

Χρονισμοί Εκκαθάρισης και Διακανονισμού για την Αγορά Παραγώγων του Χ.Α. και του ΕΧΕ

Διαδικασίες Εκκαθάρισης	Χρονισμοί
Δυνατότητα δέσμευσης Κινητών Αξιών προς δανεισμό από το Εκκαθαριστικό Μέλος	9:00 έως 20:00
Δυνατότητα δέσμευσης Κινητών Αξιών προς δανεισμό από το Εκκαθαριστικό Μέλος ώστε αυτές να συμμετέχουν στον υπολογισμό των Εντολών Δανειοδοσίας (Συγκεντρωτικές Εντολές Δανειοδοσίας) για την ίδια ημέρα.	9:00 έως 10:00
Δυνατότητα αποδέσμευσης Κινητών Αξιών από το Εκκαθαριστικό Μέλος σε Εντολή Δανειοδοσίας της οποίας οι Κινητές Αξίες δεν έχουν δανειστεί.	9:00 έως 10:00
Καταβολή των απαιτούμενων ποσών για τον ημερήσιο χρηματικό διακανονισμό από το Εκκαθαριστικό Μέλος. (Αναλυτικό χρονοδιάγραμμα Target2 https://athexgroup.gr/el/post-trade/csd/services/settlement-services/cash)	9:30 έως 9:45
Καταβολή του απαιτούμενου Περιθωρίου ασφάλισης (margin) για την προηγούμενη ημέρα συνεδρίασης από το Εκκαθαριστικό Μέλος (Αναλυτικό χρονοδιάγραμμα Target2 https://athexgroup.gr/el/post-trade/csd/services/settlement-services/cash)	9:30 έως 10:00
Υπολογισμός των Εντολών Διάθεσης Δανεισμού	10:00 έως 10:14
Αποδέσμευση των Κινητών Αξιών από το Σύστημα σε Εντολή Δανειοδοσίας της οποίας οι Κινητές Αξίες δεν έχουν δανειστεί και η ημερομηνία λήξης της Εντολής ταυτίζεται με την τρέχουσα.	10:00
Εισαγωγή εντολών Διάθεσης Δανεισμού από ΕΤΕΚ στο Σύστημα Διαπραγμάτευσης	10:15
Κύκλοι διακανονισμού για SF / SO στο ΕΣ ΕΛΚΑΤ στο Target2 (Αναλυτικό χρονοδιάγραμμα Target2 https://athexgroup.gr/el/post-trade/csd/services/settlement-services/cash)	10:00 έως 16:15
Λήξη προθεσμίας Γνωστοποίησης για συναλλαγές SF / SO	16:15
Τελευταίος κύκλος διακανονισμού για συναλλαγές SF / SO Η αρμόδια υπηρεσία της ΕΤ.ΕΚ δύναται να διενεργεί και έκτακτους κύκλους διακανονισμού εκτός του άνω ωραρίου.	16:15
Φόρτωση συναλλαγών από το Σύστημα Διαπραγμάτευσης στο Σ.Ε. σε πραγματικό χρόνο	10:10 έως 17:20

Δυνατότητα άσκησης από Δανειστή

10:15 έως 15:20 (μέχρι
και δύο ώρες πριν τη
λήξη της συνεδρίασης)

Διαδικασίες Εκκαθάρισης	Χρονισμοί
Δυνατότητα δέσμευσης Κινητών Αξιών υπέρ ET.EK	9:00 έως 18:00
Δυνατότητα αποδέσμευσης Κινητών Αξιών υπέρ ET.EK	10:00 έως 18:00
Δυνατότητα κατάθεσης μετρητών για κάλυψη απαιτήσεων Περιθωρίου ασφάλισης καθώς και για αύξηση Πιστωτικού Ορίου. (Αναλυτικό χρονοδιάγραμμα Target2 https://athexgroup.gr/el/post-trade/csd/services/settlement-services/cash)	9:00 έως 17:00
Δυνατότητα αίτησης επιστροφής ασφαλειών με τη μορφή μετρητών	9:00 έως 17:00
Λήξη δυνατότητας καταχώρισης ειδικής σήμανσης για real time διακανονισμό σε Συμβάσεις Δανεισμού Τίτλων. Η αρμόδια υπηρεσία της ET.EK δύναται να μεταθέσει τον ως άνω χρονισμό.	17:20
Ενδοημερήσιος υπολογισμός κινδύνου ανά Λογαριασμό Εκκαθάρισης. Κύκλοι υπολογισμού κινδύνου εκτελούνται ενδεικτικά ανά 5 λεπτά.	10:30 έως 17:20
Δυνατότητα εξασκήσεως σε δικαιώματα προαίρεσης επί μετοχών καθώς και ακυρώσεις των αιτήσεων εξάσκησης	17:50 (μέχρι και τριάντα (30) λεπτά μετά τη λήξη της συνεδρίασης)
Δυνατότητα εξασκήσεως από δανειζόμενο καθώς και ακυρώσεις των αιτήσεων εξάσκησης.	17:50 (μέχρι και τριάντα (30) λεπτά μετά τη λήξη της συνεδρίασης)
Δυνατότητα εξασκήσεως από δανειστή και δανειζόμενο σε προσυμφωνημένες συναλλαγές (RA) καθώς και ακυρώσεις των αιτήσεων εξάσκησης.	17:50 (μέχρι και τριάντα (30) λεπτά μετά τη λήξη της συνεδρίασης)
Δημιουργία δομής από το Εκκαθαριστικό Μέλος για την καταχώριση και παρακολούθηση μέσω του ΟΑΣΗΣ των Πιστωτικών Ορίων.	9:00 έως 17:20

Γνωστοποίηση των προς εκκαθάριση συναλλαγών μετά τη λήξη της συνεδρίασης της Αγοράς από το Διαχειριστή Αγοράς στην ΕΤ.ΕΚ.

Στη συνέχεια η ΕΤ.ΕΚ σηματοδοτεί την έναρξη των παρακάτω διαδικασιών εκκαθάρισης:

17:30

Διάρθρωση από Μέλος Διαπραγμάτευσης (ΜΔ)

- Διάσπαση και καταχώρηση των ορθών κωδικών διαπραγμάτευσης και ποσοτήτων στις συναλλαγές.
- Διορθώσεις λαθών στον Κωδικό Διαπραγμάτευσης ή και στον Υπολογαριασμό Εκκαθάρισης.

17:30 έως 18:00

(έως και τριάντα (30) λεπτά μετά την έναρξη των διαδικασιών εκκαθάρισης)

Διαδικασίες Εκκαθάρισης

Χρονισμοί

Κλείδωμα από την ΕΤ.ΕΚ της δυνατότητας διάρθρωσης από τα Μέλη Διαπραγμάτευσης

18:00

(τριάντα (30) λεπτά μετά την έναρξη των διαδικασιών εκκαθάρισης)

Διάρθρωση από Εκκαθαριστικό Μέλος (ΕΜ)

- Διάσπαση και καταχώρηση των ορθών Λογαριασμών Θέσης και ποσοτήτων στις συναλλαγές.
- Διορθώσεις λαθών στον Λογαριασμό Θέσης ή και στον Υπολογαριασμό – Λογαριασμό Εκκαθάρισης του ίδιου ΕΜ.

17:30 έως 18:15

(έως και σαράντα πέντε (45) λεπτά μετά την έναρξη των διαδικασιών εκκαθάρισης)

* Αν το ΕΜ κάνει μεταβολή σε κάποια συναλλαγή, αυτομάτως το ΜΔ δεν θα μπορεί να την τροποποιήσει.

** Ένα ΕΜ μπορεί να κλειδώσει όλες ή κάποιες συναλλαγές ενός ΜΔ.

Μετάθεση εκκαθάρισης και αποδοχή μετάθεσης από Εκκαθαριστικό Μέλος

17:30 έως 18:15

(έως και σαράντα πέντε (45) λεπτά μετά την έναρξη των διαδικασιών εκκαθάρισης)

Κλείδωμα από την ΕΤ.ΕΚ της δυνατότητας διάρθρωσης από τα Εκκαθαριστικά Μέλη

18:15

(σαράντα πέντε (45) λεπτά μετά την έναρξη των διαδικασιών εκκαθάρισης)

Δυνατότητα αίτησης μεταφοράς θέσεων από ένα Εκκαθαριστικό Μέλος σε ένα άλλο καθώς και αποδοχή των αιτήσεων μεταφοράς από άλλα Εκκαθαριστικά Μέλη.	10:15 έως 18:15 (έως και σαράντα πέντε (45) λεπτά μετά την έναρξη των διαδικασιών εκκαθάρισης)
Δυνατότητα μεταφοράς θέσεων από ένα Υπολογρισμό Εκκαθάρισης σε έναν άλλο του ίδιου του Εκκαθαριστικού Μέλους που αιτήθηκε τη μεταφορά θέσης.	10:15 έως 18:15 (έως και σαράντα πέντε (45) λεπτά μετά την έναρξη των διαδικασιών εκκαθάρισης)
Δυνατότητα μεταφοράς θέσεων δανειοδοσίας σε άλλο Εκκαθαριστικό Μέλος.	9:00 έως 18:15 (έως και σαράντα πέντε (45) λεπτά μετά την έναρξη των διαδικασιών εκκαθάρισης)

Διαδικασίες Εκκαθάρισης	Χρονισμοί
Οριστικοποίηση των μεταφορών θέσεων	18:15 (σαράντα πέντε (45) λεπτά μετά την έναρξη των διαδικασιών εκκαθάρισης)
Οριστικοποίηση των προς εκκαθάριση συναλλαγών	18:15 (σαράντα πέντε (45) λεπτά μετά την έναρξη των διαδικασιών εκκαθάρισης)
Αλλαγή του τρόπου υπολογισμού του περιθωρίου ασφάλισης Λογαριασμού Εκκαθάρισης Πελατείας από συμψηφισμένο (Net) σε ακαθάριστο (Gross) και αντίστροφα, μετά από αίτηση του Εκκαθαριστικού Μέλους προς την ET.EK.	18:15 (μετά την οριστικοποίηση των προς εκκαθάριση συναλλαγών και πριν τον υπολογισμό των απαιτήσεων παροχής Περιθωρίου ασφάλισης)

Επιστροφή από το δανειζόμενο στην ΕΤ.ΕΚ, των Κινητών Αξιών, που παραδίδονται πριν από την κανονική ημέρα επιστροφής (δηλαδή πριν την τρίτη (3η) ημέρα από την ημέρα άσκησης).

18:15 έως 18:30

(έως και μια (1) ώρα μετά την έναρξη των διαδικασιών εκκαθάρισης)

-
- Επιστροφή στους δανειστές από την ΕΤ.ΕΚ, των Κινητών Αξιών που παραδόθηκαν από τους δανειζόμενους.
 - Παράδοση στους δανειζόμενους από την ΕΤ.ΕΚ των Κινητών Αξιών.

18:30 έως 18:45

(έως και μια (1) ώρα και δεκαπέντε (15) λεπτά μετά την έναρξη των διαδικασιών εκκαθάρισης)

-
- Υπολογισμός ημερήσιου χρηματικού διακανονισμού και προμηθειών (Mark To Market, Mark To Trade, Υπολογισμός του εσόδου στους δανειστές, Υπολογισμός των τόκων δανειοληψίας)
 - Διαδικασία καταμερισμού (cascading) των θέσεων επί Παραγώγων του ΕΧΕ σύμφωνα με τα προβλεπόμενα στα χαρακτηριστικά εισαγωγής των σχετικών Παραγώγων. Η παραπάνω διαδικασία αναπροσαρμογής των θέσεων πραγματοποιείται πριν τον υπολογισμό των απαιτήσεων Περιθωρίου ασφάλισης
 - Αποτίμηση των ασφαλειών
 - Υπολογισμός των απαιτήσεων παροχής Περιθωρίου ασφάλισης
 - Υπολογισμός και παρακολούθηση των Πιστωτικών ορίων

18:15 έως 18:45

(έως και μια (1) ώρα και δεκαπέντε (15) λεπτά μετά την έναρξη των διαδικασιών εκκαθάρισης)

Διαδικασίες Εκκαθάρισης**Χρονισμοί**

Δήλωση και κατανομή σε Υπολογαριασμούς Εκκαθάρισης και Μέλη Διαπραγμάτευσης του διαθέσιμου Πιστωτικού Ορίου από το Εκκαθαριστικό Μέλος.

18:45 έως 20:00