

АД - 12 / 24.07.2017г.

БЪЛГАРСКА
НАРОДНА БАНКА
№ БНБ-122669/ 25-07-2017
София, ул. „Княз Александър I“ 1

ОДОБРИЛ:


.....
МИНИСТЪР НА ФИНАНСИТЕ



ОДОБРИЛ:


.....
УПРАВИТЕЛ НА
БЪЛГАРСКАТА НАРОДНА БАНКА



ПРАВИЛА

**ЗА ДОПУСКАНЕ ДО ТЪРГОВИЯ НА ДЦК НА РЕГУЛИРАН ПАЗАР,
ОРГАНИЗИРАН ОТ „БЪЛГАРСКА ФОНДОВА БОРСА–СОФИЯ“ АД
И ПРИКЛЮЧВАНЕ НА СДЕЛКИ С ТЯХ В БНБ, БАНКИ
ПОДДЕПОЗИТАРИ НА ДЦК И „ЦЕНТРАЛЕН ДЕПОЗИТАР“ АД**

Чл. 1. С настоящите правила се определят редът и условията за:

1. Допускане до търговия на регулиран пазар, организиран от „Българска фондова борса – София“ АД (БФБ), на държавни ценни книжа (ДЦК), емитирани от министъра на финансите на основание чл. 12, ал. 2 от Закона за държавния дълг (ЗДД) и Наредба № 5 от 4 октомври 2007 г. за реда и условията за придобиване, регистриране, изплащане и търговия с ДЦК (Наредба № 5);

2. Приключване на сделките с ДЦК, сключени на регулирания пазар, организиран от БФБ, в Електронната система за регистриране и обслужване на търговията с ДЦК (ЕСРОТ) и в Системата за сетълмент на ДЦК (СДЦК), поддържани от Българската народна банка (БНБ) на основание чл. 35, ал. 1, т. 2 и т. 3 от ЗДД, както и в сметките за ДЦК, водени от БНБ на основание чл. 43, ал. 3 от Закона за Българската народна банка и чл. 35, ал. 2 от ЗДД и в съответствие с разпоредбите на Наредба № 5, Наредба № 31 за сетълмент на държавни ценни книжа и Наредба № 15 за контрол върху сделките с държавни ценни книжа.

Чл. 2. (1) На регулирания пазар, организиран от БФБ, се допускат за търговия ДЦК, емитирани от министъра на финансите по реда на Наредба № 5, деноминирани в лева и в евро, които са регистрирани и се водят по сметки за ДЦК на участниците в изградените и оперирани от БНБ системи съгласно наредбата.

(2) За да бъдат допуснати до търговия на Сегмент за ДЦК на регулирания пазар, организиран от БФБ, емисиите ДЦК трябва да са в съответствие с чл. 3, ал.1 от Правилника за дейността на БФБ – Част IX, „Правила за регистрация и търговия на ДЦК“ (Правилника).

(3) Емисиите лихвоносни ДЦК трябва да отговарят и на допълнителни изисквания, съгласно чл. 3, ал.2 от Част IX от Правилника.

Чл. 3. Регистрацията на БФБ на емисиите ДЦК се извършва въз основа на договор, сключен между БФБ, в качеството ѝ на пазарен оператор, и Министерството на финансите (МФ), след подаване на заявление за допускане до търговия за всяка отделна емисия по реда на част IX от Правилника.

Чл. 4. На регулирания пазар, организиран от БФБ се сключват само сделки за покупко-продажба на ДЦК по чл. 16, ал. 1, т. 1 от Наредба № 5.

Чл. 5. Членовете на БФБ са длъжни да осигурят ДЦК, предмет на сделката и да я приключат на втория работен ден след сключването ѝ (Т+2), при параметрите, договорени на регулирания пазар, организиран от БФБ. Сделките се приключват на принципа „доставка срещу плащане“ (DVP), съгласно действащото законодателство.

Чл. 6.(1) След като бъде допуснат за участник в ЕСРОТ по реда на чл. 3, ал. 1, т. 5 от Наредба № 5, Централният депозитар АД (ЦД АД) води сметки, отчитащи притежаваните ДЦК от негови членове и техни клиенти, които не са участници в ЕСРОТ съгласно Правилника за дейността му и действащото законодателство.

(2) БНБ води индивидуални сметки, отчитащи притежаваните ДЦК от участниците в ЕСРОТ.

(3) За целите на търговията с ДЦК на регулирания пазар, организиран от БФБ, ЦД АД открива и поддържа сметки за ДЦК съгласно Правилника за дейността му и действащото законодателство.

Чл. 7.(1) Сделки за покупко-продажба на ДЦК, сключени на регулирания пазар, организиран от БФБ, се приключват:

1. Между участници в ЕСРОТ - въз основа на искания, отправени до БНБ по реда на чл. 17, ал. 2 от Наредба № 5 (Приложение № 10).

2. Между участници в ЕСРОТ и техни клиенти - въз основа на искания отправени до БНБ по реда на чл.20, ал.1 и ал.2 от Наредба № 5 (Приложения № № 11 и 12).

3. Между участници в ЕСРОТ и клиенти на други участници в ЕСРОТ - въз основа на искания, отправени до БНБ по реда на чл.20, ал.4 и ал.5 от Наредба № 5 (Приложения № № 15 и 16).

4. Между клиенти на различни участници в ЕСРОТ - въз основа на искания, отправени до БНБ по реда на чл.20, ал.7 от Наредба № 5 (Приложение № 18).

(2) В случай, че в исканията по ал. 1, т. 3 и т. 4 са посочени цена на сделката и наименование на член на БФБ, чиято сметка се води от ЦД АД или от друг участник в ЕСРОТ, посочените в исканията сметки за сетълмент на парични средства в РИНГС/ТАРГЕТ 2 се заверяват, съответно задължават.

Чл. 8. Сделки за покупко-продажба на ДЦК, сключени на регулирания пазар, организиран от БФБ между участници в ЕСРОТ и членове на БФБ, които не са участници в ЕСРОТ, могат да се приключват по един от следните начини:

1. В ЦД АД при спазване изискванията на Правилника за дейността му, след като участниците в ЕСРОТ прехвърлят/получат по сметки, открити в ЦД АД по реда на чл.6, ал. 3 само ДЦК, предмет на сделки в съответствие с чл. 17, ал. 2 от Наредба № 5 (Приложения № №10в и 10г).

2. В БНБ по реда на чл. 7, ал.1,т. 3 и т. 4 и на ал. 2.

Чл. 9. Приключването на сделки с ДЦК, сключени на регулирания пазар, организиран от БФБ между членове на БФБ, клиенти на един и същ участник в ЕСРОТ, се извършва във водената от участника система за регистрация на ДЦК и индивидуални сметки, отчитащи притежаваните ДЦК по реда на чл. 35, ал. 4 от ЗДД.

Чл. 10. При предстоящо лихвено плащане и/или падеж на ДЦК искания/уведомления за регистрация на сделки в ЕСРОТ се приемат до 12 ч. и се обработват до 13 ч. на системния ден на ЕСРОТ, предхождащ датата на сетълмент на падежа на съответната емисия ДЦК или на лихвените плащания по нея.

Чл. 11. (1) Въз основа на договор, сключен между БФБ и БНБ, БФБ ежедневно след приключване на всички търговски сесии изпраща до БНБ окончателен отчет за сключените през текущия ден сделки с ДЦК с изключение на тези, които следва да се приключат в ЦД АД. Отчетът съдържа следната информация:

- Дата на сключване на сделката – Т;
- Дата на сетълмента - Т+2;
- Номер на емисията на ДЦК (ISIN), предмет на сделката;
- Прехвърлител на ДЦК – борсов код и наименование;
- Приобретател на ДЦК – борсов код и наименование;
- Номинална стойност на прехвърляните ДЦК (цифром, с два знака след десетичната запетая);
- Цената, по която се прехвърлят/придобиват ДЦК (цифром, с два знака след десетичната запетая);

- Уникален идентификационен номер на сключената сделка, присвоен от БФБ.

(2) БФБ предоставя на участниците в ЕСРОТ ежедневно информацията по ал.1 за всички сключени сделки, по които страни са членове на БФБ, клиенти на участници в ЕСРОТ.

(3) Информацията в отчета по ал. 1 трябва да е идентична с тази, предоставяна от БФБ по ал. 2 на участниците в сделката, сключена на БФБ.

Чл. 12. БНБ след приключване на системния ден на ЕСРОТ, извършва сравнение между всички регистрирани през текущия ден сделки с ДЦК по чл. 16, ал. 1, т. 1 от Наредба № 5 и получения от БФБ отчет по чл. 11, ал. 1 за сключените на регулиран пазар сделки, чиито сетълмент е на тази дата. БНБ и ЦД АД незабавно уведомяват МФ за нерегистрираните сделки в управляваните от тях системи за сетълмент на ценни книжа, а за регистрираните БНБ и ЦД АД предоставят ежедневно информация на МФ, съгласно Приложение № 1 – БНБ и Приложение № 2 - ЦД АД .

Чл. 13. (1) За изпълнение на дейностите по чл. 11, БНБ създава и поддържа номенклатура с данни за членове на БФБ, които са участници в ЕСРОТ със съответните им наименования, идентификационни кодове, дата на включване/дата на изключване и др.

(2) БНБ актуализира данните в номенклатурата при промяна в статута на участниците в нея, включване на нови, отпадане от участие и др.

(3) Информацията по ал. 1 и 2 се предоставя на БНБ от БФБ във вид и срокове, които се уреждат в договора по чл. 11, ал.1.

(4) Поддепозитарите на ДЦК изпращат уведомление по електронен път при използване на квалифициран електронен подпис до БНБ, управление „Фискални услуги“, за всички сделки по чл. 9, които са приключени в деня на вальора (Приложение № 3).

ЗАКЛЮЧИТЕЛНА РАЗПОРЕДБА

§ 1. Тези правила се одобряват от министъра на финансите и управителя на БНБ на основание § 9 от заключителните разпоредби на Наредбата за изменение и допълнение на Наредба № 5 от 2007 г. за реда и условията за придобиване, регистриране, изплащане и търговия с държавни ценни книжа (обн. ДВ, бр. 29 от 2017 г.) и влизат в сила от2017 г.

**Справка за сделките с ДЦК, сключени на БФБ - София по номинална стойност
за периода отГ. доГ.**

Участници в ЕСРОТ	Сделки между участници в ЕСРОТ		Сделки между участници в ЕСРОТ - поддоговетари на ДЦК и от неговите членове и техни клиенти, които не са участници в ЕСРОТ		ВСИЧКО			Пазарна стойност на ДЦК	Фактическа стойност на ДЦК	Оригинален матуригет	Остатъчен матуригет
	сделки по чл. 4 от Правилата, сключени на БФБ-София		сделки по чл. 4 от Правилата, сключени на БФБ-София		общо сделки с ДЦК, сключени на БФБ - София		Процент				
	номинална стойност на ДЦК	брой на сделките	номинална стойност на ДЦК	брой на сделките	номинална стойност на ДЦК	брой на сделките					
I. ПЪРВИЧНИ ДИЛЪРИ											
I. ПЪРВИЧЕН ДИЛЪР											
I.1. Краткосрочни ДЦК - общо											
ISIN											
ISIN											
ISIN											
I.1. Дългосрочни ДЦК - общо											
ISIN											
ISIN											
ISIN											
Общо сделки за ПД											
II. ПЪРВИЧЕН ДИЛЪР											
2.1. Краткосрочни ДЦК - общо											
ISIN											
ISIN											
ISIN											
2.1. Дългосрочни ДЦК - общо											
ISIN											
ISIN											
ISIN											
Общо сделки за ПД											
ОБЩО СДЕЛКИ ЗА ПД											
II. ДРУГИ УЧАСТНИЦИ В ЕСРОТ											
1. УЧАСТНИК -											
1.1. Краткосрочни ДЦК - общо											
ISIN											
ISIN											
ISIN											
1.1. Дългосрочни ДЦК - общо											
ISIN											
ISIN											
ISIN											
Общо сделки за участник											
2. УЧАСТНИК -											
2.1. Краткосрочни ДЦК - общо											
ISIN											
ISIN											
ISIN											
2.1. Дългосрочни ДЦК - общо											
ISIN											
ISIN											
ISIN											
Общо сделки за участник											
3. УЧАСТНИК -											
3.1. Краткосрочни ДЦК - общо											
ISIN											
ISIN											
ISIN											
3.1. Дългосрочни ДЦК - общо											
ISIN											
ISIN											
ISIN											
Общо сделки за участник											
ОБЩО СДЕЛКИ ЗА ДРУГИТЕ УЧАСТНИЦИ В ЕСРОТ											
ОБЩО СДЕЛКИ С ДЦК НА ВТОРИЧЕН ПАЗАР											

Забележки:

Номиналната стойност на ДЦК се попълва в лева или левова равностойност за емисиите ДЦК, деноминирани в чужда валута.

Отчита се за всеки участник 50% от номиналната стойност на ДЦК, обект на сделката (кодове : 1000, 2500, 2700 и 2800) - двойно уведомление.

Сделки, които се включват в обхвата на справката:

Код на сделката

Описание

1000 Сделка за покупко-продажба на ДЦК между участници в ЕСРОТ

2000 Сделка за прехвърляне на ДЦК от участник в ЕСРОТ на негов клиент

2100 Сделка за изкупуване от участник в ЕСРОТ на ДЦК от негов клиент

2500 Сделка за прехвърляне на ДЦК от клиент на един участник в ЕСРОТ на друг участник в ЕСРОТ

2700 Сделка за прехвърляне на ДЦК от клиент на един участник в ЕСРОТ на клиент на друг участник в ЕСРОТ

2800 Сделка за прехвърляне на ДЦК от един участник на клиент на друг участник

Справка за сделките с ДЦК, сключени на БФБ - София по номинална стойност за периода отг. дог.

Борсови членове	Сделки между членове на БФБ		Сделки между борсови членове на БФБ - поддоговорителни на ДЦК и техни клиенти и между клиенти на участници на БФБ - поддоговорителни на ДЦК		ВСЪЩО						
	сделки по чл. 4 от Правилата, сключени на БФБ-София		сделки по чл. 4 от Правилата, сключени на БФБ-София		общо сделки с ДЦК, сключени на БФБ - София		Пазарен дял на участника БФБ - София				
	номинална стойност на ДЦК	брой на сделките	номинална стойност на ДЦК	брой на сделките	номинална стойност на ДЦК	брой на сделките	Процент	Пазарна стойност на ДЦК	Фактическа стойност на ДЦК	Оригинален матуритет на емисията	Остагъчен матуритет на емисията
БОРСОВИ ЧЛЕНОВЕ											
1. БОРСОВ ЧЛЕН -											
1.1 Краткосрочни ДЦК - общо											
ISIN											
ISIN											
ISIN											
1.1 Дългосрочни ДЦК - общо											
ISIN											
ISIN											
ISIN											
Общо сделки за участник											
2. БОРСОВ ЧЛЕН -											
2.1 Краткосрочни ДЦК - общо											
ISIN											
ISIN											
ISIN											
2.1 Дългосрочни ДЦК - общо											
ISIN											
ISIN											
ISIN											
Общо сделки за участник											
3. БОРСОВ ЧЛЕН -											
3.1 Краткосрочни ДЦК - общо											
ISIN											
ISIN											
ISIN											
3.1 Дългосрочни ДЦК - общо											
ISIN											
ISIN											
ISIN											
Общо сделки за участник											
ОБЩО СДЕЛКИ НА БФБ ЗА ДРУГИТЕ БОРСОВИ ЧЛЕНОВЕ											
ОБЩО БОРСОВИ СДЕЛКИ С ДЦК НА ВТОРИЧЕН ПАЗАР											

Уведомление
за приключени сделки с ДЦК, сключени на регулирания пазар, организиран от БФБ,
между инвестиционни посредници, борсови членове, клиенти на ... (наименование на участник в ЕСПОТ)
към .../.../...г. (дата)

Уникален идентификационен номер на сключена сделка с ДЦК на РП, организиран от БФБ	Дата на сключване на сделката – Т	Дата на сключването - Т+2	Номер на емисията на ДЦК (ISIN), предмет на сделката	Прехвърлител на ДЦК - ИП, борсов член	Приобретател на ДЦК - ИП, борсов член	Номинална стойност на прехвърляните ДЦК (цифром, с два знака след десетичната запетая)	Цената, по която се прехвърлят/придобиват ДЦК (цифром, с два знака след десетичната запетая)
1234	23.5.2017	25.5.2017	BG3010016005	ИП ХХХ	ИП ХХХХХ	1 200 000,00	1 234 500,12
.....
.....
.....

* Уведомлението се изпраща от участниците в ЕСПОТ, с изключение на ЦД АД, до края на деня на вальора на сделките по електронен път при използване на КЕП до БНБ, управление "Фискални услуги" на следните адреси:
Mladenova.Sv@bnbbank.org; Angelova.K@bnbank.org; Zasheva.H@bnbank.org; Labeshka.M@bnbank.org