

АП - 12 / 24.07.2017г.

БЪЛГАРСКА
НАРОДНА БАНКА
БНБ-121669, 25-07-2017
София, пл. „Княз Александър I“ 3

ОДОБИЛ:

.....

МИНИСТЪР НА ФИНАНСИТЕ



ОДОБИЛ:

.....

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 постоянните 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 сепълмънт 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 сепълмънт 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, споменавани в лево 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 Сегмънт 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 лихвопосни 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 (T+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 сепълмент на парични средства в РИНГС/ГАРЪТ 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 сепълмент 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 сепълмента - 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 сестълмент е на тази дата. БНБ и ЦД АД незабавно уведомяват МФ за нерегистрираните сделки в управляваните от тях системи за сестълмент 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 поменклатура 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 поменклатурата 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 приключили в деня на валидация (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 ДИК, изключени на БФВ - София по номинална стойност
за периода от до**

Участници в БСРОТ	Сделки между участници в БСРОТ		Сделки между участници в БСРОТ - поддоговор на ДИК и от всички класове и серии акциите, които не са участвали в БСРОТ		ВСМЧКП			Посрещане от ДИК	Класификация на ДИК	Срещане от ДИК	Използване на ДИК
	сделки по чл. 4 от Закона, съгласно на БФВ - София		сделки по чл. 4 от Закона, съгласно на БФВ - София		общо сделки с ДИК, съгласно на БФВ - София		Посрещане от участника БФВ - София				
	Класификация на ДИК	Срещане от ДИК	Номинална стойност на ДИК	Срещане от ДИК	Номинална стойност на ДИК	Срещане от ДИК	Посрещане				
I. ПЕРИОДИЧНИ ДИВАНДИ											
1. СЪРВЕЧЕН ДИВАН											
1.1. Кредиторски ДИК - общо											
ISX											
ISY											
ISZ											
1.2. Делегирани ДИК - общо											
ISX											
ISY											
ISZ											
Общо сделки с ДИК											
2. ГРАНЧЕН ДИВАН											
2.1. Кредиторски ДИК - общо											
ISX											
ISY											
ISZ											
2.2. Делегирани ДИК - общо											
ISX											
ISY											
ISZ											
Общо сделки с ДИК											
III. ДРУГИ ЧАСТНИЦИ В БСРОТ											
1. УЧАСТНИК											
1.1. Кредиторски ДИК - общо											
ISX											
ISY											
ISZ											
1.2. Делегирани ДИК - общо											
ISX											
ISY											
ISZ											
Общо сделки с ДИК											
2. УЧАСТНИК											
2.1. Кредиторски ДИК - общо											
ISX											
ISY											
ISZ											
2.2. Делегирани ДИК - общо											
ISX											
ISY											
ISZ											
Общо сделки с ДИК											
3. УЧАСТНИК											
3.1. Кредиторски ДИК - общо											
ISX											
ISY											
ISZ											
3.2. Делегирани ДИК - общо											
ISX											
ISY											
ISZ											
Общо сделки с ДИК											
Общо сделки за ДРУГИ УЧАСТНИЦИ В БСРОТ											
Общо сделки с ДИК НА ОТВОРЕН ПАЗАР											

Забелески

Номинална стойност на ДИК се посрещва в лева или в евро в равностойност за емисиите ДИК, депонираните в чужда държава.

Отчита се за всеки участник 50% от номиналната стойност на ДИК, обещана на следващи датумове: 1300, 2500, 2700 и 2800) - двойно уведомително.

Сделки, които се включват в обавно на фирмата

Код на сделката

Описание

- 1000 Сделка за покупко-продажба на ДИК между участници в БСРОТ
- 2000 Сделка за преминаване на ДИК от участници в БСРОТ на друго лице
- 2100 Сделка за преминаване от участници в БСРОТ на ДИК от не участващи
- 2500 Сделка за преминаване на ДИК от инвеститори/участници в БСРОТ на друг участник в БСРОТ
- 2700 Сделка за преминаване на ДИК от инвеститори/участници в БСРОТ на клиент на друг участник в БСРОТ
- 2800 Сделка за преминаване на ДИК от инвеститори/участници в БСРОТ на друг участник

Справка за сделките с ДИК, сключени на БФБ - София по номинална стойност
за периода от до

Борсова сделка	Сделка между борсови членове на БФБ - по номинална стойност на ДИК, сключени извън пазара за участници на БФБ - одобрено от ДИК		ВСТРЪЖО								
	сделка по чл. 4 от Правилник, сключена на БФБ - София		сделка по чл. 4 от Правилник, сключена на БФБ - София		Общо сключени ДИК, сключени на БФБ - София		Пазарен дял на участниците на БФБ - София				
	номинална стойност на ДИК	брът на сделките	номинална стойност на ДИК	брой на сделките	номинална стойност на ДИК	брой на сделките	Процент	Пазарен дял на ДИК	Фактически дял на ДИК	Оригинален материал за изчисляване	Състояние на сделките
1. БОРСОВИ ЧЛЕНОВЕ											
1.1. Крайнопречени ДИК - общо											
ISN											
ISN											
ISN											
1.2. Дългосрочни ДИК - общо											
ISN											
ISN											
ISN											
Общо сключени в участници											
2. БОРСОВИ ЧЛЕНОВЕ											
2.1. Крайнопречени ДИК - общо											
ISN											
ISN											
ISN											
2.2. Дългосрочни ДИК - общо											
ISN											
ISN											
ISN											
Общо сключени в участници											
3. БОРСОВИ ЧЛЕНОВЕ											
3.1. Крайнопречени ДИК - общо											
ISN											
ISN											
ISN											
3.2. Дългосрочни ДИК - общо											
ISN											
ISN											
ISN											
Общо сключени в участници											
ОБЩО СДЕЛКИ НА БФБ ЗА ДРУГИТЕ БОРСОВИ ЧЛЕНОВЕ											
ОБЩО БОРСОВИ СДЕЛКИ С ДИК НА ВТОРИШЕН 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 ЕСРОТ)
към .../.../...г. (дата)

Уникален идентификационен номер на сключена сделка с ДЦК на РП, организиран от БФБ	Дата на сключване на сделката – Г	Дата за сепарацията – Г.З	Номер на емисията на ДЦК (ISIN), предмет на сделката	Преквърлятел на ДЦК - ИП, борсов член	Приобретател на ДЦК - ИП, борсов член	Номинална стойност на преквърлятелите ДЦК (цифров, с два знака след десетичната запетая)	Цената, по която се преквърлятели/придобиват ДЦК (цифров, с два знака след десетичната запетая)
1234	23.5.2017	25.5.2017	BG5010016005	ИП ХХХ	ИП ХХХХХ	1 200 000,00	1 234 500,12

* Уведомлението се издава от участниците в ЕСРОТ, с изключение на ЦД АД, до края на деня на валидността на сделките по електронен път при използване на КЕП до БНБ, управление "Фискални услуги" на следните адреси:
Mladnova.Sv@bnbbank.org; Angelova.K@bnbank.org; Zashcheva.II@bnbank.org; Labeshka.M@bnbank.org