΔΑΚ (ελληνικό) | Το ελληνικό σύμβολο του ΔΑΚ | |
| | Σύμβολο ΔΑΚ (αγγλικό) | Το αγγλικό σύμβολο του ΔΑΚ | |
| | ISIN ΔΑΚ | Το ISIN του ΔΑΚ | |
| | Σύμβολο Δείκτη (ελληνικό) | Το ελληνικό σύμβολο του Δείκτη που παρακολουθεί το ΔΑΚ | |
| | Σύμβολο Δείκτη (αγγλικό) | Το αγγλικό σύμβολο του Δείκτη | |
| | ISIN Δείκτη | Το ISIN του Δείκτη | |
| | Εταιρία Διαχείρισης | Η Εταιρία Διαχείρισης του ΔΑΚ | |
| | Αριθμός μεριδίων (T-1) | Ο αριθμός μεριδίων που διαπραγματεύθηκαν στο ΧΑ την ημέρα T-1. | |
| | Αριθμός νεοεκδοθέντων μεριδίων (T-1) | Ο αριθμός των μεριδίων για τα οποία υποβλήθηκε αίτηση δημιουργίας την ημέρα T-1. | |
| | Αριθμός εξαγορασθέντων μεριδίων (T-1) | Αριθμός των μεριδίων για τα οποία υποβλήθηκε αίτηση εξαγοράς την ημέρα T-1. | |

| A/A | Στοιχείο | Περιγραφή | Σχόλια |
|-----|---------------------------------|--|--------|
| | Αριθμός μεριδίων (T) | Ο αριθμός μεριδίων που θα διαπραγματεύονται στο ΧΑ την ημέρα T. | (1) |
| | Καθαρή αξία συνόλου ενεργητικού | Η καθαρή αξία του συνόλου ενεργητικού την ημέρα T-1 (Net Assets Value – NAV) | (2) |
| | Καθαρή τιμή μεριδίου | Η καθαρή τιμή του μεριδίου του ΔΑΚ (NAV/Unit) | |
| | Μέρισμα ανά μερίδιο | Το μέρισμα ανά μερίδιο ΔΑΚ | |
| | Ημερομηνία αποκοπής μερίσματος | Η ημερομηνία αποκοπής του μερίσματος | |

Σχόλια

- (1): Αριθμός Μεριδίων (T) = Αριθμός Μεριδίων (T-1) + Αριθμός νεοεκδοθέντων μεριδίων (T-1) - Αριθμός εξαγορασθέντων μεριδίων (T-1).
- (2): Περιλαμβάνονται και τα μερίδια που δημιουργήθηκαν/ εξαγοράσθηκαν την ημέρα T-1.

1.1.1.3 Σύνθεση Ενεργητικού

Το παρακάτω αρχείο παρουσιάζει την σύνθεση του ενεργητικού του ΔΑΚ. Υπολογίζεται μετά το πέρας της συνεδρίασης της ημέρας T-1 και αποστέλλεται από την Εταιρία Διαχείρισης σε καθημερινή βάση.

| A/A | Στοιχείο | Περιγραφή | Σχόλια |
|-----|--------------------------------|---|--------|
| | Ημερομηνία | Η ημέρα συναλλαγών T | |
| | Σύμβολο ΔΑΚ (ελληνικό) | Το ελληνικό σύμβολο του ΔΑΚ | |
| | Σύμβολο ΔΑΚ (αγγλικό) | Το αγγλικό σύμβολο του ΔΑΚ | |
| | ISIN ΔΑΚ | Το ISIN του ΔΑΚ | |
| | Εταιρία Διαχείρισης | Η Εταιρία Διαχείρισης του ΔΑΚ | |
| | Σύμβολο Δείκτη (ελληνικό) | Το ελληνικό σύμβολο του Δείκτη που παρακολουθεί το ΔΑΚ | |
| | Σύμβολο Δείκτη (αγγλικό) | Το αγγλικό σύμβολο του Δείκτη | |
| | ISIN Δείκτη | Το ISIN του Δείκτη | |
| | Σύμβολο αξίας (i) (ελληνικό) | Το ελληνικό σύμβολο της αξίας (i) που συμμετέχει στη διαμόρφωση του ενεργητικού | |
| | Σύμβολο αξίας (i) (αγγλικό) | Το αγγλικό σύμβολο της αξίας (i) που συμμετέχει στη διαμόρφωση του ενεργητικού | |
| | ISIN αξίας (i) | Το ISIN της αξίας (i) που συμμετέχει στη διαμόρφωση του ενεργητικού | |
| | Ποσότητα (i) | Η ποσότητα της αξίας (i) | |
| | Τιμή αξίας (i) | Η τιμή της αξίας (i) για την αποτίμηση | (1) |
| | Μετρητά στο σύνολο ενεργητικού | Το ποσό των μετρητών που συμμετέχει στο συνολικό ενεργητικό. | |

Σχόλια

- (1): Η αποτίμηση θα γίνεται με την Τιμή Κλεισίματος της ημέρας T-1 της αξίας (i).

1.1.1.4 Δημιουργία - Εξαγορά

Το παρακάτω αρχείο παρουσιάζει τη σύνθεση του χαρτοφυλακίου που θα παραδοθεί/ παραληφθεί κατά τη διαδικασία δημιουργίας/ εξαγοράς μιας μονάδας δημιουργίας/εξαγοράς (creation/redemption unit). Η σύνθεση του χαρτοφυλακίου δημιουργίας/ εξαγοράς προσδιορίζεται μετά το πέρας της συνεδρίασης της ημέρας T-1 και εφαρμόζεται για τη δημιουργία/ εξαγορά της ημέρας T.

| A/A | Στοιχείο | Περιγραφή | Σχόλια |
|------------|---|---|---------------|
| | Ημερομηνία | Η ημέρα συναλλαγών T | |
| | Σύμβολο ΔΑΚ (ελληνικό) | Το ελληνικό σύμβολο του ΔΑΚ | |
| | Σύμβολο ΔΑΚ (αγγλικό) | Το αγγλικό σύμβολο του ΔΑΚ | |
| | ISIN ΔΑΚ | Το ISIN του ΔΑΚ | |
| | Εταιρία Διαχείρισης | Η Εταιρία Διαχείρισης του ΔΑΚ | |
| | Σύμβολο Δείκτη (ελληνικό) | Το ελληνικό σύμβολο του Δείκτη που παρακολουθεί το ΔΑΚ | |
| | Σύμβολο Δείκτη (αγγλικό) | Το αγγλικό σύμβολο του Δείκτη | |
| | ISIN Δείκτη | Το ISIN του Δείκτη | |
| | Σύμβολο αξίας (i) (ελληνικό) | Το ελληνικό σύμβολο της αξίας (i) που συμμετέχει στη διαμόρφωση του χαρτοφυλακίου | |
| | Σύμβολο αξίας (i) (αγγλικό) | Το αγγλικό σύμβολο της αξίας (i) που συμμετέχει στη διαμόρφωση του χαρτοφυλακίου | |
| | ISIN αξίας (i) | Το ISIN της αξίας (i) που συμμετέχει στη διαμόρφωση του χαρτοφυλακίου | |
| | Ποσότητα (i) | Η ποσότητα της αξίας (i) | |
| | Μετρητά στη Μονάδα Δημιουργίας/Εξαγοράς | Το ποσό των μετρητών που συμμετέχει στη Μονάδα δημιουργίας/εξαγοράς. | |

1.1.1.5 Αποδόσεις ΔΑΚ

Τα παρακάτω υπολογίζονται μετά την παρέλευση 26 εβδομάδων από την ημέρα της πρώτης έκδοσης.

| A/A | Στοιχείο | Περιγραφή | Σχόλια |
|------------|------------------------|-----------------------------|---------------|
| | Ημερομηνία | Η ημέρα συναλλαγών T | |
| | Σύμβολο ΔΑΚ (ελληνικό) | Το ελληνικό σύμβολο του ΔΑΚ | |
| | Σύμβολο ΔΑΚ (αγγλικό) | Το αγγλικό σύμβολο του ΔΑΚ | |
| | ISIN ΔΑΚ | Το ISIN του ΔΑΚ | |

| A/A | Στοιχείο | Περιγραφή | Σχόλια |
|-----|----------------------------|---|--------|
| | Σύμβολο Δείκτη (ελληνικό) | Το ελληνικό σύμβολο του Δείκτη που παρακολουθεί το ΔΑΚ | |
| | Σύμβολο Δείκτη (αγγλικό) | Το αγγλικό σύμβολο του Δείκτη που παρακολουθεί το ΔΑΚ | |
| | ISIN Δείκτη | Το ISIN του Δείκτη | |
| | Εταιρία Διαχείρισης | Η Εταιρία Διαχείρισης του ΔΑΚ | |
| | Ημ/νία Έναρξης Υπολογισμού | Η αρχή του χρονικού διαστήματος για τον υπολογισμό των αποδόσεων. | |
| | Ημ/νία Λήξης Υπολογισμού | Η λήξη του χρονικού διαστήματος για τον υπολογισμό των αποδόσεων. | |
| | N | Ο αριθμός των εβδομάδων που λαμβάνονται υπόψη στα στατιστικά μεγέθη των αποδόσεων. | (1) |
| | TA | Η τυπική απόκλιση της διαφοράς μεταξύ της απόδοσης του ΔΑΚ και της απόδοσης του χρηματιστηριακού δείκτη που αναπαράγουν (tracking error). | (1) |
| | Re | Η διαφορά της απόδοσης κατά την τελευταία εβδομάδα υπολογισμού μεταξύ του ΔΑΚ και του χρηματιστηριακού δείκτη αναφοράς. | (1) |
| | \bar{R} | Η μέση εβδομαδιαία διαφορά απόδοσης ΔΑΚ και Δείκτη για διάστημα N εβδομάδων. | (1) |
| | $\bar{R} * N$ | Η διαφορά της απόδοσης μεταξύ του ΔΑΚ και του χρηματιστηριακού δείκτη αναφοράς για περίοδο N εβδομάδων. | (1) |

1.1.2 Στοιχεία Συναλλαγών

Τα παρακάτω στοιχεία προκύπτουν από το σύστημα συναλλαγών ΟΑΣΗΣ και δημοσιεύονται στο Ημερήσιο Δελτίο Τιμών, στην ιστοσελίδα του ΧΑ και σε άλλα στατιστικά δελτία.

1.1.2.1 Διαπραγμάτευση

| A/A | Στοιχείο | Περιγραφή | Σχόλια |
|-----|---------------------------|--|--------|
| | Ημερομηνία | Η ημέρα συναλλαγών T | |
| | Σύμβολο ΔΑΚ (ελληνικό) | Το ελληνικό σύμβολο του ΔΑΚ | |
| | Σύμβολο ΔΑΚ (αγγλικό) | Το αγγλικό σύμβολο του ΔΑΚ | |
| | ISIN ΔΑΚ | Το ISIN του ΔΑΚ | |
| | Εταιρία Διαχείρισης | Η Εταιρία Διαχείρισης του ΔΑΚ | |
| | Σύμβολο Δείκτη (ελληνικό) | Το ελληνικό σύμβολο του Δείκτη που παρακολουθεί το ΔΑΚ | |
| | Σύμβολο Δείκτη (αγγλικό) | Το αγγλικό σύμβολο του Δείκτη | |
| | ISIN Δείκτη | Το ISIN του Δείκτη | |

| A/A | Στοιχείο | Περιγραφή | Σχόλια |
|------------|--|---|---------------|
| | Αριθμός Εισηγμένων Μεριδίων | | |
| | Ονομαστική Τιμή | Η τιμή του μεριδίου κατά την πρώτη έκδοση του ΔΑΚ | |
| | Μερίσματα ανά μερίδιο | Μερίσματα ανά μερίδιο Χ-1 έτους (Χ: τρέχουσα χρήση) | |
| | Μερίσματα ανά μερίδιο | Μερίσματα ανά μερίδιο Χ-2 έτους (Χ: τρέχουσα χρήση) | |
| | Μερίσματα ανά μερίδιο | Μερίσματα ανά μερίδιο Χ-3 έτους (Χ: τρέχουσα χρήση) | |
| | Ημ/νία Τελευταίας Αποκοπής Μερίσματος | | |
| | Ημ/νία Τελευταίας Αποκοπής Δικαιώματος | | |
| | Τιμή Κλεισίματος | | |
| | Ποσοστιαία Μεταβολή Τιμής | | |
| | Τελευταία Τιμή και Ημ/νία προηγούμενης συνεδρίασης | | |
| | Τιμή Ανοίγματος | | |
| | Κατώτερη Τιμή | | |
| | Ανώτερη Τιμή | | |
| | Τελευταία Τιμή | | |
| | Μέση Σταθμική Τιμή | Μέση σταθμική τιμή με βάση τον όγκο συναλλαγών. | |
| | Τιμή Τελευταίας Ζήτησης | | |
| | Τεμάχια Τελευταίας Ζήτησης | | |
| | Τιμή Τελευταίας Προσφοράς | | |
| | Τεμάχια Τελευταίας Προσφοράς | | |
| | Συναλλαγές σε Τεμάχια | | |
| | Αριθμός Πράξεων | | |
| | Αξία Συναλλαγών | | |
| | Αξία Ενεργητικού | Η καθαρή αξία ενεργητικού (NAV). | |
| | Κεφαλαιοποίηση | Το γινόμενο των εισηγμένων μεριδίων * την τιμή κλεισίματος του ΔΑΚ. | |
| | Κατώτερη Τιμή (από αρχή έτους) | | |
| | Ανώτερη Τιμή (από αρχή έτους) | | |

1.1.2.2 Προσυμφωνημένες Συναλλαγές

| A/A | Στοιχείο | Περιγραφή | Σχόλια |
|------------|---------------------------|--|---------------|
| | Ημερομηνία | Η ημέρα συναλλαγών T | |
| | Σύμβολο ΔΑΚ (ελληνικό) | Το ελληνικό σύμβολο του ΔΑΚ | |
| | Σύμβολο ΔΑΚ (αγγλικό) | Το αγγλικό σύμβολο του ΔΑΚ | |
| | ISIN ΔΑΚ | Το ISIN του ΔΑΚ | |
| | Εταιρία Διαχείρισης | Η Εταιρία Διαχείρισης του ΔΑΚ | |
| | Σύμβολο Δείκτη (ελληνικό) | Το ελληνικό σύμβολο του Δείκτη που παρακολουθεί το ΔΑΚ | |
| | Σύμβολο Δείκτη (αγγλικό) | Το αγγλικό σύμβολο του Δείκτη | |
| | ISIN Δείκτη | Το ISIN του Δείκτη | |
| | Ποσότητα Συναλλαγής | Η ποσότητα μεριδίων ΔΑΚ της προσυμφωνημένης συναλλαγής | |
| | Τιμή Συναλλαγής | Η τιμή μεριδίου ΔΑΚ της προσυμφωνημένης συναλλαγής | |
| | Αξία Συναλλαγής | Η αξία της προσυμφωνημένης συναλλαγής | |
| | Ώρα Έγκρισης | Η ώρα έγκρισης της προσυμφωνημένης συναλλαγής | |

1.1.2.3 Ανοικτές Πωλήσεις

| A/A | Στοιχείο | Περιγραφή | Σχόλια |
|------------|---|---|---------------|
| | Ημερομηνία | Η ημέρα συναλλαγών T | |
| | Σύμβολο ΔΑΚ (ελληνικό) | Το ελληνικό σύμβολο του ΔΑΚ | |
| | Σύμβολο ΔΑΚ (αγγλικό) | Το αγγλικό σύμβολο του ΔΑΚ | |
| | ISIN ΔΑΚ | Το ISIN του ΔΑΚ | |
| | Εταιρία Διαχείρισης | Η Εταιρία Διαχείρισης του ΔΑΚ | |
| | Σύμβολο Δείκτη (ελληνικό) | Το ελληνικό σύμβολο του Δείκτη που παρακολουθεί το ΔΑΚ | |
| | Σύμβολο Δείκτη (αγγλικό) | Το αγγλικό σύμβολο του Δείκτη | |
| | ISIN Δείκτη | Το ISIN του Δείκτη | |
| | Αξία συναλλαγών ανοικτών πωλήσεων | | |
| | Όγκος συναλλαγών ανοικτών πωλήσεων | | |
| | % ανοικτών πωλήσεων στον συνολικό όγκο | Συμμετοχή ανοικτών πωλήσεων στον συνολικό όγκο συναλλαγών (περιλαμβάνονται και τα πακέτα) | |
| | Αξία συναλλαγών για κλείσιμο θέσης ανοικτής πώλησης | | |

| A/A | Στοιχείο | Περιγραφή | Σχόλια |
|-----|---|---|--------|
| | Όγκος συναλλαγών για κλείσιμο θέσης ανοικτής πώλησης | | |
| | % κλείσιμο θέσης ανοικτών πωλήσεων στον συνολικό όγκο | Συμμετοχή κλεισίματος θέσης ανοικτών πωλήσεων στον συνολικό όγκο συναλλαγών (περιλαμβάνονται και τα πακέτα) | |

1.1.2.4 Εκποιήσεις

| A/A | Στοιχείο | Περιγραφή | Σχόλια |
|-----|---------------------------|--|--------|
| | Ημερομηνία | Η ημέρα συναλλαγών T | |
| | Σύμβολο ΔΑΚ (ελληνικό) | Το ελληνικό σύμβολο του ΔΑΚ | |
| | Σύμβολο ΔΑΚ (αγγλικό) | Το αγγλικό σύμβολο του ΔΑΚ | |
| | ISIN ΔΑΚ | Το ISIN του ΔΑΚ | |
| | Εταιρία Διαχείρισης | Η Εταιρία Διαχείρισης του ΔΑΚ | |
| | Σύμβολο Δείκτη (ελληνικό) | Το ελληνικό σύμβολο του Δείκτη που παρακολουθεί το ΔΑΚ | |
| | Σύμβολο Δείκτη (αγγλικό) | Το αγγλικό σύμβολο του Δείκτη | |
| | ISIN Δείκτη | Το ISIN του Δείκτη | |
| | Όγκος Συναλλαγών | Όγκος συναλλαγών σε τεμάχια | |
| | Αριθμός Συναλλαγών | | |
| | Αξία Συναλλαγών | Αξία συναλλαγών (ευρώ) | |
| | Κατώτερη Τιμή | | |
| | Ανώτερη Τιμή | | |
| | Τελευταία Τιμή | | |
| | Μέση Σταθμική | Μέση σταθμισμένη τιμή με βάση τον όγκο συναλλαγών | |

1.2 Σύστημα Συναλλαγών ΟΑΣΗΣ

Το σύστημα συναλλαγών ΟΑΣΗΣ θα διαχέει στα Μέλη του ΧΑ και στους Προμηθευτές Πληροφόρησης τα εξής:

- Τιμή ΔΑΚ, όπως αυτή διαμορφώνεται κατά τη συνεδρίαση.
- Τιμή Δείκτη που παρακολουθεί το ΔΑΚ
- Αριθμός Μεριδίων
- Τιμή NAV/ μερίδιο (Net Assets Value per unit – NAV/unit)
- Τιμή iNAV (indicative NAV/unit). Το iNAV υπολογίζεται κατά διάρκεια υπολογισμού του συνδεδεμένου δείκτη ανά 30'' με βάση τον παρακάτω τύπο:

$$iNAV_t = NAV / unit_o * \left(\frac{IV_t}{IV_o} \right)$$

όπου:

$iNAV_t$, η ενδεικτική καθαρή αξία ενεργητικού μεριδίου τη χρονική στιγμή t της συνεδρίασης της ημέρας T

$NAV / unit_o$, η καθαρή αξία ενεργητικού μεριδίου την οποία υπολογίζει και δημοσιεύει η εταιρία διαχείρισης καθημερινά μετά το πέρας της συνεδρίασης της ημέρας T-1

IV_t , η τιμή του δείκτη στον οποίο αναφέρεται το διαπραγματεύσιμο αμοιβαίο κεφάλαιο τη χρονική στιγμή t της συνεδρίασης της ημέρας T, και

IV_o , η τιμή κλεισίματος του δείκτη στον οποίο αναφέρεται το διαπραγματεύσιμο αμοιβαίο κεφάλαιο που προέκυψε από τη συνεδρίαση της ημέρας T-1

1.3 Σύστημα ΕΡΜΗΣ

Όπως είναι γνωστό από το 2002 είναι σε λειτουργία το σύστημα ΕΡΜΗΣ (H.E.R.M.E.S. - Hellenic Exchanges Remote Messaging Services) που αφορά την επικοινωνία του ΧΑ με τις Εισηγμένες Εταιρίες. Είναι ένα σύστημα ηλεκτρονικής διασύνδεσης και επικοινωνίας του ΧΑ με τις εισηγμένες εταιρίες μέσω του διαδικτύου (Internet). Το σύστημα ΕΡΜΗΣ έχει συμβάλει στην ταχύτερη και εγκυρότερη ενημέρωση του επενδυτικού μέσω της χρήσης ηλεκτρονικής επικοινωνίας που διασφαλίζει την ασφάλεια, την αξιοπιστία αλλά και την ταχύτητα.

Το σύστημα ΕΡΜΗΣ θα χρησιμοποιηθεί για την επικοινωνία του ΧΑ με τις Εταιρίες Διαχείρισης ΔΑΚ. Τα στοιχεία ΔΑΚ των παρ. 1.1.1, 1.1.1.2, 1.1.1.3 και 1.1.1.4 (εκτός δηλαδή τα στοιχεία συναλλαγών που θα προκύπτουν από το σύστημα ΟΑΣΗΣ) θα αποτελέσουν αντικείμενο αυτής της ηλεκτρονικής επικοινωνίας.



Χρηματιστήριο Αθηνών Α.Ε.

Λεωφόρος Αθηνών 110, 104 42 Αθήνα

www.athex.gr