АД-1
04.01.2018 г.

ОДОБРИЛ:

ВЛАДИСЛАВ ГОРАНОВ
МИНИСТЪР НА ФИНАНСИТЕ

ОДОБРИЛ:

ДИМИТЪР РАДЕВ
УПРАВИТЕЛ НА
БЪЛГАРСКА НАРОДНА БАНКА

БЪЛГАРСКА НАРОДНА БАНКА
04-01-2018
No БНБ-00568
София, пл. „Княз Александър I“ No 1

ПРАВИЛА

ЗА ДОПУСКАНЕ ДО ТЪРГОВИЯ НА ДЪРЖАВНИ ЦЕННИ КНИЖА НА МНОГОСТРАННА СИСТЕМА ЗА ТЪРГОВИЯ E-BOND BULGARIA, ОПЕРИРАНА ОТ „BLOOMBERG TRADING FACILITY LIMITED И/ИЛИ НЕГОВИТЕ ДЪЩЕРНИ КОМПАНИИ“ И ПРИКЛЮЧВАНЕ НА СДЕЛКИ С ТЯХ В БЪЛГАРСКА НАРОДНА БАНКА

Глава Първа
Общи положения

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

1. Допускане до търговия 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) на многостранна система за търговия E-Bond Bulgaria, оперирана от Bloomberg Trading Facility Limited (BTF), получил нотификация в Комисията за финансов надзор от Financial Conduct Authority bank of England – Prudential Regulation Authority (FCA) на 27.06.2017 г., по чл. 31 от Директива 2004/39/ЕС на Европейския парламент и на Съвета от 21 април 2004 г. относно пазарите на финансови инструменти за лицензирана многостранна система за търговия на ДЦК, и/или неговите дъщерни компании (МСТ E-Bond Bulgaria).

2. Приключване на сделките с ДЦК, сключени на МСТ E-Bond Bulgaria, в Електронната система за регистриране и обслужване на търговията с ДЦК (ЕСРОТ) и в Системата за сетълмент на ДЦК (СДЦК), организирани 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 (Наредба № 31) и Наредба № 15 за контрол върху сделките с държавни ценни книжа (Наредба № 15).

Чл. 2. В системите по чл.1, т.2 се приключват само сделки, сключени по чл. 16, ал. 1, т. 1 от Наредба № 5 за собствена сметка с притежавани от участниците в тях ДЦК.

Глава Втора
Допускане на емисии държавни ценни книжа до МСТ E-Bond Bulgaria

Чл. 3. На МСТ E-Bond Bulgaria 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 по чл. 1, т. 2.

Чл. 4. (1) Допускането на ДЦК по чл. 1, т. 1 на МСТ E-Bond Bulgaria, се извършва посредством регистрацията им на МСТ E-Bond Bulgaria, оперирана от BTF.

(2) Регистрацията на емисиите ДЦК се осъществява от BTF на база на уведомление от страна на МФ за параметрите на всички емисии по чл. 1, т. 1.

(3) Пълен списък на емисиите ДЦК допуснати до търговия се поддържа от BTF на МСТ E-Bond Bulgaria.

(4) МФ следи текущо за актуалността на списъка от емисии ДЦК по ал. 1.

Глава Трета
Приключване на сделки, сключени на МСТ E-Bond Bulgaria

Чл. 5. (1) За целите на приключването на сделките с ДЦК, сключени на МСТ E-Bond Bulgaria от участниците в системите по чл. 1, т. 2, БНБ извършва ежедневен мониторинг на търговията на МСТ E-Bond Bulgaria.

(2) Приключването на сделките, сключени на МСТ E-Bond Bulgaria, се извършва в опериранитe от БНБ системи по чл. 1, т. 2 в съответствие с разпоредбите на Наредба № 5 и на Наредба № 31.

(3) Всяка сделка, сключена на МСТ E-Bond Bulgaria, се счита за приключена след извършване на нейната регистрация и сетълмент в системите по ал.1.

Чл. 6. (1) BTF изпраща ежедневно отчет до БНБ, за сключените до 16.00 часа на текущия ден сделки с ДЦК на МСТ E-Bond Bulgaria. Отчетът съдържа следната информация:

- Дата на сключване на сделката – T;
- Дата на сетълмента (за сделките извършени посредством „RFQ" функцията на системата на T+0, T+1 или T+2, а за сделките извършени посредством „FQP" функцията на системата на T+2);
- Номер на емисията на ДЦК (ISIN), предмет на сделката;
- Прехвърлител на ДЦК – наименование и идентификационен код, присвоен от BTF за участника;
- Приобретател на ДЦК – наименование и идентификационен код, присвоен от BTF за участника;
- 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);
- Доходност (с разрядност до три знака след десетичната запетая);
- Уникален идентификатор, присвоен от BTF за сключената сделка.

(2) BTF предоставя информация за параметрите на всяка сключена сделка в реално време на участниците в нея.

(3) Информацията за параметрите на всяка сключена сделка в отчета по ал. 1 трябва да е идентична с тази по ал. 2.

Чл. 7. Участниците в сделките са длъжни да осигурят ДЦК, предмет на сделката и необходимите парични средства за тяхното заплащане и да ги приключат на датата на сетълмента, при договорените на МСТ E-Bond Bulgaria параметри.

Чл. 8. (1) Регистрацията и сетълментът на сключените сделки се извършва въз основа на искания, отправени до БНБ от двете страни по сделката (прехвърлител и приобретател) съгласно чл. 17, ал. 1 от Наредба № 5 (Приложение № 10).

(2) Сетълментът по сделките се извършва с движение на средства по парични сметки за сетълмент в RINGS и TARGET2 при спазване на принципа „доставка срещу плащане“ (DVP – delivery versus payment), при който трансферът на ДЦК и парични средства се осъществява едновременно на брутна база („DVP – Модел 1“).

(3) Регистрацията и сетълментът по сделките се извършва по предварително обявен от МФ и БНБ график на системния ден на ЕСРОТ в съответствие с работното време на платежните системи RINGS и TARGET2.

(4) При предстоящо плащане по ДЦК с настъпващ падеж и/или на лихвите по тях искания за регистрация на сделки с тези ДЦК 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. 9. (1) За изпълнение на дейностите по чл. 5, БНБ създава и поддържа в ЕСРОТ номенклатура с данни за участниците в МСТ E-Bond Bulgaria със съответните им наименования, идентификационни кодове, дата на включване/дата на изключване и др.

(2) БНБ въвежда в номенклатурата първичните дилъри на ДЦК, които са участници в МСТ E-Bond Bulgaria, като извършва проверка за съответствие с утвърдения от министъра на финансите списък на първичните дилъри на ДЦК за съответния период.

(3) Актуализира данните в номенклатурата при промяна в статута на участниците, включване на нови, отпадане от участие, отпадане от списъка на първичните дилъри и др.

(4) БНБ извършва ежедневно равнение на получената по чл. 6, ал. 1 информация за параметрите на сделките, сключени на МСТ E-Bond Bulgaria, с параметрите на регистрираните сделки в ЕСРОТ за съответния вальор и предоставя тази информация на МФ, съгласно Приложение № 1.

(5) БНБ уведомява незабавно МФ и страните по сделката за случаите на неизпълнение на разпоредбата на чл. 7.

Чл. 10. За регистрацията и сетълмента на сделките БНБ събира такси съгласно „Тарифата за таксите и комисионите за обработка на сделки с ДЦК“.

ДОПЪЛНИТЕЛНА РАЗПОРЕДБА

§ 1. По смисъла на тези правила:

1. „Request for Quote“ („RFQ”) е функционалност, която позволява изпращане на запитване за котировка до един или повече участници, в резултат на което се предоставят една или повече котировки, между които може да се избира;
2. Firm Quote Posting (“FQP”) е функционалност, която позволява участниците да публикуват твърди котировки;
3. Delivery versus payment („DVP – Модел 1“) е сетълмент модел „доставка срещу плащане“, при който, трансферът на ДЦК и парични средства се осъществява едновременно на брутна база.

ЗАКЛЮЧИТЕЛНА РАЗПОРЕДБА

§ 2. 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 от 04.01.2018 г.

Приложение № 1 към чл. 9, ал. 4

СПРАВКА
за сделките с ДЦК, сключени на МСТ E-Bond Bulgaria от участниците в ЕСРОТ по номинална стойност
за периода от ....г. до .....г.

Участници в ЕСРОТ	Сделки между участници в ЕСРОТ		
	сделки по чл. 16, ал.1 т.1, сключени на МСТ E-Bond Bulgaria		Пазарен дял на участника МСТ E-Bond Bulgaria
	номинална стойност на ДЦК	брой на сделките	Процент
I. ПЪРВИЧНИ ДИЛЪРИ			
1. ПЪРВИЧЕН ДИЛЪР			
1.1. Краткосрочни ДЦК - общо			
1.1. Дългосрочни ДЦК - общо			
Общо сделки за ПД			
2. ПЪРВИЧЕН ДИЛЪР			
2.1. Краткосрочни ДЦК - общо			
2.1. Дългосрочни ДЦК - общо			
Общо сделки за ПД			
ОБЩО СДЕЛКИ ЗА ПД			
II. ДРУГИ УЧАСТНИЦИ В ЕСРОТ			
1. УЧАСТНИК -			
1.1. Краткосрочни ДЦК - общо			
1.1. Дългосрочни ДЦК - общо			
Общо сделки за участник			
2. УЧАСТНИК -			
2.1. Краткосрочни ДЦК - общо			
2.1. Дългосрочни ДЦК - общо			
Общо сделки за участник			
3. УЧАСТНИК -			
3.1. Краткосрочни ДЦК - общо			
3.1. Дългосрочни ДЦК - общо			
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 (код 1000) - двойно уведомление.