



ATHEXCLEAR
Εκκαθάριση Συναλλαγών

ΑΠΟΦΑΣΗ 7

«Ετήσια επανεξέταση των διαδικασιών αντιμετώπισης καταστάσεων αθέτησης υποχρεώσεων Εκκαθαριστικού Μέλους¹»

Κωδικοποιημένη μετά τις από 12.3.2020 και 31.01.2022 αποφάσεις του Διοικητικού Συμβουλίου.

ΤΟ ΔΙΟΙΚΗΤΙΚΟ ΣΥΜΒΟΥΛΙΟ

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

(Συνεδρίαση 11/11/2014)

Αφού έλαβε υπόψη

- α. Το άρθρο 58 του κατ' εξουσιοδότηση Κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 153/2013 της Επιτροπής
- β. Τις διατάξεις περί υπερημερίας Μέλους των Κανονισμών Εκκαθάρισης Συναλλαγών επί Παραγώγων και Εκκαθάρισης Συναλλαγών επί **Αξιογράφων** σε Λογιστική Μορφή²

ΑΠΟΦΑΣΙΖΕΙ ΩΣ ΕΞΗΣ

Η ΕΤ.ΕΚ ελέγχει και επανεξετάζει τις διαδικασίες που ακολουθούνται σε περίπτωση αθέτησης υποχρέωσης Μέλους προκειμένου να διασφαλίσει ότι είναι εφικτές και αποτελεσματικές. Για το σκοπό αυτό εκτελεί άσκηση προσομοίωσης των διαδικασιών αυτών σε ετήσια βάση με πρώτη εκτέλεση τον Ιούνιο του 2015.

Μετά την εκτέλεση της άσκησης, αξιολογεί τα αποτελέσματα και επισημαίνει τυχόν αβεβαιότητες ή αστοχίες και προσαρμόζει καταλλήλως τις διαδικασίες της.

Τα Εκκαθαριστικά Μέλη, οι πελάτες, αλλά και όλοι οι εμπλεκόμενοι στην εκκαθάριση φορείς ενημερώνονται και συμμετέχουν στην εκτέλεση των παραπάνω ασκήσεων προσομοίωσης ώστε να εξασφαλίζεται ότι γνωρίζουν επακριβώς και μπορούν να εκτελέσουν με επιτυχία τις διαδικασίες για

την περίπτωση αθέτησης υποχρέωσης. Η σχετική ενημέρωση διενεργείται από την ΕΤ.ΕΚ. σύμφωνα με τις διαδικασίες της³.

Οι ασκήσεις προσομοίωσης θα πρέπει να περιλαμβάνουν κατ' ελάχιστο ένα σενάριο κατά το οποίο ένα Εκκαθαριστικό Μέλος είναι υπερήμερο, και η ΕΤ.ΕΚ μεριμνά:

α. Για τη μεταφορά των θέσεων και των ασφαλειών των Λογαριασμών Εκκαθάρισης Πελατείας και των Λογαριασμών Εκκαθάρισης Πελάτη του υπερήμερου Εκκαθαριστικού Μέλους σε άλλο Εκκαθαριστικό Μέλος που έχει δηλωθεί.

β. Για το κλείσιμο ή την εξισορρόπηση των θέσεων των υπολοίπων Λογαριασμών Εκκαθάρισης.⁴

Οι αναφορές με τα αποτελέσματα των ασκήσεων κοινοποιούνται στην Επιτροπή Κινδύνου και την Επιτροπή Κεφαλαιαγοράς.

Ισχύς

1. Η παρούσα απόφαση ισχύει από την 1^η Δεκεμβρίου 2014.
2. Η παρούσα να δημοσιευτεί στην ιστοσελίδα της ΕΤ.ΕΚ.

¹ Ο τίτλος αντικαταστάθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 183/12.3.2020 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ και ισχύει από 16.3.2020.

² Ο όρος «κινητή αξία» αντικαθίσταται από τον όρο «Αξιόγραφο» ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 215/31.01.2022 Απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ και ισχύει από 01.02.2022.

³ Το τελευταίο εδάφιο της 3^{ης} παραγράφου προστέθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 183/12.3.2020 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ και ισχύει από 16.3.2020.

⁴ Η 4^η παράγραφος προστέθηκε ως ανωτέρω με την υπ' αριθμ. 183/12.3.2020 απόφαση του Δ.Σ. της ΕΤ.ΕΚ και ισχύει από 16.3.2020.