

Ημερομηνία: 01/07/2016

Θέμα: Διαχείριση εταιρικής πράξης «Επιστροφή Κεφαλαίου» της εταιρίας «ΕΛΛΗΝΙΚΑ ΧΡΗΜΑΤΙΣΤΗΡΙΑ Α.Ε. ΣΥΜΜΕΤΟΧΩΝ ΕΚΚΑΘΑΡΙΣΗΣ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ & ΚΑΤΑΧΩΡΗΣΗΣ» στην Αγορά Παραγώγων του ΑΤΗΕΧ

Αποδέκτες: Μέλη αγοράς παραγώγων , Αναμεταδότες πληροφορίας

Ανακοίνωση

Το Χρηματιστήριο Αθηνών, κατόπιν της συνεδρίασης 30/06/2016 της Διοικούσας Επιτροπής του, γνωστοποίησε ότι θα υλοποιηθεί η ακόλουθη εταιρική πράξη:

Δευτέρα 4 Ιουλίου 2016

Έναρξη διαπραγμάτευσης των υφισταμένων μετοχών της εταιρίας «ΕΛΛΗΝΙΚΑ ΧΡΗΜΑΤΙΣΤΗΡΙΑ-ΧΡΗΜΑΤΙΣΤΗΡΙΟ ΑΘΗΝΩΝ Α.Ε. ΣΥΜΜΕΤΟΧΩΝ» (ISIN: GRS395363005) με τελική ονομαστική αξία μετοχής €1,08 και αποκοπή του δικαιώματος συμμετοχής στην επιστροφή κεφαλαίου ποσού €0,2275 ανά μετοχή, κατόπιν της μείωσης της ονομαστικής αξίας της μετοχής της εταιρίας. Ημερομηνία καταγραφής των δικαιούχων για την εν λόγω εταιρική πράξη είναι η Τρίτη 5 Ιουλίου 2016.

Στοιχεία εταιρικής πράξης

Εταιρική πράξη	Επιστροφή Κεφαλαίου
Υποκείμενη	GRS395363005
Ημερομηνία αποκοπής -1	01/07/2016
Τιμή κλεισίματος υποκείμενης την ημερομηνία αποκοπής -1	4,4
Ημερομηνία Αποκοπής	04/07/2016
Ημερομηνία δικαιούχων (RD)	05/07/2016
Καθαρό Ποσό Επιστροφής Κεφαλαίου (ανά μετοχή)	0,2275
Καθαρό Ποσό μερίσματος/Προμερίσματος (ανά μετοχή)	0

Προϊόντα που επηρεάζονται

Futures

Ενέργειες

Ο Όμιλος ΑΤΗΕΧ Group θα υποστηρίξει την παραπάνω εταιρική πράξη, σύμφωνα με όσα προβλέπονται από τα ισχύοντα χαρακτηριστικά των αντίστοιχων προϊόντων (Αποφάσεις ΑΤΗΕΧ 12 περί Συμβολαίων Μελλοντικής Εκπλήρωσης, 15 περί Δικαιωμάτων Προαίρεσης), όπως περιγράφεται παρακάτω:



ATHEXGROUP
Όμιλος Χρηματιστηρίου Αθηνών

Ημερομηνία X-Date-1 (01/07/2016)

Οι ακόλουθες προσαρμογές θα γίνουν μετά τη λήξη της εκκαθάρισης της Αγοράς Παραγώγων:

	Futures	Options
New Μέγεθος Συμβολαίου	$= \text{παλιό μέγεθος} \times \frac{\text{τιμή κλεισίματος (4,4)} - \text{μέρισμα(0)}}{\text{τιμή κλεισίματος (4,4)} - \text{μέρισμα(0)} - \text{επιστροφή κεφαλαίου (0,2275)}}$	
New Τιμή Εκκαθάρισης New Τιμή Εξάσκησης	$= \text{παλαιά τιμή} \times \frac{\text{τιμή κλεισίματος (4,4)} - \text{μέρισμα(0)} - \text{επιστροφή κεφαλαίου (0,2275)}}{\text{τιμή κλεισίματος (4,4)} - \text{μέρισμα(0)}}$	

Γενικές παρατηρήσεις

1. Το μέγεθος του συμβολαίου προσαρμόζεται για όλες τις σειρές μετά τη διαδικασία του series generation για τα ΔΠ
2. Δημιουργία νέων σειρών σε ΣΜΕ (με προσαρμοσμένη τιμή) πραγματοποιείται μετά τη λήξη της εκκαθάρισης της συνεδρίασης της X-Date-1 για τις λήξεις που έχουν ανοικτές θέσεις
3. Δημιουργία νέων σειρών σε ΔΠ (με προσαρμοσμένη τιμή εξάσκησης) πραγματοποιείται μετά τη λήξη της εκκαθάρισης της συνεδρίασης της X-Date-1 για τις λήξεις που έχουν ανοικτές θέσεις για **όλες** τις τιμές εξάσκησης που τους αντιστοιχούν
4. Η ονομασία των σειρών που προκύπτουν με νέο μέγεθος συμβολαίου έχουν διαφορετικό τελευταίο γράμμα στο συμβολισμό τους (X, Y, Z,Q) ενώ το issue modifier τους αυξάνεται κατά ένα (1) σε σχέση με τις αρχικές σειρές