



БЪЛГАРСКА НАРОДНА БАНКА

ПРАВИЛА И ПРОЦЕДУРИ

ЗА РАБОТА НА СИСТЕМАТА ЗА РЕГИСТРАЦИЯ И СЕТЪЛМЕНТ НА ДЦК В БНБ - VNBGSSS

София, януари 2025 г.

Тези правила имат валидност единствено във версията, официално разпространена от БНБ
Правилата, части от тях или начинът на тяхното оформяне не могат да бъдат използвани за
разработка на системи, свързани с регистрация и сетълмент на държавни ценни книжа, или на подобни
документи без писменото съгласие на БНБ.

Съдържание

1. ОБЩИ ПОЛОЖЕНИЯ.....	5
1.1. ВЪВЕДЕНИЕ.....	5
1.2. ПРЕДМЕТ НА ПРАВИЛАТА.....	5
1.3. ОСНОВАНИЕ ЗА РАЗРАБОТКА И ИЗДАВАНЕ НА ДОКУМЕНТА.....	5
1.4. УТВЪРЖДАВАНЕ И ИЗМЕНЕНИЯ.....	6
1.5. ДЕФИНИЦИИ.....	6
2. ОСНОВНИ УСЛУГИ И ПРИНЦИПИ НА ФУНКЦИОНИРАНЕ НА VNBGSSS.....	8
2.1. УСЛУГИ, ПРЕДОСТАВЯНИ ОТ VNBGSSS.....	8
2.2. ПРЕДОСТАВЯНО НИВО НА ОБСЛУЖВАНЕ.....	9
2.3. ОСНОВНИ ПРИНЦИПИ НА ФУНКЦИОНИРАНЕ НА VNBGSSS.....	9
3. УЧАСТИЕ В VNBGSSS.....	10
3.1. УЧАСТНИЦИ В VNBGSSS МОГАТ ДА БЪДАТ:.....	10
3.2. УСЛОВИЯ ЗА УЧАСТИЕ В VNBGSSS.....	11
3.3. ДОКУМЕНТИ ЗА УЧАСТИЕ В VNBGSSS.....	11
3.4. РЕД И УСЛОВИЯ ПРИ ВКЛЮЧВАНЕ НА УЧАСТНИК В VNBGSSS:.....	13
3.5. РЕД И УСЛОВИЯ ЗА ИЗКЛЮЧВАНЕ И ВРЕМЕННО ОГРАНИЧАВАНЕ НА УЧАСТИЕТО В VNBGSSS.....	15
3.6. КЛЮЧОВИ УЧАСТНИЦИ.....	16
4. ДОПУСТИМИ ЦЕННИ КНИЖА.....	17
5. СМЕТКИ ЗА ДЦК.....	17
5.1. ОБЩИ ПРАВИЛА ЗА ОТКРИВАНЕ И ЗАКРИВАНЕ НА СМЕТКИ ЗА ДЦК.....	17
5.2. ВИДОВЕ СМЕТКИ.....	18
5.3. СМЕТКИ ЗА СЕТЪЛМЕНТ НА ДЦК, ДЕНОМИНИРАНИ И ПЛАТИМИ В ЛЕВА И В ЕВРО.....	18
5.4. ПАРИЧНИ СМЕТКИ ЗА ДЦК.....	20
5.5. ВОДЕНЕ НА РЕГИСТРИ И СМЕТКИ ЗА ДЦК.....	20
5.6. СМЕТКИ НА МФ ЗА ОПЕРАЦИИ С ДЦК.....	21
5.7. СЕТЪЛМЕНТ ПО СМЕТКИ ЗА ДЦК.....	21
6. ОПЕРАЦИИ НА ПЪРВИЧНИЯ И ВТОРИЧНИЯ ПАЗАР.....	22
6.1. СЕТЪЛМЕНТ НА ОПЕРАЦИИТЕ НА ПЪРВИЧНИЯ ПАЗАР.....	22
6.2. СЕТЪЛМЕНТ НА ОПЕРАЦИИТЕ НА ВТОРИЧНИЯ ПАЗАР.....	23
7. БЛОКИРАНЕ И ДЕБЛОКИРАНЕ НА ДЦК ПРИ ВПИСВАНЕ НА ЗАЛОГ В РОЗ И ОБЕЗПЕЧАВАНЕ НА СРЕДСТВА ПО СМЕТКИ И ДЕПОЗИТИ НА БЮДЖЕТНИ ПРЕДПРИЯТИЯ В ОБСЛУЖВАЩИ БАНКИ.....	27
7.1. РЕГИСТЪР НА ОСОБЕНИТЕ ЗАЛОЗИ.....	27
7.2. СЪЗДАВАНЕ НА ЗАЛОГ.....	28
7.3. ВПИСВАНИЯ В РОЗ.....	28
7.4. ИЗПЛАЩАНЕ НА ЛИХВИ И ОБРАТНО ИЗКУПУВАНЕ НА ЗАЛОЖЕНИ ЦЕННИ КНИЖА.....	28
7.5. БЛОКИРАНЕ И ДЕБЛОКИРАНЕ НА ДЦК ЗА ОБЕЗПЕЧАВАНЕ НА СРЕДСТВА ПО СМЕТКИ И ДЕПОЗИТИ НА БЮДЖЕТНИ ОРГАНИЗАЦИИ В ОБСЛУЖВАЩИ БАНКИ.....	29
8. ОБРАБОТКА НА СДЕЛКИ И СЕТЪЛМЕНТ.....	30
8.1. РАБОТНИ ДНИ НА СИСТЕМАТА.....	30
8.2. ПРАВИЛА ПРИ ОБРАБОТКАТА НА СДЕЛКИ С ДЦК.....	30
9. МЕРКИ ЗА ПРЕДОТВРАТЯВАНЕ НА НЕУСПЕШЕН СЕТЪЛМЕНТ.....	36
9.1. УСТАНОВЯВАНЕ НА ПРОЦЕДУРИ ОТ ДДЦК.....	36
9.2. МЕРКИ ПРЕДПРИЕМАНИ ОТ УЧАСТНИЦИТЕ В VNBGSSS.....	36
9.3. МЕРКИ ЗА СПРАВЯНЕ С НЕУСПЕШЕН СЕТЪЛМЕНТ.....	36
9.4. ДОКЛАДВАНЕ СЛУЧАИТЕ НА НЕУСПЕШЕН СЕТЪЛМЕНТ.....	37
10. ПРАВИЛА И ПРОЦЕДУРИ ПРИ НЕИЗПЪЛНЕНИЕ ОТ СТРАНА НА УЧАСТНИК.....	37

10.1. ВЪЗ ОСНОВА НА ПОЛУЧЕНО УВЕДОМЛЕНИЕ ОТ КОМПЕТЕНТНИЯ ОРГАН ИЛИ ТАКОВА, ПОЛУЧЕНО ПО РЕДА НА ЧЛ. 6 ОТ ДИРЕКТИВА 98/26/ЕО.....	37
10.2. МЕРКИ ПРИ ОТКРИТО ПРОИЗВОДСТВО ПО НЕСЪСТОЯТЕЛНОСТ	37
11. МЕРКИ В СЛУЧАИ НА ПРЕСТРУКТУРИРАНЕ.....	39
12. ТАКСИ И КОМИСИОНИ	39
12.1. МЕСЕЧНИ ТАКСИ.....	39
12.2. ТАКСИ ПРИ СДЕЛКИ С ДЦК НА ПЪРВИЧЕН И ВТОРИЧЕН ПАЗАР	39
13. ПРАВА И ЗАДЪЛЖЕНИЯ НА БНБ КАТО СОБСТВЕНИК И ОПЕРАТОР НА VNBGSSS	40
13.1. ПРАВА И ЗАДЪЛЖЕНИЯ НА БНБ ПРИ ОРГАНИЗИРАНЕ, РЕГУЛИРАНЕ И КОНТРОЛИРАНЕ НА VNBGSSS.	40
13.2. ПРАВА И ЗАДЪЛЖЕНИЯ НА БНБ ПРИ ОПЕРАИРАНЕ, ПОДДЪРЖАНЕ И АДМИНИСТРИРАНЕ НА VNBGSSS.	40
13.3. ПРАВА И ЗАДЪЛЖЕНИЯ НА БНБ ПРИ ИЗВЪРШВАНЕ НА УСЛУГИ ЧРЕЗ VNBGSSS	41
13.4. ЦЯЛОСТ НА ЕМИСИИТЕ.	43
13.5. ВРЪЗКИ С ДРУГИ ДЕПОЗИТАРИ, КОИТО ИЗПОЛЗВАТ ОБЩА ИНФРАСТРУКТУРА НА СЕТЪЛМЕНТ	44
13.6. ОТГОВОРНОСТ НА БНБ	45
13.7. ОТГОВОРНОСТИ НА РЪКОВОДНИЯ СЪСТАВ НА ДЦК В БНБ.....	45
14. ПРАВА И ЗАДЪЛЖЕНИЯ НА УЧАСТНИЦИТЕ.....	46
14.1. ПРЕДСТАВИТЕЛСТВО И ГАРАНЦИИ.....	46
14.2. ПРАВА И ЗАДЪЛЖЕНИЯ НА УЧАСТНИЦИТЕ.	47
15. ДЕЙСТВИЯ ПРИ ВЪЗНИКВАНЕ НА ПРОБЛЕМИ В VNBGSSS	48
15.1. ДЕЙСТВИЯ ПРИ ВЪЗНИКВАНЕ НА КОМУНИКАЦИОННИ И ТЕХНИЧЕСКИ ПРОБЛЕМИ	48
15.2. УВЕДОМЯВАНЕ ПРИ ПРЕКЪСВАНЕ НА РАБОТАТА НА VNBGSSS	48
15.3. НЕ СЕ СЧИТАТ ЗА ОСНОВАНИЕ ЗА ОБЯВЯВАНЕ НА ИЗВЪНРЕДНА СИТУАЦИЯ СЛЕДНИТЕ СЛУЧАИ: ..	48
16. РЕД И УСЛОВИЯ ЗА ПОДАВАНЕ НА ЖАЛБИ И ОПЛАКВАНИЯ ОТ УЧАСТНИЦИ В VNBGSSS ДО ДЕПОЗИТАРЯ В БНБ	49
17. ЗАЩИТА НА ПОВЕРИТЕЛНА ИНФОРМАЦИЯ И ЛИЧНИ ДАННИ.....	49
17.1. ЗАЩИТА НА ПОВЕРИТЕЛНА ИНФОРМАЦИЯ.....	49
17.2. ЗАЩИТА НА ЛИЧНИ ДАННИ.....	50
18. НЕРАЗДЕЛНА ЧАСТ ОТ ТЕЗИ ПРАВИЛА И ПРОЦЕДУРИ СА СЛЕДНИТЕ ДОКУМЕНТИ: 51	
19. ВЛИЗАНЕ В СИЛА.....	51

Списък на съкращенията

БНБ	Българска народна банка
ДЦК	Държавни ценни книжа
ДДЦК	Депозитар на държавни ценни книжа
ЕСРОТ	Електронна система за регистриране и обслужване на търговията с ДЦК
ЕЦБ	Европейска централна банка
РОЗ	Регистър на особените залози
ЗПУПС	Закон за платежните услуги и платежните системи
МФ	Министерство на финансите
ОБИС	Основна банкова информационна система
СДЦК	Система от сметки за сетълмент на ДЦК
ЦДЦК	Централен депозитар на ценни книжа
ЦК	Ценни книжа
BNBGSSS	Система за регистрация и сетълмент на ДЦК в БНБ
СРМІ	Комитет по плащания и пазарни инфраструктури
IOSCO	Технически комитет на Международната организация на комисиите по ценни книжа
FoP	Free of payment (без движение на парични средства)
DvP	Delivery versus payment (доставка срещу заплащане)
PFoD	Payment free of Delivery (заплащане без доставка)
РИНГС	Система за брутен сетълмент в реално време
TARGET	Трансевропейска автоматизирана система за брутен сетълмент на експресни преводи в реално време от ново поколение
TARGET-БНБ	Национален системен компонент на TARGET, опериран от БНБ
T2S	TARGET2 – SECURITIES/ Таргет2-Ценни книжа – Общоевропейска IT платформа за сетълмент на безналични ценни книжа в централнобанкови пари, която улеснява интеграцията на услугите, последващи сключването на сделките с ценни книжа
T2S DCA	Таргет2–Ценни книжа специална парична сметка в TARGET - сметка за парични плащания във връзка със сетълмента на ценни книжа, открита в системен компонент на TARGET

1. Общи положения.

1.1. Въведение.

Българската народна банка (БНБ) е централен депозитар и фискален агент на държавата, в съответствие със Закона за БНБ и Закона за държавния дълг. Българската народна банка е оператор на Системата за регистриране, обслужване и сетълмент по сделки и операции с ДЦК – BNBGSSS (Системата). BNBGSSS е нотифицирана като система с окончателност на сетълмента по Директива 98/26/ЕО на Европейския парламент и на Съвета от 19 май 1998 г. относно окончателността на сетълмента в платежните системи и в системите за сетълмент на ценни книжа, изменена с Директива 2009/44/ЕО на Европейския парламент и на Съвета от 6 май 2009 г. (Директива 98/26/ЕО). BNBGSSS се състои от Електронна система за регистриране и обслужване на търговията с ДЦК (ЕСРОТ) и Система от сметки за сетълмент на ДЦК (СДЦК). В ЕСРОТ е вграден модул на Регистър на особените залози (РОЗ). Между ЕСРОТ и СДЦК е изградена пряка интерфейсна връзка за автоматизиран обмен на данни.

От септември 2023 г. BNBGSSS е участник в общата ИТ платформа на Евросистемата за сетълмент на ценни книжа в централнобанкови париТаргет2-Ценни книжа (TARGET2-Securities (T2S)).

В T2S се извършва сетълментът на всички сделки и операции, сключвани чрез BNBGSSS с ДЦК, деноминирани в евро. В платформата се поддържат статични данни за: потребителите, емисиите държавни ценни книжа, участниците, сметки за държавни ценни книжа и др.

Всички участници в BNBGSSS са включени в T2S като индиректни участници. „Централен депозитар“ АД е директен участник в T2S.

Тези правила и процедури за работа с BNBGSSS са предназначени за участниците в Системата, Министерството на финансите (МФ) и БНБ.

1.2. Предмет на правилата.

Тези правила и процедури регламентират реда, по който се извършват регистрирането, обслужването и сетълмента по сделки и операции с ДЦК в BNBGSSS.

1.3. Основание за разработка и издаване на документа.

Тези правила и процедури се издават на основание Регламент (ЕС) № 909/2014 на Европейския парламент и на Съвета за подобряване на сетълмента на ценни книжа в Европейския съюз и за централните депозитари на ценни книжа, както и за изменение на директиви 98/26/ЕО и 2014/65/ЕС и Регламент (ЕС) № 236/2012.

Правилата и процедурите са разработени в съответствие с изискванията на:

- Закон за БНБ;

- Закон за държавния дълг;
- Наредба № 5 на МФ и БНБ за реда и условията за придобиване, регистриране, изплащане и търговия с държавни ценни книжа (Наредба № 5);
- Наредба № 15 на БНБ за контрол върху сделките с държавни ценни книжа (Наредба № 15);
- Наредба № 31 на БНБ за сетълмент на държавни ценни книжа (Наредба № 31).

1.4. Утвърждаване и изменения.

Правилата се приемат, изменят и утвърждават от подуправителя, ръководещ управление „Банково“ на БНБ. Българската народна банка уведомява участниците в BNBGSSS за направените промени в правилата най-малко четиринадесет календарни дни преди влизането в сила на съответните промени.

1.5. Дефиниции.

По смисъла на настоящите правила и процедури:

1.5.1. Банка е:

- банка, получила лиценз от БНБ за извършване на банкова дейност;
- клон на банка от трета държава, получил лиценз от БНБ съгласно Закона за кредитните институции;
- клон на банка от държава членка, извършващ дейност на територията на Република България по реда на чл. 20 и 21 от Закона за кредитните институции.

1.5.2. Бизнес идентификационен код (BIC) е код, предоставен от SWIFT (Society for Worldwide Interbank Financial Telecommunication) на финансови и нефинансови институции по ISO Standard № 9362.

1.5.3. Бъдещ вальор – успешно преминалите входяща проверка уведомления/искания за регистриране на сделки с ДЦК, изпращани от участниците, се съхраняват в BNBGSSS до вальора на изпълнението им.

1.5.4. Вальор е датата, на която се извършва сетълментът на ДЦК.

1.5.5. Инвестиционен посредник – съгласно Закона за пазарите на финансови инструменти инвестиционен посредник е лице, което предоставя една или повече инвестиционни услуги и/или извършва една или повече инвестиционни дейности.

1.5.6. Искане за сделка е заявка към BNBGSSS в предварително определен формат, чрез която се регистрира участието на страна по сделка с ДЦК.

1.5.7. Момент на въвеждане - успешна входяща проверка на искания за сделки с ДЦК, деноминирани в лева, в съответствие с техническите изисквания на системата. Моментът на въвеждане за ДЦК, деноминирани в евро, е след успешно осъществяване на процеса на валидиране съгласно критериите за валидиране на T2S, независимо дали

валидирането се осъществява в BNBGSSS (индиректни участници в T2S) или T2S (директни участници в T2S). В случаите, когато исканията подлежат на стиковане в T2S, инструкциите за сетълмент се считат за въведени в момента, в който станат съответстващи на техническите правила на T2S в платформата T2S. В случаите, когато искането за сделка се изпраща към BNBGSSS за предварително стиковане, за момент на въвеждане се счита моментът, в който искането премине проверката в BNBGSSS съгласно критериите за валидиране на T2S. От момента на въвеждане инструкцията поражда действие спрямо трети лица.

1.5.8. Момент на неотменимост на сделка за ДЦК - когато има пълно съвпадение на данните в исканията за сделки от двамата участници, съгласно техническите изисквания на BNBGSSS и T2S, т.е. транзакцията е получила статус „matched“ в BNBGSSS за ДЦК, деноминирани в лева или в T2S за ДЦК, деноминирани евро. От момента на неотменимост на сделката, тя не може да бъде отменена едностранно.

1.5.9. Момент на финалност – сетълментът на сделките с ДЦК е финален, след като се завери сметката за сетълмент на ДЦК на приобретателя в системата СДЦК за ДЦК, деноминирани в лева, и сметката за сетълмент на ДЦК на приобретателя в платформата T2S за ДЦК, деноминирани в евро.

1.5.10. Неуспешен сетълмент е липса на сетълмент на сделка с ДЦК на предвидената дата за сетълмент поради липса на ДЦК или парични средства, независимо от причината за тази липса.

1.5.11. Оперативен риск е рискът от срив в информационното, техническото и комуникационното оборудване или човешки грешки, предизвикващи критични за извършването на сетълмента обстоятелства.

1.5.12. Поддепозитар на ДЦК – Поддепозитари на ДЦК могат да бъдат кредитни институции съгласно Закона за кредитните институции, чийто лиценз включва дейностите по чл. 2, ал. 2, т. 4 и 9 от Закона за кредитните институции, както и институции, получили разрешение в съответната държава членка за извършване на дейност като централен депозитар.

1.5.13. Първичен дилър на ДЦК - Първични дилъри на ДЦК могат да бъдат банки, чийто лиценз включва услугите и дейностите, дефинирани в Закона за кредитните институции, включително и такива от други държави членки; инвестиционни посредници, получили лиценз за извършване на инвестиционни услуги и дейности съгласно Закона за пазарите на финансовите инструменти, включително и такива от

други държави членки. Първичните дилъри се избират от МФ въз основа на критерии за избор на първични дилъри ДЦК, които се утвърждават от министъра на финансите.

1.5.14. **Прехвърлител** – Лице, прехвърлящо ДЦК от неговите сметки за сетълмент на ДЦК.

1.5.15. **Приобретател** – Лице, придобиващо ДЦК по неговите сметки за сетълмент на ДЦК

1.5.16. **Сетълмент на сделки с ДЦК** – Сетълмент на сделки с ДЦК е прехвърляне на ДЦК със или без прехвърляне на парични средства въз основа на искане/уведомление за сделка, подадено чрез BNBGSSS. .

1.5.17. **Системен ден** е предварително определен интервал от време, през който се приемат и обработват заявки за сетълмент на ДЦК в BNBGSSS.

1.5.18. **Сметка за сетълмент на ДЦК** - сметка за сетълмент на ДЦК е сметка в централната банка или агент по сетълмента, използвана за съхраняване на ДЦК и за сетълмент по сделки с ДЦК между участници в системата.

1.5.19. **Сметка за сетълмент на парични средства в лева** - сметка на участника в РИНГС или на агент по сетълмента , използвана за сетълмента на парични средства по сделки с ДЦК, деноминирани и платими в лева, включително за служебно събиране от БНБ на дължимите такси и комисиони, в съответствие с Тарифата за таксите и комисионите за обработка на сделки с ДЦК..

1.5.20. **РИНГС** – Система за брутен сетълмент в реално време за плащания в лева

1.5.21. **ТАРГЕТ** - Трансевропейска автоматизирана система за брутен сетълмент на експресни преводи в реално време от ново поколение.

1.5.22. **T2S** – (TARGET2–SECURITIES) ТАРГЕТ2-Ценни книжа – Общоевропейска ИТ платформа за сетълмент на безналични ценни книжа в централнобанкови пари, която улеснява интеграцията на услугите, последващи сключването на сделките с ценни книжа.

1.5.23. **T2S DCA** - Таргет2–Ценни книжа специална парична сметка в ТАРГЕТ – сметка на участника или на агента по сетълмента в ТАРГЕТ, използвана за сетълмент на парични средства по сделки с ДЦК, деноминирани и платими в евро, в платформата T2S.

2. Основни услуги и принципи на функциониране на BNBGSSS.

2.1. Услуги, предоставяни от BNBGSSS.

2.1.1. Основни услуги.

2.1.1.1. Първоначална регистрация в системата за безналични ДЦК (регистрационни услуги);

2.1.1.2. Предоставяне и поддържане на сметките за ДЦК на най-високо ниво (услуги по централно поддържане);

2.1.1.3. Управляване на система за сетълмент на ДЦК (услуги по сетълмент).

2.1.2. Спомагателни услуги от небанков тип.

Спомагателни услуги от небанков тип, предоставяни от BNBGSSS, които не пораждаат кредитен или ликвиден риск:

2.1.2.1. Услуги по сетълмент - съгласуване на инструкции за сетълмент, предаване на инструкции, потвърждаване на сделки, проверка на сделки;

2.1.2.2. Регистрационни услуги и услуги по централно поддържане:

- извършване на корпоративни действия;
- регистрация на нови емисии на държавни ценни книжа;
- предаване и обработка на инструкции, събиране и обработка на такси, както и свързаното с това отчитане;

2.1.2.3. Установяване на връзка с централни депозитари, поддържане и управление на сметки за ДЦК във връзка с услуги по сетълмент и регистрация на обезпечения;

2.1.2.4. Други услуги:

- отчитане във връзка с регулаторните изисквания;
- предоставяне на информация на други дирекции в БНБ, на МФ и международни финансови рейтингови организации.

BNBGSSS не предоставя спомагателни услуги от банков тип.

2.2. Предоставяно ниво на обслужване

С цел безпроблемното, сигурно и ефикасно извършване на предоставяните от BNBGSSS услуги в Приложение № 9 „Предоставяно ниво на обслужване“ е дефинирано нивото на обслужване, което BNBGSSS предоставя на своите участници, както и ключовите показатели свързани с неговото определяне.

2.3. Основни принципи на функциониране на BNBGSSS.

- осигурява автоматизирана обработка от входа до изхода на процеса - Straight-through Processing (STP);

- обработка „сделка по сделка“ в реално време (DVP – Model 1) и цикъл на сетълмент на вторичния ОТС пазар T+0, на регулирания пазар, организиран от Българска Фондова Борса АД - T+2 и от T+0 до T+2 на многостранната система за търговия E-Bond Bulgaria;

- прилагане на принципа на двойното уведомление – по едно искане/уведомление за извършване на сделката от всяка една от страните;

- използване на SWIFT при прилагане на международния стандарт ISO 15022 и WEB интерфейс (базиран на VPN среда) с използване на квалифициран електронен подпис (КЕП) като равнопоставени средства за комуникация;
- използване на международния стандарт за номерация на емисиите ДЦК (ISIN код);
- осъществяване на мониторинг от участниците в реално време на статуса на изпълнение на иницираните от тях искания/уведомления за регистриране на сделки с ДЦК на всеки един етап от обработката;
- автоматично изчисляване на дължимите от емитента главници и лихви по емисии ДЦК, общо и по участници, въз основа на поддържаната база данни и заложените лихвени конвенции и в съответствие с параметрите на всяка емисия;
- автоматично изготвяне на обобщена и детайлна информация за пазара на ДЦК за нуждите на участниците в системата, емитента, статистиката на ЕЦБ и др. посредством разработения в системата статистически модул;
- нотифициране на участниците в системата за обстоятелства, свързани с корпоративни действия, като предстоящи плащания на главници и лихви по ДЦК с настъпващ падеж, както и за извършения сетълмент на същите.

3. Участие в BNBGSSS.

3.1. Участници в BNBGSSS могат да бъдат:

- първични дилъри на ДЦК;
- поддепозитари на ДЦК;
- инвестиционни посредници, които не са първични дилъри и чийто лиценз включва услугите и дейностите съгласно чл. 5, ал. 2, т. 1, 2 и 3 от Закона за пазарите на финансови инструменти, включително и такива от други държави членки;
- банки, които не са първични дилъри и поддепозитари на ДЦК, чийто лиценз включва услугите и дейностите съгласно чл. 2, ал. 2, т. 8 и 9 от Закона за кредитните институции, включително и такива от други държави членки;
- централни депозитари на ценни книжа от държави членки;
- Българската народна банка и други членове на Европейската система на централните банки;
- Министерството на финансите;
- други лица, одобрени от министъра на финансите и управителя на БНБ, които са в обхвата на участниците в системи с окончателност на сетълмента, определени в Директива 98/26/ЕО и въведени в чл. 130 на Закона за платежните услуги и платежните системи.

3.2. Условия за участие в BNBGSSS.

Всеки участник в BNBGSSS трябва да отговаря на изискванията на Наредба № 5 и на тези правила и процедури, като е необходимо да са налице следните условия:

3.2.1. Да притежава лиценз от съответния компетентен орган. Лиценз не се изисква от БНБ, МФ и лицата, одобрени от министъра на финансите и управителя на БНБ.

3.2.2. Да има открита сметка за сетълмент на парични средства в РИНГС и T2S DCA сметка в ТАРГЕТ или да посочи сметка за сетълмент на парични средства на банка в РИНГС и T2S DCA сметка в ТАРГЕТ, които ще се използват за целите на паричния сетълмент по операциите му с ДЦК на база на сключен с банката договор.

3.2.3. Да разполага с технически средства за комуникация, чрез които да изпраща искания и уведомления за сделки с ДЦК на вторичния пазар, както и да получава уведомления и потвърждения от страна на БНБ. Техническите средства за комуникация са SWIFT и веб базиран интерфейс на BNBGSSS, при използване на КЕП. Могат да се използват и други технически средства, но след като Министерството на финансите и БНБ уведомяват участниците, че имат готовност за тяхното въвеждане.

3.2.4. Участникът в BNBGSSS трябва непрекъснато да отговаря и на следните критерии: да разполага с адекватни финансови средства; да има адекватен оперативен и технологичен капацитет; да отговаря на всички изисквания за правоспособност; да разполага с механизми за подходящ вътрешен контрол и управление на риска.

3.3. Документи за участие в BNBGSSS.

Кандидатът за участие подава до БНБ, дирекция „Фискални услуги“, писмено заявление за участие в BNBGSSS по образец - Приложение № 1 към Наредба № 5, подписано от лицата, упълномощени да представляват институцията.

Към заявлението кандидатът за участник трябва да представи и следните документи:

3.3.1. Единен идентификационен код или извлечение от търговския регистър, издадено преди не повече от един месец, считано от датата на подаване на заявлението. Кандидат за участие в BNBGSSS, установен в друга държава членка или в трета страна, прилага съответен документ, еквивалентен на извлечение от търговския регистър, издаден от съдебен или административен орган на държавата, в която е установен. В случай, че съответното национално законодателство на кандидата не предвижда такъв документ, той прилага друг документ, установяващ статуса му. Българската народна банка и МФ са освободени от подаване на такъв документ.

3.3.2. Нотариално заверени спесимени на подписите на лицата, упълномощени да представляват институцията.

3.3.3. Копие от лиценза за банка/инвестиционен посредник.

3.3.4. Искане за откриване на сметки за сетълмент на ДЦК в СДЦК и платформата Таргет2-Ценни книжа приложение № 1 към Наредба № 31.

3.3.5. Бизнес идентификационен код (BIC) на участника, който ще се използва за комуникация с BNBGSSS, и данни за сертификатите за КЕП на потребителите, упълномощени от участника да осъществяват връзка през веб-базирания интерфейс на BNBGSSS.

3.3.6. Списък с лицата, упълномощени да осъществяват контакти при възникнали проблеми във връзка с операции с ДЦК на участника.

3.3.7. В случай, че кандидатът за участник в BNBGSSS е централен депозитар на ценни книжа, съгласно разпоредбите на Наредба № 5:

а) с цел изготвяне на предварителна оценка за съответствието на подадените от депозитара документи с действащото законодателство и Принципите за инфраструктурите на финансовите пазари, приети от CPMI и IOSCO, кандидатът попълва въпросник, въз основа на който се оценяват правните, оперативни и финансови рискове, свързани с очакваната дейност на кандидата като депозитар;

б) за улесняване на директното участие в BNBGSSS кандидатите могат да посочат местен поддепозитар на ДЦК, който да изпълнява функцията на технически оператор на връзката им със Системата от името и за сметка на съответния участник, като осъществява цялата комуникация с BNBGSSS въз основа на сключено помежду им споразумение;

в) техническият оператор изпълнява следните функции:

- от името и за сметка на ЦДЦК подава исканията и уведомленията за сделки с ДЦК в установения срок, формат и структура съгласно изискванията;

- уведомява незабавно БНБ при установяване на данни за грешни вписвания в BNBGSSS от името на ЦДЦК;

- уведомява незабавно БНБ относно промени в обстоятелствата, свързани с участието на ЦДЦК, посочени в заявлението за включване в системата и неговите приложения;

3.3.8. В случай, че кандидатът за участие в BNBGSSS е представител на трета страна, извън Европейския съюз, то той подава заявление и представя документи, аналогични на тези, описани в т. 3.3.1 до т. 3.3.7. Кандидатът за участие, представител на трета страна, извън Европейския съюз посочва характеристиките на законодателството

на страната, в която е регистрирано като юридическо лице, с оглед да се осигури изпълнимост на споразумението за участие и на настоящите правила, като за тази цел предоставя информация и/или документи, които следва да съдържат данни, че:

- правото на съответната държава е в съответствие с и не засяга по какъвто и да е начин задълженията на участника, възникващи от документите на Системата;
- всички разпоредби на документите на Системата са обвързващи и изпълними съгласно правото на съответната държава;
- задълженията, произтичащи от документите на Системата, тяхното изпълнение или спазване преди откриване на производство по несъстоятелност или на друго производство по отношение на участника, не могат да бъдат отменени в такова производство на основание на относителна недействителност, унищожяема сделка или на друго основание съгласно правото на съответната държава;
- в случай на производство по несъстоятелност или друго производство по отношение на участника, правата или активите, прехвърлени с цел обезпечение, или заложи от участника в полза на БНБ или други участници в Системата, ще имат предимство пред вземанията на всички други кредитори на участника, като другите кредитори не могат да се удовлетворят от тях с приоритет.

3.4. Ред и условия при включване на участник в BNBGSSS:

Допускането на участник до Системата се извършва от Комисия за допускане до участие в BNBGSSS, определена в съответствие с Наредба № 5.

3.4.1. Процедури, свързани с дейността на Комисията за допускане до участие в BNBGSSS на кандидатите за участници (Комисията).

3.4.1.1. При постъпило писмено заявление от кандидат за участие в BNBGSSS, Комисията извършва обстоен преглед на представените от кандидата документи и съобщава своето решение на кандидата.

3.4.1.2. В случай, че подадените документи са непълни или неточни Комисията изготвя писмен отговор до кандидата за необходимостта от предоставяне на нова или допълнителна информация.

3.4.1.3. В случай, че документите на кандидат за участник са пълни и коректни, Комисията дава отговор на кандидата в срок до три месеца от получаването на всички необходими документи.

3.4.2. Тестове за допускане до участие в BNBGSSS.

След представяне на всички необходими документи с кандидата се провеждат тестове. Комисията пристъпва към организиране провеждането на тестове за

установяване на техническа готовност на участника за комуникация с BNBGSSS чрез SWIFT и уеб базиран интерфейс.

3.4.3. Подписване на Споразумение за участие между БНБ и Участника и Анекс към него, при необходимост.

След приключването на успешни тестове се подписва двустранен протокол между БНБ и кандидата, отразяващ резултатите от тях. В случай, че кандидатът бъде допуснат до участие в системата се сключва Споразумение за участие в Системата. От страна на БНБ Споразумението, съответно Анекса към него се подписват от подуправителя, ръководещ управление „Банково“.

3.4.4. Включване на участник в BNBGSSS

На база подписаното по т.3.4.3. Споразумение за участие в Системата Комисията уведомява съответните структурни звена в БНБ и МФ за новия участник в Системата и датата, от която същият ще бъде включен, както и за избраната от него банка поддепозитар, в случай че той не изпълнява такива функции.

Въз основа на писменото искане на участника, сключеното Споразумение, и с разрешение на подуправителя, ръководещ управление „Банково“, БНБ включва участника в BNBGSSS и уведомява всички останали участници за името, точния адрес и ВИС-а на новия участник, както и датата, от която същият ще получи пълноправен достъп до системата.

3.4.5. Лица за контакт.

Кандидатът е длъжен да изпрати до дирекция „Фискални услуги“ списък с имената и координатите на лицата (имейл и телефон), които ще отговарят за всяка от дейностите, свързани с:

- координиране на работата с BNBGSSS;
- дейностите, свързани с регистриране и търговията с ДЦК в BNBGSSS;
- техническите, софтуерните и комуникационни средства;
- сигурност;
- връзка със SWIFT.

Дирекция „Фискални услуги“ изготвя и актуализира своевременно списъка на участниците в BNBGSSS на страницата на БНБ в интернет и в меню „Помощ“ на ЕСПОТ. В номенклатурите на системата се въвеждат и актуализират данните на всички потребители на участниците, които имат право да подават искания за сделки/операции с ДЦК по реда на чл. 16, ал. 1 от Наредба № 5.

Дирекция „Фискални услуги“ поддържа актуален регистър с лицата за комуникация. При всяка промяна в списъка с лицата за контакт, участниците в BNBGSSS уведомяват БНБ в най-кратък срок.

3.5. Ред и условия за изключване и временно ограничаване на участието в BNBGSSS

3.5.1. Едностранно прекратяване на достъпа до BNBGSSS на участник от страна на БНБ.

Българската народна банка може едностранно да прекрати достъпа до BNBGSSS на даден участник в един от следните случаи:

- когато е отнет лицензът на участник или е открито производство по несъстоятелност;
- взето е решение от компетентния орган на участника за прекратяване на участието му;
- при вливане или сливане между участници в BNBGSSS;
- когато спрямо участник са наложени мерки, ограничаващи извършването на инвестиционни услуги и дейности.

- в случаите на временно ограничаване на достъпа, по преценка на БНБ, съгласувано с МФ, притежаваните от участника ДЦК и/или от негови клиенти, включително такива с наложена тежест, могат да се прехвърлят служебно при друг участник – поддепозитар на ДЦК, определен от МФ, съгласувано с БНБ. В тези случаи дирекция „Фискални услуги“ може служебно да прехвърля притежаваните от участника ДЦК и/или общо от негови клиенти, включително такива с наложена тежест при друг участник по реда на Наредба № 5 и да предприема действия, които съгласува с МФ.

Дирекция „Фискални услуги“ уведомява писмено всички останали участници в BNBGSSS за изключването на участника.

3.5.2. Временно ограничаване достъпа до BNBGSSS на участник.

Българската народна банка, съгласувано с МФ, може временно да ограничи достъпа до BNBGSSS или изцяло да го прекрати в следните случаи:

- когато установи, че участник е престанал да отговаря на изискванията за участие в BNBGSSS;
- когато участник не изпълнява своите задължения съгласно сключеното Споразумение и Анекса към него за участие в Системата;
- спрямо участник са наложени надзорни мерки, свързани с ограничаване на дейността му или с ограничаване или спиране изпълнението на задълженията му;
- настъпило друго, свързано с участник събитие, което, съгласно преценката на БНБ, би застрашило цялостната стабилност и сигурност на системата, би довело до системен риск, или което би застрашило изпълнението от БНБ на нейните задачи, описани в ЗБНБ.

В случаите на временно ограничаване на достъпа, по преценка на БНБ, съгласувано с МФ, притежаваните от участника ДЦК и/или от негови клиенти, включително такива с наложена тежест, могат да се прехвърлят служебно при друг участник – поддепозитар на ДЦК, определен от МФ, съгласувано с БНБ. В тези случаи дирекция „Фискални услуги“ може служебно да прехвърля притежаваните от участника ДЦК и/или общо от негови клиенти, включително такива с наложена тежест при друг участник по реда на Наредба № 5 и да предприема действия, които съгласува с МФ.

Българската народна банка, след съгласуване с МФ, може да възстанови достъпа на участника и да отмени поставеното ограничение. Дирекция „Фискални услуги“ уведомява писмено всички участници в BNBGSSS за отмяната на ограничението.

3.5.3. Прекратяване достъпа до BNBGSSS по искане на участник

Участник може да прекрати едностранно участието си в BNBGSSS, като се спазват изискванията на Наредба № 5 за прекратяване на участието в системата по искане на участника с едномесечно предизвестие.

При всеки случай на прекратяване на достъпа на участник до BNBGSSS:

- дирекция „Фискални услуги“ уведомява писмено всички останали участници в BNBGSSS за изключването на участника.
- задълженията за поверителност на информацията остават в сила.

3.5.4. Отказ на достъп до BNBGSSS

Българската народна банка може да откаже достъп на кандидат за участие до BNBGSSS, ако кандидатът не отговоря на изискванията за участие в системата, регламентирани в Наредба № 5.

В случай, че кандидат няма да бъде допуснат до участие в BNBGSSS, БНБ изготвя мотивиран отказ в писмена форма, който се предоставя на кандидата. Българската народна банка отказва достъп на участник само, когато този достъп би застрашил безпрепятственото и нормално функциониране на пазара на ДЦК или би породил системен риск. Отказът се изготвя след като се направи цялостна оценка на правните, финансовите и операционните рискове, които биха възникнали за BNBGSSS, в случай че у участникът бъде допуснат до нея.

3.6. Ключови участници

Депозитарят на ДЦК установява ключови участници в системата за регистрация и сетълмент на ДЦК (BNBGSSS) на база данните от предходната календарна година и БНБ ги уведомява писмено за това.

Критериите за определяне на ключовите участници в BNBGSSS и допълнителните изисквания към тях са съгласно Приложение № 8 „Ключови участници в BNBGSSS“.

4. Допустими ценни книжа.

В BNBGSSS се регистрират само ДЦК, емитирани от Министъра на финансите на вътрешния пазар. Държавните ценни книжа са в безналична форма, под формата на счетоводни и електронни записи в програмни системи, удостоверяващи собствеността върху тях.

В зависимост от тяхната срочност емитираните ДЦК могат да бъдат:

- Краткосрочни ДЦК – със срок за изплащане до една година включително;
- Средносрочни ДЦК – със срок на изплащане от една година до пет години включително;
- Дългосрочни ДЦК – със срок на изплащане над пет години.

В платформата T2S се въвеждат данните за всички ДЦК, които са регистрирани в BNBGSSS и са деноминирани и платими в евро.

5. Сметки за ДЦК

5.1. Общи правила за откриване и закриване на сметки за ДЦК

Сметка за сетълмент на ДЦК е сметка при централната банка, използвана за съхраняване на ДЦК и за сетълмент по сделки с ДЦК между участници в BNBGSSS.

5.1.1. Откриване на сметки за сетълмент на ДЦК:

5.1.1.1. При допускане до участие в BNBGSSS кандидатите подават искане за откриване на сметки за сетълмент на ДЦК – приложение № 1 към Наредба № 31. Българската народна банка открива и води сметки за сетълмент на ДЦК, собственост на участниците в системата и техните клиенти.

5.1.1.2. Българската народна банка, дирекция „Главно счетоводство“ открива сметки за сетълмент на ДЦК за всяка емисия ДЦК въз основа на получено писмено искане от дирекция „Фискални услуги“ при първоначалното емитиране на ДЦК, в което се посочва: наименованието на участника в системата, придобил ДЦК на аукцион за своя сметка и/или общо за сметка на свои клиенти; номерът на емисията ДЦК; валутата, в която са емитирани ДЦК.

5.1.1.3. Българската народна банка открива сметка за сетълмент на ДЦК на МФ като емитент на ДЦК, по която се отразяват всички ДЦК от една емисия при нейното първоначално емитиране, при обратно изкупуване на ДЦК преди падежа и при падежирането им.

5.1.1.4. По откритите сметки за сетълмент на ДЦК се отразява извършеният сетълмент на сделките с ДЦК на първичния и вторичния пазар по номинална стойност на ДЦК, предмет на сделката. Сетълментът на сделките с ДЦК е финален, след като се завери сметката за сетълмент на ДЦК на приобретателя в системата СДЦК за ДЦК, деноминирани в лева, и сметката за сетълмент на ДЦК на приобретателя в платформата T2S за ДЦК, деноминирани в евро.

5.1.1.5. Депозитарят на ДДЦК не открива свои сметки за ДЦК. Съгласно нормативната уредба той не притежава собствени ДЦК и не може да използва ДЦК на участниците в BNBGSSS и на техните клиенти.

5.1.2. Закриване на сметки за сетълмент.

Българската народна банка закрива сметките за сетълмент на ДЦК при следните условия:

5.1.2.1. При настъпване на падежа на емисията.

5.1.2.2. При прекратяване участието на участник в BNBGSSS по реда на т. 3.5. от настоящите правила и процедури.

Българската народна банка закрива сметките за сетълмент на ДЦК:

- в СДЦК за ДЦК, деноминирани в лева;
- в платформата T2S – за ДЦК, деноминирани в евро.

5.2. Видове сметки.

Българската народна банка открива и води сметки за сетълмент на ДЦК, както следва:

- сметка за ДЦК, собственост на участници в системата;
- сметка за ДЦК, притежавани общо от клиенти на участници в системата - омнибус сметка. Това е сметка за държавни ценни книжа, която се открива за клиентите на участниците в BNBGSSS. Системата поддържа една обща (омнибус) сметка за всички клиенти на всеки отделен участник в BNBGSSS;

- сметка за ДЦК, собственост на участници в системата с наложена тежест.

5.3. Сметки за сетълмент на ДЦК, деноминирани и платими в лева и в евро.

5.3.1. Сметки за сетълмент на ДЦК, деноминирани и платими в лева.

Българската народна банка открива и води сметки за сетълмент на ДЦК, деноминирани и платими в лева, в СДЦК.

За целите на използване на стандартните SWIFT съобщения за сделки с ДЦК в лева се въвежда 10–цифрен код на регистрите/сметките за ценни книжа на участниците в системата със следната структура (приложение №1 към тези Правила):

NNNNCCCCXX, където:

NNNN - означава вида на регистъра/сметката за ДЦК и приема следните стойности:

9251 - регистър/сметка, по която се водят ДЦК в лева собственост на участника;

9255 - регистър/сметка, по която се водят ДЦК във валута собственост на участника;

9252 - регистър/сметка, по която се водят ДЦК в лева собственост на клиентите на участника;

9257 - регистър/сметка, по която се водят ДЦК във валута собственост на клиентите на участника;

9253 - регистър/сметка, по която се водят ДЦК в лева собственост на участника с наложена тежест;

9258 - регистър/сметка, по която се водят ДЦК във валута собственост на участника с наложена тежест

СССС - код на участника в системата. Когато този номер е 3 цифрен, отпред се прибавя 0.

XX - вида на наложената тежест върху ДЦК на участника, като стойностите са следните:

00 - за ДЦК, блокирани за обезпечаване на бюджетни средства по сметки и депозити на бюджетни организации в банките;

01 - за ДЦК, блокирани при учредяване на залог;

02 - за ДЦК, блокирани при други случаи.

5.3.2. Сметки за сетълмент на ДЦК, деноминирани и платими в евро

Българската народна банка открива и води сметки за сетълмент на ДЦК, деноминирани и платими в евро, в СДЦК и в платформата Таргет2-Ценни книжа.

На всяка сметка за сетълмент на ДЦК, деноминирани в евро, в СДЦК съответства сметка за ДЦК в T2S. Между всяка сметка за сетълмент на ДЦК в T2S се изгражда връзка с Таргет2-Ценни книжа специалната парична сметка.

Сметката за сетълмент на ДЦК в T2S има следната структура:

Пример: Сметка № VNBG9255XXXXXXXXXXYYYYZ, където:

VNBG – код на ДДЦК

9255 - регистър/сметка, по която се водят ДЦК във валута собственост на участника (съгласно описанието на регистри/сметки, направено в т.5.3.1.)

XXXXXXXXXX е код на участника;

YYYY – кратък код на емисията и година на емитиране

Z – контролно число.

5.4. Парични сметки за ДЦК

За целите на паричния сетълмент по сделките/операциите с ДЦК в лева и в евро, всеки участник в BNBGSSS трябва да има открита сметка за сетълмент на парични средства съответно в РИНГС и в ТАРГЕТ.

5.4.1. Парични сметки за ДЦК, деноминирани и платими в лева

Сметките за сетълмент на парични средства по сделки/операции с ДЦК в РИНГС имат следната структура:

Пример: Сметка № BGXXBNBGYYYYYYYYSSSZZ, където

BG е код на държавата ;

XX е контролно число, което служи за проверка на коректността на въведената IBAN сметка;

BNBG – код на БНБ;

YYYYYYYYYY - номер на банковата сметка (9 знака);

SSS – код на участника;

ZZ – идентификатор на вида на сметката.

5.4.2. Парични сметки за ДЦК, деноминирани и платими в евро - Таргет2-Ценни книжа специална парична сметка в ТАРГЕТ (T2S DCA)

T2S DCA сметката има следната структура:

Пример: CBGEURBIC11XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX, където:

C – идентификатор за T2S DCA;

BG – код на държавата;

EUR – валута на сметката;

BIC11 – BIC11 на титуляра на T2S DCA сметката;

XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX – Номер на сметка (до 17 символа максимум). Броят и вида на символите се задават от БНБ.

5.5. Водене на регистри и сметки за ДЦК

5.5.1. В BNBGSSS се водят индивидуални регистри и сметки на участниците в системата и общи (omnibus) сметки за притежаваните от техни клиенти ДЦК. Поддепозитарите на ДЦК водят системи за регистрация на ДЦК, притежавани от техни клиенти и от клиенти на участници, за които изпълняват поддепозитарни функции, както и индивидуални сметки, отчитащи притежаваните ДЦК от тези клиенти.

5.5.2. Поддепозитарите на ДЦК отделят собствените си ДЦК от тези на клиентите, като не отговарят пред кредиторите си с ДЦК на клиентите, за които водят индивидуалните сметки.

Информация за състоянието на сметките за сетълмент на ДЦК се предоставя на

титуляря на сметките:

- ежедневно при движение по тях;
- месечно при поискване.

5.5.3. Задължения на участниците във връзка с паричния сетълмент по операциите с ДЦК на първичен и вторичен пазар.

5.5.3.1. Участниците в системата са задължени да посочват номера на сметката си за сетълмент на парични средства в РИНГС и T2S DCA сметката в ТАРГЕТ.

5.5.3.2. Участниците, които нямат сметка за сетълмент на парични средства в РИНГС, прилагат декларация по образец (приложение № 2 от Наредба № 5), с която избрана от тях банка дава съгласие да бъде банка по сетълмента на участника. Участниците, които нямат T2S DCA сметка в ТАРГЕТ, прилагат декларация по образец (приложение № 2а от Наредба №5) за наличието на сключен договор с избрана от тях банка по сетълмента за извършване на плащания в евро по операциите си с ДЦК чрез T2S DCA сметката в ТАРГЕТ на банката в системен компонент на ТАРГЕТ.

5.5.3.3. За целите на паричния сетълмент в евро всяка банка по сетълмента участник в системния компонент ТАРГЕТ-БНБ или в друг системен компонент на ТАРГЕТ, подава искане до БНБ или друга централна банка за свързване на своята Таргет2-Ценни книжа специална парична сметка в ТАРГЕТ с една или повече сметки за сетълмент на ДЦК.

5.6. Сметки на МФ за операции с ДЦК

В съответствие с изискванията на Наредба № 31 БНБ служебно открива и води в BNBGSSS сметки за сетълмент на ДЦК на името на емитента (МФ) за всяка емисия безналични ДЦК в лева и в евро. Сметките на МФ са:

5.6.1. Сметки за сетълмент на ДЦК на МФ, като емитент на ДЦК – по тях се отразява общото количество ДЦК от една емисия, деноминирана в лева или в евро, по номинална стойност при нейното първоначално емитиране, последващо отваряне, замяна, обратно изкупуване преди падеж и падежиране.

5.6.2. Сметки за ДЦК на МФ, като участник в BNBGSSS – по тях се отразява извършеният сетълмент на сделките с ДЦК, деноминирани в лева и в евро, на вторичния пазар по номинална стойност на ДЦК, предмет на сделката.

5.7. Сетълмент по сметки за ДЦК.

Сетълментът по сметки за ДЦК може да бъде:

- DvP - Доставка срещу плащане;
- FoP - Доставка без плащане;
- PFoD - Плащане без доставка.

6. Операции на първичния и вторичния пазар

6.1. Сетълмент на операциите на първичния пазар.

6.1.1. BNBGSSS въз основа на резултатите от проведен аукцион за ДЦК, постъпили от Автоматизираната система за провеждане на аукциони за ДЦК (АДЦК) чрез изграден за целта интерфейс, генерира съответните сетълмент инструкции за емисията ДЦК, предложена от МФ за продажба/обратно изкупуване /замяна.

6.1.2. В деня на плащането BNBGSSS инициира за сетълмент инструкции за одобрените на аукциона поръчки, включително и за дължимите от участниците такси¹. Служебно се задължават/заверяват сметките за сетълмент на парични средства на участниците в РИНГС, съответно T2S специалните парични сметки в ТАРГЕТ с общата стойност на придобитите/обратно изкупени/заменени от тях и техни клиенти ДЦК, заверява/задължава сметката на емитента при БНБ и същевременно записва/отписва по номинална стойност придобитите/обратно изкупените /заменените ДЦК по сметките за сетълмент на ДЦК на участниците и по сметките за сетълмент на ДЦК, отчитащи придобитите/обратно изкупени/заменени общо от техни клиенти ДЦК.

6.1.3. BNBGSSS регистрира общото количество на придобитите/обратно изкупените/заменените ДЦК, след като завери сметката за сетълмент на ДЦК на МФ в СДЦК.

6.1.4. Дирекция „Фискални услуги“ съгласува с МФ вълъора и размера на предстоящите плащания на главници и/или лихви по ДЦК с настъпващ падеж.

6.1.5. BNBGSSS автоматично изчислява, съгласно лихвените конвенции и условията, при които е емитирана всяка емисия ДЦК, дължимите лихви и/или суми по главницата за всеки участник, на базата на регистрираните ДЦК в СДЦК/T2S по сметките за сетълмент на ДЦК на участниците и по сметките за сетълмент на ДЦК, отчитащи общо ДЦК на техни клиенти. На тази база BNBGSSS генерира сетълмент инструкции за извършване на плащанията.

BNBGSSS не приема, не изчислява и не извършва плащания по ДЦК с отрицателен размер на лихвата.

6.1.6. В деня на плащането BNBGSSS инициира за сетълмент инструкциите за изплащане на лихви и/или главници по ДЦК, като за:

- ДЦК, деноминирани в лева - служебно се задължава сметката за сетълмент на парични средства на МФ в РИНГС и се заверяват съответните парични сметки на

¹ Съгласно Тарифата на БНБ за таксите и комисионите за обработка по сделки с ДЦК.

участниците в РИНГС, като същевременно се отписват падежиращите ДЦК от сметките за сетълмент на ДЦК на участниците в СДЦК и от сметките за сетълмент на ДЦК, отчитащи ДЦК на техни клиенти в СДЦК.

- ДЦК, деноминирани в евро - служебно се задължава T2S DCA сметката на МФ в TARGET и се заверяват съответните T2S DCA сметки на участниците в TARGET, като същевременно се отписват падежиращите се ДЦК от сметките за сетълмент на ДЦК на участниците T2S и от сметките за сетълмент на ДЦК, отчитащи ДЦК на техни клиенти в T2S.

6.1.7. BNBGSSS нотифицира чрез SWIFT участниците в системата за предстоящите плащания на главници и/или лихви по ДЦК с настъпващ падеж, както и в деня на сетълмента - за извършените плащания, със съобщения съответно - MT564 Corporate Action Notification и MT566 Corporate Action Confirmation. 6.1.8. При извършването на плащания по главници и/или лихви и при падеж се спазва т. нар. „замразен период“ - исканията и уведомленията за регистрация на сделки с ДЦК от дадена емисия се приемат до 15:00 ч. и се обработват до 15:30 ч. на системния ден на BNBGSSS, предхождащ падежа на съответната емисия ДЦК или на лихвените плащания по нея.

6.1.8. Инструкциите за сетълмент, свързани с корпоративни действия (изплащане на главници и/или лихви), се подават от BNBGSSS към РИНГС/TARGET в началото на работния ден на датата на плащане, преди всички други инструкции. Инструкциите за сетълмент на корпоративни действия се обработват с най-висок приоритет в началото на системния ден на РИНГС/TARGET.

6.1.10. В инструкциите за сетълмент за ДЦК, деноминирани и платими в евро, изпращани към T2S при аукциони и корпоративни действия, се използва стандарт на SWIFT ISO 20022 и системата от съобщения за комуникация, определена съгласно Правилата на T2S.

6.2. Сетълмент на операциите на вторичния пазар

6.2.1. Общи положения

Всички транзакции, които се изпращат за сетълмент към СДЦК/T2S, се изпълняват след получаване на валидна инструкция (искания/уведомления) от участник в системата, съгласно изискванията на глава трета на Наредба № 5. Всички сключени сделки на вторичния пазар на ДЦК се отразяват в регистрите, след приключване на сетълмента по сметките за сетълмент на парични средства в РИНГС, съответно по T2S специалните парични сметки в TARGET и/или сметките за сетълмент на ДЦК в СДЦК/T2S.

BNBGSSS извършва сетълмента на сделките само на предвидената дата за сетълмент.

6.2.2. Сетълмент на сделки и операции с ДЦК

6.2.2.1. Сетълментът по операциите и сделките с ДЦК, се извършва при прилагане на принципа FIFO (First In, First Out), на брутна база, в реално време (DvP – Model 1), при който трансферът на ДЦК и на парични средства се осъществява едновременно на брутна база и цикъл на сетълмент на вторичния пазар, както следва: за OTC пазара - T+ 0; за сделки, сключени на многостранна система за търговия E-BOND BULGARIA, оперирана от Bloomberg Trading FACILITIES B.V. - T+0; T+1 или T+2; за сделки, сключени на регулирания пазар, организиран от „Българската Фондова Борса“ АД - T+2.

6.2.2.2. Обработка сделка по сделка без движение на парични средства (FoP – free of payment).

6.2.2.3. Системата работи по предварително обявен график на системния ден на BNBGSSS в съответствие с работното време на системите РИНГС и ТАРГЕТ2-Ценни книжа.

6.2.3. Форма и съдържание на инструкциите

Всеки един от участниците в системата, който иска да сключи сделка в BNBGSSS, изпраща инструкции за сетълмент до системата. За всеки вид транзакция (сделка) задължителните и незадължителните полета за попълване и полетата, подлежащи на задължително стиковане, са описани в „Ръководство за външни потребители – участници в ЕСРОТ“.

6.2.3.1. Прилага се принципа на двойното уведомление – по едно искане/уведомление за извършване на сделката от всяка една от страните.

6.2.3.2. Използва се SWIFT при прилагане на международния стандарт ISO 15022 и WEB интерфейс (базиран на VPN среда) с използване на КЕП като равнопоставени средства за комуникация.

6.2.3.3. BNBGSSS извършва автоматична проверка на всички данни, включени в исканията на участниците. Данните са в съответствие с изискванията на Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229 на Комисията от 25 май 2018 година за допълване на Регламент (ЕС) № 909/2014 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на регулаторните технически стандарти за дисциплина при сетълмента (Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229) и са следните: вид на сделката, идентификационни данни на участника, който доставя ДЦК (прехвърлител) или парични средства; идентификационни данни на участника, който получава ДЦК (приобретател) или паричните средства; ISIN номера на емисията ДЦК и валута на ДЦК, предмет на сделката; номиналната стойност на

прехвърляните ДЦК; фактическата сума за плащане (за сделки DVP); дата на сетълмента (вальор) както и вальора и цената на обратното изкупуване (за репо сделки), място за търговия (когато сделката е сключена там).

6.2.3.4. Осъществява се мониторинг от участниците в реално време на статуса на изпълнение на иницираните от тях искания/уведомления за регистриране на сделки с ДЦК на всеки един етап от обработката.

6.2.4. Приоритет на сделки и операции

6.2.4.1. В дните, в които има плащания на главници и лихви по ДЦК с настъпил падеж, репо операции и заеми на ДЦК, както и операции, свързани с придобиване, обратно изкупуване и замяна на ДЦК на първичния пазар, БНБ след отварянето на системния ден на ЕСПОТ ги нарежда за обработка с приоритет при спазване на следната последователност:

- изплащане на главници и лихви по ДЦК с настъпил падеж;
- втората част на предварително договорени репо сделки и падеж на заеми на ДЦК;
- придобиване, обратно изкупуване и замяна на ДЦК на първичния пазар;
- други предварително договорени сделки на вторичния пазар.

6.2.5. Сделки DVP/FOP/PFOD

6.2.5.1. Сделки „delivery versus payment“ (DvP).

Принципът на сетълмент DvP (Доставка срещу плащане) е регламентиран в Наредба № 5 и в Наредба № 31. Сетълментът на транзакции с ДЦК, осъществени чрез DvP, включва едновременно взаимен сетълмент на парични средства и на ДЦК, като при всяка сделка с ДЦК паричните средства са на разположение в момента на сделката.

а) сделките за покупко-продажба на ДЦК, сключени на ОТС пазар, както и договорените на регулиран пазар и многостранна система за търговия (МСТ), се приключват на принципа DvP.

б) репо-сделки с ДЦК между участниците в BNBGSSS се сключват на принципа DvP.

в) на принципа DvP се приключват и сделки, сключени между участници и техни клиенти, както следва:

- репо сделка с ДЦК между участниците в BNBGSSS
- сделка за покупко-продажба на ДЦК от клиент на един участник в BNBGSSS на друг участник в BNBGSSS.
- сделка за покупко-продажба на ДЦК от клиент на един участник в BNBGSSS на клиент на друг участник в BNBGSSS.

- сделка за покупко-продажба на ДЦК от един участник в BNBGSSS на клиент на друг участник в BNBGSSS.

6.2.5.2. Сделки „free of payment“ (FoP).

Сделките на вторичен пазар между участници в системата и техни клиенти и между клиенти на участници в BNBGSSS се извършват на принципа FoP, без движение по сметките за сетълмент на парични средства в РИНГС, съответно в ТАРГЕТ, като движението е само по сметките за сетълмент на ДЦК. Видовете сделки, които се приключват на принципа FoP от BNBGSSS са:

- заем на ДЦК;
- други сделки или операции за прехвърляне на ДЦК, включително: прехвърляне на ДЦК по регистри между участници; прехвърляне на ДЦК по клиентски регистри; прехвърляне на ДЦК по сметка съгласно Наредба № 31; реализация на заложен ДЦК в случаите на пристъпване към изпълнение по реда на Закона за особените залози; други сделки или операции за прехвърляне на ДЦК.

6.2.5.3. Операции за заплащане без доставка PFOD

Тези инструкции се изпращат от BNBGSSS при изплащане на лихви и главници по ДЦК с настъпил падеж. Извършва се превод на парични средства по сметките на участниците в системата, без обратно прехвърляне на ДЦК.

6.2.6. Операции по блокиране и деблокиране на ДЦК (FoP)

Блокирането на ДЦК в BNBGSSS, което има действие на законен залог върху тях в полза на МФ, или тяхното деблокиране, се извършва по искане на участниците в системата, изпратено до БНБ, съгласно изискванията на Наредба № 5 в сроковете, определени съвместно от МФ и БНБ. При операциите по блокиране и деблокиране се прехвърлят ДЦК от собствената сметка на участник по сметка на участника с наложена тежест, в случаите:

- при вписване в РОЗ на обстоятелства относно залог върху ДЦК;
- обезпечаване на бюджетни средства по чл.152, ал.3 от Закона за публичните финанси;
- в други случаи.

Блокиране, съответно деблокиране на ДЦК, се извършва въз основа на искане, изпратено от участника в BNBGSSS чрез техническите средства за комуникация, определени съгласно Наредба № 5, като:

- исканията се изпращат в БНБ и се обработват в срока, определен в Указанията ;
- получените искания се подлагат незабавно на входяща проверка, аналогично на всички искания, постъпващи в BNBGSSS. В случай че се установи грешка искането

се отхвърля, като се уведомява участника. Участниците могат да изпращат нови искания, като за по-нататъшна обработка се допускат само преминалите успешно входяща проверка;

- при успешна входяща проверка, исканията стават неотменяеми;

- извършва се проверка в BNBGSSS дали банката притежава необходимото количество ДЦК от съответната емисия посочена в искането за блокиране (деблокиране). В случай че до срока определен в Указанията, банката не осигури необходимото количество ДЦК, посочени в искането, то се отказва, като участникът се уведомява за причините за отказа;

- при наличие на необходимото количество ДЦК за изпълнение на искането, BNBGSSS генерира мемориални ордери за блокиране/деблокиране на ДЦК по съответните сметки за ДЦК с наложена тежест, водени в СДЦК, и ги предава за сетълмент. След приключването на сетълмента, блокирането/деблокирането се потвърждава в регистъра на участника, по реда на Наредба № 5;

- на банката се предоставя електронно копие на осчетоводения мемориален ордер, който служи за потвърждение, че блокирането (деблокирането) на ДЦК е извършено.

6.2.7. Кодове на видовете сделки/операции по реда на Наредба № 5.

Кодовете на видовете сделки са описани в Приложение № 2 към Правилата и процедурите.

6.2.8. Сетълментът за ДЦК, деноминирани в евро, се извършва в платформата T2S:

- при спазване на Правилата за работа в T2S.

- като графикът на системния ден е съобразен с работното време на T2S (Приложение № 7 към настоящите Правила).

- в инструкциите за сетълмент за ДЦК, деноминирани и платими в евро, изпращани към T2S се използва стандарт на SWIFT ISO 20022 и системата от съобщения за комуникация, определена съгласно Правилата на T2S.

7. Блокиране и деблокиране на ДЦК при вписване на залог в РОЗ и обезпечаване на средства по сметки и депозити на бюджетни предприятия в обслужващи банки

7.1. Регистър на особените залози

В РОЗ, създаден в БНБ в съответствие със закона за особените залози (ЗОЗ) и Наредба №5, се вписват обстоятелства относно залози върху безналични ДЦК, собственост на участниците в BNBGSSS, водени по регистрите им по реда на Наредба №5. При вписване на залога, ДЦК се блокират, като извършването на сделки на

разпореждане с тях от страна на залогодателя се преустановява или е възможно само със съгласието на заложния кредитор. При заличаване на залога ДЦК се деблокират.

Регистърът на особените залози е самостоятелна информационна система с единна база данни, която съдържа информация за всяко извършено вписване. Системата има изграден интерфейс за автоматизиран обмен на данни с BNBGSSS, който осигурява възможност за:

- автоматично изпращане на искане към BNBGSSS при всяко вписване в РОЗ за проверка за наличие на ДЦК, предмет на залога, и за генериране на инструкция от страна на BNBGSSS за тяхното блокиране/деблокиране по сметките за ДЦК с наложена тежест;
- автоматично потвърждаване на вписването в РОЗ след получаване на информация от BNBGSSS за извършеното блокиране/деблокиране на ДЦК;
- автоматично генериране на различни справки, потвърждения, откази и удостоверения по вписани залози върху ДЦК;
- ежедневна реконсиляция на данните между РОЗ и BNBGSSS.

Дейността по вписванията в РОЗ на обстоятелства относно залози върху безналични ДЦК се осъществява, при спазване изискванията на Наредба № 5 и Вътрешните правила за регистриране и обслужване на залози върху безналични ДЦК.

За услугите, свързани с обслужването на особени залози върху ДЦК в РОЗ, БНБ събира служебно такси в полза на Републиканския бюджет, съгласно Тарифата за таксите, събирани по ЗОЗ от Централния регистър на особените залози.

7.2. Създаване на залог

При залагане на ДЦК те се блокират по сметка за ДЦК с наложена тежест, собственост на участника в BNBGSSS, като разпореждането с тях, от страна на залогодателя, се преустановява. Съгласно изискванията на Наредба № 5 извършването на сделки на разпореждане от страна на залогодателя със заложените ДЦК е възможно само със съгласието на заложния кредитор.

7.3. Вписвания в РОЗ

Вписванията в РОЗ се извършват в съответствие със ЗОЗ, Правилника за устройството и дейността на централния регистър на особените залози към Министерството на правосъдието (ПУДЦПРОЗМП), Наредба № 5 и Наредба № 31.

7.4. Изплащане на лихви и обратно изкупуване на заложен ценни книжа

Начинът на плащане на главницата и лихвите по заложените ДЦК се урежда с тристранен договор между БНБ, залогодателя и заложния кредитор съгласно изискванията на Наредба № 5, като при настъпване на лихвено плащане и /или падеж БНБ превежда дължимата лихва по посочената в Тристранния договор сметка.

7.5. Блокиране и деблокиране на ДЦК за обезпечаване на средства по сметки и депозити на бюджетни организации в обслужващи банки

7.5.1. Банките обезпечават в пълен размер наличните парични средства по всички обслужвани от тях сметки и депозити в левове и във валута на бюджетните организации, включително акредитиви в полза на МФ съгласно чл. 152, ал. 1 от Закона за публичните финанси (ЗПФ).

7.5.2. Обезпечаването по т. 7.5.1 се извършва чрез блокиране на ДЦК по дълг на Република България (вътрешен и външен). Блокирането на ценни книжа по вътрешния дълг се извършва при БНБ и има действие на законен особен залог върху тях в полза на МФ. Блокират се държавни ценни книжа, свободни от всякакви тежести и обезпечения. Банките деблокират ДЦК само при условие, че това не води до временен недостиг на обезпечение на наличните парични средства на бюджетните организации по сметки при тях съгласно чл. 152, ал. 2 от ЗПФ.

7.5.3. Държавните ценните книжа по предходната точка, които са регистрирани в BNBGSSS, се блокират, съответно деблокират, въз основа на искане за това, отправено от обслужващата банка.

7.5.4. Блокирането/деблокирането на ДЦК в BNBGSSS за обезпечаване на наличните парични средства по всички сметки, депозити и акредитиви в левове и валута на бюджетните организации, включително на общините в банките се извършва в съответствие със Съвместни указания на министъра на финансите и управителя на БНБ – ДДС № 04/28.03.2022 г. (№ БНБ-35283/28.03.2022 г.) относно изготвянето и предоставянето от банките на периодична информация за операциите и наличностите по сметките на бюджетните организации и начина за регулация на ежедневното обезпечение на тези наличности от банките.

7.5.5. Ежедневно, чрез BNBGSSS, се изготвя справка за стойността на обезпечението с ДЦК, блокирани в BNBGSSS за всеки от участниците, обслужващи бюджетни наличности. Справките се предоставят на всеки участник чрез меню „Писма и документи“ в Системата.

7.5.6. При сделки за блокиране и деблокиране на ДЦК, деноминирани в евро, същите се отразяват в регистрите, след приключване на сетълмента по сметките за сетълмент на парични средства в РИНГС, съответно по T2S специалните парични сметки в ТАРГЕТ и/или сметките за сетълмент на ДЦК в СДЦК/T2S.

8. Обработка на сделки и сетълмент

8.1. Работни дни на системата

Календарът и графикът на BNBGSSS са съобразени с тези на РИНГС и TARGET2 – Ценни книжа, като опцията за нощен сетълмент в T2S не се използва.

Сетълмент в BNBGSSS на сделки с ДЦК, деноминирани в лева, не се извършва в събота и в неделя и на всички официални национални празници на Република България.

Сетълмент в BNBGSSS на сделки с ДЦК, деноминирани в евро, не се извършва в събота и в неделя и в следните дни: 1 януари (Нова година), Разпети петък и Великденски понеделник (според календара на Католическата църква), 1 май, 25 и 26 декември (Коледа).

Графикът е описан в Приложение № 7 към тези Правила

8.2. Правила при обработката на сделки с ДЦК

8.2.1. Средства за комуникация при нормални условия за работа

При нормални условия за работа на BNBGSSS се използват следните равнопоставени средства за комуникация:

- SWIFT при прилагане на международния стандарт ISO 15022;
- WEB интерфейс (базиран на VPN среда) с използване на КЕП

8.2.1.1. Типовете SWIFT (ISO 15022) съобщения, използвани от BNBGSSS са описани в Приложение № 3 към Правилата и процедурите.

8.2.1.2. Валидните типове SWIFT (ISO 15022) входящи съобщения за съответните видове сделки са описани в Приложение № 4 към Правилата и процедурите.

8.2.1.3. Типове отговори на входящи SWIFT съобщения са описани в Приложение № 5 на Правилата и процедурите. Кодовете на грешки при проверка и обработка на SWIFT съобщения са описани в Приложение № 6 на тези Правила.

В „Ръководство за работа с ЕСПОТ за външни потребители - участници в системата“ са описани видовете сделки, извършвани от системата, формите за въвеждане на искания/уведомления от участниците, формата на SWIFT съобщенията, списък с кодове сделки и операции, грешките при обработка на подадени данни в системата и др.

8.2.1.4. За ДЦК, деноминирани в евро, комуникацията с T2S се осъществява чрез съобщения в XML формат, съгласно изискванията на платформата, като се използва стандарт на типовете съобщения ISO 20022.

8.2.1.5. При сделки, сключени на:

- регулиран пазар, организиран от БФБ - БФБ изпраща ежедневно отчет с информация за сключените сделки с ДЦК по електронен път чрез защитен информационен канал. За защита на преноса на данни между инфраструктурите на БНБ

и БФБ се конфигурира IPSec VPN тунел с параметри на криптиране и автентикация, покриваща приетите регулации;

- многостранна система за търговия (МСТ) E-BOND-BULGARIA, оперирана от Bloomberg – за мониторинг на сделките с ДЦК, ДДЦК разполага с терминал на Bloomberg, а ежедневният отчет за сключените сделки е достъпен чрез сървър на Bloomberg.

8.2.2. Подаване на искания за обработка на сделки/операции на вторичния пазар на ДЦК

8.2.2.1. Двустранни искания/уведомления

Регистрирането на сделките/операциите с ДЦК на вторичния пазар се извършва въз основа на искания, изпратени до BNBGSSS чрез едно от двете средства за комуникация от двете страни по сделката – приобретателя и прехвърлителя, съответно заемополучателя и заемодателя.

При постъпило в BNBGSSS съобщение чрез SWIFT за сделки от типа MT540 до MT543:

- в случай, че съобщението е коректно, то се приема от системата като му се присъжда статут **Not Matched**;

- в случай, че съобщението не може да бъде разчетено или Системата установи грешки в него, съгласно приложената номенклатура, същото се отказва от Системата, като му се присъжда статут **Rejected**. Получено съобщение за сделка, което е било разчетено (от допустим за Системата вид), също така се отказва и му се присъжда статут **Rejected** в случаите, когато на участник е била наложена временна или постоянна мярка за ограничаване на участието му в BNBGSSS. На изпращача на съобщението се връща съобщение (MT548), в което се посочва кода на грешката или причината за недопускането му в Системата.

- Подаване на искания за ДЦК, деноминирани в евро.

За ДЦК, деноминирани в евро, ДДЦК прилага правилата на T2S за стиковане на исканията за сделки/сетълмент инструкции.

Участниците в BNBGSSS изпращат искания в BNBGSSS за различните видове сделки, по реда на Наредба № 5. Исканията за сделки/инструкции за сетълмент до BNBGSSS се изпращат чрез съобщения в MT format (стандарт ISO 15022) в SWIFT и уеббазирания интерфейс на системата при използване на квалифициран електронен подпис (КЕП). След предварително валидиране и стиковане на исканията BNBGSSS изпраща сетълмент инструкциите към T2S в XML format (стандарт ISO 20022), при спазване на Правилата за работа в T2S.

8.2.2.2. Входяща проверка на исканията.

- Входяща проверка на исканията за сделки за ДЦК деноминирани в лева:

Исканията за сделки се изпращат в БНБ и се обработват в рамките на системния ден. Получените искания се подлагат незабавно на входяща проверка, включваща проверка на техния формат, проверка на ключови думи, идентифициращи съответните реквизити, и проверка на датата и часа на получаване. В случай, че в резултат на проверката се установи грешка, искането се отхвърля, като се изпраща съобщение за отхвърлянето до участника, подал искането. Участниците могат да изпращат нови искания за същите сделки, като за по-нататъшна обработка се допускат само преминалите успешно входяща проверка. Последните се съхраняват до вальора на изпълнението им (бъдещ вальор).

- Входяща проверка на исканията за сделки за ДЦК, деноминирани в евро:

С включването на ДЦК към платформата T2S входящата проверка на исканията за ДЦК, деноминирани в евро, се извършва както следва:

BNBGSSS извършва предварителна проверка на инструкциите за сетълмент преди да бъдат изпратени в платформата T2S.

Преминалите успешна предварителна проверка инструкции за сетълмент се изпращат към платформата T2S. Всяка инструкция, получена в T2S, се подлага на набор от проверки, с цел потвърждаване на инструкцията в съответствие с техническите изисквания на платформата T2S.

В случай, че резултатът от тези проверки установи грешки или несъответствия, инструкцията се отхвърля, като съобщенията за отхвърляне се изпращат до подателя на инструкцията - BNBGSSS.

BNBGSSS изпраща съобщение за грешка на съответния участник, генерал съответната инструкция.

8.2.2.3. Съпоставяне на исканията. Отказване на исканията

При успешна входяща проверка БНБ проверява дали данните, съдържащи се в исканията, съвпадат. Задължителните за съвпадение полета трябва да присъстват и да са идентични и в двете инструкции. БНБ извършва технически подготвителен процес на стиковане на исканията за ДЦК, деноминирани в евро, което не замества последващото стиковане на инструкциите в T2S. Стиковането на инструкциите за ДЦК, деноминирани в евро, се извършва на база задължителни, допълнителни и опционални критерии за стиковане на T2S. В рамките на системния ден на BNBGSSS участниците могат да анулират свои искания, данните в които не са съвпаднали. В случай, че до приключването

на системния ден на BNBGSSS данните в исканията не са съвпаднали, исканията се отказват, като участниците се уведомяват за причините за отказа, като:

- ако искания, изискващи двустранно уведомление, се стиковат, т.е има пълно съвпадение на данните в исканията за сделки от двамата участници, транзакцията получава статус „matched“ в BNBGSSS за ДЦК, деноминирани в лева или в T2S за ДЦК, деноминирани евро. Исканията със статут **Matched** не могат да се канцелират (отказват) едностранно;

- след изтичане на крайния срок за получаване на искания, изискващи двустранно уведомление, за съответния сетълмент валъор, нестикованите съобщения се канцелират (отказват) автоматично от системата, като им се присъжда статут **Cancelled by the system**. Участниците, които са ги изпратили, се уведомяват за това със съобщение (MT548).

8.2.2.4. Потвърждаване на искания:

- когато стиковани искания бъдат обработени от Системата, на всяко от тях се присъжда статут **Settled** и на участниците, изпратили съобщенията, се изпращат потвърждения за това (MT544 до MT 547);

- когато стиковани искания не могат да бъдат обработени до края на системния ден на искания валъор поради липса на ценни книжа, средства или други причини, те се отказват като им се присъжда статут **Cancelled by the system** и на техните изпращачи се изпращат съобщения (MT548) с причините за отказа - липса на ценни книжа, липса на парични средства или други причини. В случай, че причините за отказа са липса на ДЦК или на парични средства, стикованите искания не се анулират, а БНБ инициира повторно инструкции за сетълмент в срок от четири работни дни за ДЦК, деноминирани в лева, и в срок от 60 дни за ДЦК, деноминирани в евро.

8.2.2.5. Анулиране на сделки.

Процедурата за обработка на съобщения за канцелиране (отказване) на сделки с ДЦК, изискващи двустранно уведомление, изпращани до BNBGSSS чрез SWIFT или Web-базиран интерфейс е следната:

При постъпване на SWIFT съобщение от типа MT540 до MT543 с функция на съобщението "CANC":

- в случай, че съобщението не може да бъде разчетено или Системата установи грешки съгласно приложената номенклатура, включително опит да се канцелира (отказва) несъществуващо или стиковано съобщение, то се отказва от Системата, като му се присъжда статут **Rejected**;

- в случай на получено от участник съобщение за канцелиране (отказване) на сделка, което е било разчетено и е от допустим за системата вид, същото се отказва от Системата, като му се присъжда статут **Rejected**, когато на участник е била наложена временна или постоянна мярка за ограничаване на участието му в Системата. На изпращача на съобщението се връща съобщение (MT548), в което се посочва кода на грешката или причината за недопускането му в BNBGSSS;

- в случай, че не са констатирани недопустими стойности, съобщението за канцелиране се приема от Системата като му се присъжда статут **Accepted** и се пристъпва към канцелиране на указаното в него искане за сделка. Когато последното се канцелира (откаже), му се присъжда статут **Cancelled by participant** и се изпраща съобщение (MT548) на изпращача му за това.

- За ДЦК, деноминирани в евро, канцелирането на искания се извършва аналогично на това за ДЦК, деноминирани в лева, като BNBGSSS изпраща SWIFT съобщения (стандарт ISO 20022) до T2S и получава съобщения от платформата за канцелирано искане, като се спазват Правилата на T2S.

8.2.2.6. Процедури по обработка на сделки при промяна на работните дни.

- при обявяване на работен ден за неработен, всички предварително подадени и приети окончателни сделки или репо сделки с бъдещ вальор на тази дата, по които не е осъществен сетълмент, се канцелират от Системата, като се изпраща съобщение с един от следните кодове на грешка: **004** – посочен е вальор на сделка, който е неработен ден; **095** – репо вальорът е неработен ден;

- при обявяване за неработен ден на работен ден, на който се пада репо вальор на репо сделка, чиято първа част е с вече осъществен сетълмент, репо вальорът се измества от системата на следващия работен ден. Ако следващият работен ден е дата, на която сделката не може да се осъществи поради предстоящо лихвено плащане или падеж на дадената емисия, втората част на репо сделката се отказва, като се изпраща съобщение с един от следните кодове на грешка: **028** – посочен е вальор на втората част на репо сделката, който е невъзможен поради предстоящо лихвено плащане или падеж; **096** - ако е посочена бъдеща дата по-голяма или равна на датата на падежиране на емисията.

8.2.2.7. Корекция на грешни записи

При установяване на данни за грешни вписвания в BNBGSSS, БНБ извършва незабавна проверка, спазвайки изискванията на Наредба № 15.

- в случай че при проверката на данните в исканията се установи, че в Системата е извършено погрешно вписване от БНБ, то тя извършва служебно коригиращи операции с текущ вальор, като уведомява участника/участниците в Системата за това.

- в случай че при проверката се установи, че погрешното вписване в Системата е резултат от изпълнено искане/уведомление от участници в нея, изпратено по реда на глава трета и четвърта на Наредба № 5, БНБ извършва коригиращи операции с текущ вальор въз основа на получено от участниците искане/уведомление.

Българската народна банка не отговаря за вреди, свързани с регистрацията и сетълмента на сделки с ДЦК, причинени в резултат на непълна, невярна или неточна информация, предоставена от участниците в BNBGSSS.

8.2.2.8. Момент на въвеждане и момент на неотменимост на исканията/уведомленията

- Момент на въвеждане на исканията/уведомления - успешна входяща проверка на искания за сделки в съответствие с техническите изисквания на системата за ДЦК, деноминирани в лева и критериите за валидиране на T2S за ДЦК, деноминирани в евро. В случай, че исканията не отговарят на изискванията, определени в Наредба № 5, те получават отказ и не се регистрират в системата.

- Момент на неотменимост на исканията/уведомленията - когато има пълно съвпадение на данните в исканията за сделки от двамата участници, исканията получават статус **Matched** в BNBGSSS за ДЦК, деноминирани в лева или в T2S за ДЦК, деноминирани евро и стават неотменими. В случай че искането е едностранно, моментът на въвеждане и моментът на неотменимост съвпадат (при сделки за блокиране/деблокиране, прехвърляне на ДЦК на клиент и др.).

Българската народна банка проверява в регистрите по реда на Наредба № 5 дали прехвърлителят, съответно заемодателят, притежава ДЦК, предмет на сделката, и дали същите не са блокирани. Същата проверка се извършва и в деня на вальора на обратното изкупуване, съответно вальора на падежа на заема. В случай, че тези изисквания не са налице до приключване на системния ден на BNBGSSS, се прилагат процедурите за неуспешен сетълмент.

8.2.2.9. Окончателност на сетълмента

Сетълментът на сделките с ДЦК е окончателен (финален), след като се завери сметката за сетълмент на ДЦК на приобретателя в системата СДЦК за ДЦК, деноминирани в лева, и сметката за сетълмент на ДЦК на приобретателя в платформата T2S за ДЦК, деноминирани в евро, съгласно изискванията на Наредба № 31.

8.2.2.10. Частичен сетълмент

BNBGSSS е в дерогация по отношение на изискванията за частичен сетълмент по реда на чл. 12 от Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229 на Комисията от 25 май 2018 година за допълване на Регламент (ЕС) № 909/2014 на Европейския парламент и на

Съвета по отношение на регулаторните технически стандарти за дисциплина при сетълмента.

9. Мерки за предотвратяване на неуспешен сетълмент.

9.1. Установяване на процедури от ДЦК.

ДЦК установява процедури, които улесняват сетълмента на предвидената дата за сетълмент. За целта ДЦК изисква от участниците да извършват сетълмент на сделките на предвидената за това дата. Принципите на обработка и сетълмент на операциите на вторичния пазар са описани в т.6.2. от настоящите Правила.

9.2. Мерки предприемани от участниците в BNBGSSS

Участниците в BNBGSSS предприемат всички необходими мерки за предотвратяване на случаите на неуспешен сетълмент и гарантират, че разполагат с достатъчно налични ДЦК или парични средства, като по този начин се гарантира сетълмента на всяка транзакция да се извърши на определената дата.

9.3. Мерки за справяне с неуспешен сетълмент.

9.3.1. В случай, че сетълмент не може да се извърши на предвидената дата поради липса на ДЦК или на парични средства, съгласно изискванията на Наредба № 31, БНБ инициира повторно инструкциите за сетълмент на ДЦК ежедневно в срок от четири работни дни за ДЦК, деноминирани и платими в лева и в съответствие с правилата на платформата T2S за ДЦК, деноминирани и платими в евро.

9.3.2. Повторно инициране на инструкции при неуспешен сетълмент на ДЦК не се прилага в случаите, когато вальорът на репо сделката и вальорът на падежа на заема е на дата, по-ранна от определения четиридневен срок.

9.3.3. Участниците в BNBGSSS могат двустранно да отменят вече стиковани инструкции за сетълмент, които са част от една и съща сделка и чийто сетълмент е бил неуспешен в срока, посочен в точка 9.3.1.

9.3.4. За всяка инструкция за сетълмент, по която сетълментът е бил неуспешен, БНБ начислява наказателна лихва на участника, причинил неуспешния сетълмент. Механизмът за изчисляване на наказателната лихва, е описан подробно в Глава 4а, на Наредба № 31.

9.3.5. Наказателната лихва се начислява и удържа в края на всеки работен ден, в който не е извършен сетълментът по инструкцията за сетълмент, като се спазват изискванията на Глава 4а на Наредба № 31.

9.3.6. Наказателната лихва се събира служебно от БНБ и се превежда на участника, засегнат от неуспешния сетълмент съгласно изискванията на Наредба № 31.

9.3.7. В случай, че на регулиран пазар или на многостранна система за търговия

не е налична пазарна стойност за съответната емисия ДЦК или същата е под номинала на ДЦК, при изчислението на наказателната лихва се използва номиналната стойност на ДЦК.

9.4. Докладване случаите на неуспешен сетълмент

ДДЦК установява система за наблюдение на случаите на неуспешен сетълмент и незабавно уведомява компетентния орган в случай на неуспешен сетълмент.

Българската народна банка публикува ежегодно на интернет страницата си данни, съгласно приложение III от Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229 за случаите на неуспешен сетълмент, и ги докладва на Министерство на финансите.

Българската народна банка, съгласувано с МФ, има право временно да ограничи или да изключи участник от системата, в случай че същият системно не доставя ДЦК.

10. Правила и процедури при неизпълнение от страна на участник.

10.1. Въз основа на получено уведомление от компетентния орган или такова, получено по реда на чл. 6 от Директива 98/26/ЕО

С цел намаляване на системния риск ДДЦК временно ограничава достъпа до системата или изцяло го прекратява когато спрямо участник в нея са предприети действия по отнемане на лиценз; открито е производство по несъстоятелност; в случаите, предвидени в закон, са наложени мерки, ограничаващи дейността му изцяло или частично: взето е решение от компетентния орган на участник за прекратяването му; при вливане или сливане между участници в BNBGSSS; наложени са мерки в съответствие с предвидени в закон случаи, ограничаващи извършването на инвестиционни услуги и дейности, както и когато същият е престанал да отговаря на изискванията за участие в BNBGSSS и не изпълнява своите задължения.

10.2. Мерки при открито производство по несъстоятелност

При открито производство по несъстоятелност по отношение на участник в BNBGSSS Депозитарят на ДЦК извършва следните действия:

10.2.1. Незабавно прекратява/временно ограничава достъпа на участника до BNBGSSS, с което се преустановява възможността участникът да изпраща към Системата искания/уведомления за сделки с ДЦК.

10.2.2. Не обработва искания/уведомления и не се извършва сетълмент на сделки с ДЦК, които са подадени след момента, в който в ДДЦК е получено уведомление, че е открито производство по несъстоятелност.

10.2.3. Въведените в Системата искания/уведомления за сделки с ДЦК, преди момента на получаване на уведомлението за откриване на производството по несъстоятелност, се обработват в рамките на системния ден.

10.2.4. Незабавно уведомява МФ за възникналите обстоятелства.

10.2.5. Прехвърля служебно притежаваните от участника ДЦК и общо от негови клиенти, включително такива с наложена тежест, при друг участник – поддепозитар на ДЦК, определен от МФ, съгласувано с БНБ.

10.2.6. Депозитарят на ДЦК може да не преведе по сметките за сетълмент на парични средства в РИНГС, съответно в ТАРГЕТ2-Ценни книжа, посочени от участник в BNBGSSS, на падежа на съответната емисия ДЦК или на лихвените плащания по ДЦК необходимите средства за изплащането, когато по реда на чл. 6 от Наредба № 5 е прекратен или временно ограничен достъпа на участника в BNBGSSS и към него са предприети действия, както и при наличие на мотивирано предложение за това от министъра на финансите във връзка с данни за забавяне или неизпълнение на задълженията по чл. 35 на Наредба № 5. В тези случаи МФ, съгласувано с БНБ, незабавно определя поддепозитар, който да извършва плащанията на ДЦК и на лихвите по тях на клиентите на участника, към който са предприети посочените действия.

Депозитарят на ДЦК следва да уведоми за предприетите от него действия във възможно най-кратък срок след установяване на неизпълнение на участник в оперираната от ДДЦК система: изпълняващия дейностите по надзор орган, Европейския орган по ценни книжа и пазари (ЕОЦКП), своите участници, които не са в неизпълнение, местата за търговия, с които има установена връзка, оператора на T2S и свързаните депозитари на ценни книжа. Депозитарят на ДЦК поддържа актуална информация за контакт с гореописаните лица.

10.2.7. Депозитарят на ДЦК, съвместно с участниците в Системата, извършва тестове и преглед на правилата и процедурите при неизпълнение, както и на комуникационните процедури, за да гарантира тяхната целесъобразност и ефективност, в следните случаи:

- най-малко веднъж годишно, като профилактика на системата;
- по повод настъпили съществени промени в системата;
- след оперативни инциденти, засягащи безпрепятствено предоставяне на услуги от страна на ДДЦК.

Тестовете се провеждат при предварително определени параметри, като се вземат предвид различни типове участници - участници, намиращи се в различни държави, участници, притежаващи различни видове сметки, съответни пазарни инфраструктури, когато е уместно. Резултатите от проведените тестове и прегледа на правилата и процедурите се документират с уведомление от началник отдел „Депозитар на ДЦК“ до директор дирекция „Фискални услуги“.

Когато проведен тест разкрие евентуални слабости в правилата и процедурите при неизпълнение, ДДЦК следва да направи необходимите изменения в тях. Резултатите от такива тестове и предвижданите промени в правилата и процедурите за неизпълнение, следва да се предоставят на ръководния орган и комитета за управление на риска.

Когато тестът покаже недостатъчно познания или готовност за прилагане на правилата и процедурите при неизпълнение от участници в ДДЦК или други пазарни инфраструктури, ДДЦК следва да направи необходимото за надлежното уведомяване на тези субекти, за да предприемат действия за отстраняване на тези слабости. ДДЦК уведомява засегнатите участници по имейл от регистъра воден по т.3.4.5.

11. Мерки в случаи на преструктуриране.

Предприемането на мерки за предотвратяване на кризи или на мерки за управление на кризи по смисъла на Закона за възстановяване и преструктуриране на кредитни институции и инвестиционни посредници по отношение на участник в BNBGSSS, не е самостоятелно основание да се приеме, че участникът не отговаря на изискванията за участие в BNBGSSS или не изпълнява задълженията си по Споразумението за участие в Системата и Анекса към него, и в този смисъл това обстоятелство не представлява причина за временно или изцяло прекратяване на участието в Системата.

12. Такси и комисиони

Българската народна банка събира такси и комисиони за услугите в BNBGSSS съгласно Тарифата на БНБ за таксите и комисионите за обработка на сделки с ДЦК.

Таксите, които се начисляват за предоставените чрез BNBGSSS услуги, са:

- месечни такси;
- такси при сделки с ДЦК на първичен и вторичен пазар.

12.1. Месечни такси

1.1.1. Месечни такси за участие в електронните системи, оперирани от ДДЦК.

12.1.2. Месечни такси за поддръжка на регистър, откриване, водене и закриване на сметки на ДЦК.

12.2. Такси при сделки с ДЦК на първичен и вторичен пазар

12.2.1. Такси и комисиони за обработка на документи за участие в аукциони, регистрация и сетълмент на ДЦК на първичния пазар и при падеж на емисии.

12.2.2. Такси за регистрация и сетълмент на сделки с ДЦК на вторичен пазар, такси за блокиране и деблокиране на ДЦК, такси за извлечение на справка-извлечение от регистъра.

Българската народна банка си запазва правото да променя размера на таксите и

комисионите в зависимост от състоянието на финансовия пазар.

13. Права и задължения на БНБ като собственик и оператор на BNBGSSS

13.1. Права и задължения на БНБ при организиране, регулиране и контролиране на BNBGSSS.

Българската народна банка:

13.1.1. Определя реда за участие в BNBGSSS.

13.1.2. Разработва и издава правилата и процедури за работа на BNBGSSS и осигурява публичен достъп до тях.

13.1.3. Осъществява надзор за спазването на правилата и процедурите за работа на BNBGSSS и прилагането на вътрешните правила за работа със Системата.

13.1.4. Приема и спазва вътрешни правила за работа на BNBGSSS, чрез които се гарантира висока степен на защита на Системата, надеждност при опериране и конфиденциалност на информацията.

13.1.5. Разработва и приема правила за действие при извънредни ситуации, които да гарантират своевременната обработка на операциите с ДЦК при извънредни обстоятелства.

13.1.6. Като агент по сетълмента управлява процеса на сетълмент на операции с ДЦК.

13.1.7. Има право временно да ограничи и да изключи участник в BNBGSSS.

13.1.8. Организира и осигурява извършване на одит на BNBGSSS.

13.2. Права и задължения на БНБ при опериране, поддържане и администриране на BNBGSSS.

Българската народна банка:

13.2.1. Оперира и поддържа функционирането на BNBGSSS, осигурява достъп на участниците до Системата, в съответствие с тези правила и процедури и спецификациите на Системата.

13.2.2. Осигурява резервираност на функционирането на BNBGSSS и поне веднъж годишно организира прехвърляне на работата на Системата върху резервната ѝ конфигурация.

13.2.3. При извънредна ситуация или непреодолими обстоятелства може да променя графика за работа на BNBGSSS, за което уведомява своевременно участниците и операторите в Системата.

13.2.4. Администрира и осигурява равноправен, защитен достъп на участниците и операторите до Системата на базата на надеждни механизми за защита на достъпа, автентификация на изпращача на исканията/уведомленията за сделки с ДЦК,

интегритета и конфиденциалността на постъпващата и съхранявана в BNBGSSS информация.

13.2.5. Осигурява надеждна хардуерна и софтуерна платформа за функциониране на BNBGSSS в защитена комуникационна среда, като осигурява издаването и управлението на необходимите за целта КЕП сертификати. Българската народна банка прилага утвърдени практики за управление на сигурността на BNBGSSS.

13.2.6. Може да наложи допълнителни изисквания за сигурност и непрекъсваемост на дейността спрямо всички участници и/или спрямо участниците, които се считат за системно важни (ключови) от BNBGSSS.

13.2.7. Уведомява предварително всички участници в BNBGSSS при извършване на промени във функционирането на Системата, като осигурява необходимото време за подготовка и тестване на техните системи за връзка с BNBGSSS.

13.2.8. Осигурява среда за провеждане на тестове при извършване на промени в Системата, по искане на участник в BNBGSSS и при включване на нов участник.

13.2.9. Осигурява функционирането и развитието на BNBGSSS в съответствие с Принципите за инфраструктурите на финансовите пазари на CPMI и IOSCO и действащите европейски норми в тази област.

13.2.10. Поддържа актуален списък на лицата, упълномощени да осъществяват контакти при възникнали проблеми във връзка с операции с ДЦК на участника.

13.2.11. Определя ключовите участници в BNBGSSS съгласно реда и условията посочени в Приложение № 8 – „Ключови участници в BNBGSSS“.

13.3. Права и задължения на БНБ при извършване на услуги чрез BNBGSSS

В качеството си на оператор на BNBGSSS, БНБ действа професионално и полага максимални усилия за предоставяне на услуги на участниците в системата, които могат да бъдат:

13.3.1. Българската народна банка, като оператор на BNBGSSS, има следните задължения:

13.3.1.1. Експлоатация, поддръжка и актуализиране на BNBGSSS и на интерфейса с другите системи;

13.3.1.2. Регистрация на сертификати за КЕП на потребителите;

13.3.1.3. Регистриране и разрешаване на инциденти, възпрепятстващи функционирането на BNBGSSS.

Българската народна банка не поема задължения и не е обвързана с никакви гаранции или препоръки, отнасящи се до:

- риска всяко прехвърляне на ценни книжа, извършено от участник, впоследствие да бъде обявено за невалидно или неприложимо, въпреки неговата регистрация и записване в съответствие с настоящите Правила;

- риска прехвърлянето на ценни книжа по залог на сметка в BNBGSSS, в последствие да бъде обявено за недействително или неприложимо, или че всяка временна или постоянна пречка може да възпрепятства прехвърлянето;

- надеждността, качеството и наличността на услугите, предлагани от доставчици на комуникационни услуги.

БНБ е едноличен собственик на ИТ-инфраструктурата, поддържаща функционирането на BNBGSSS, която се състои както от хардуер (сървъри, компютри, телекомуникационни устройства), така и от софтуер. За целта БНБ, като оператор на Системата, предприема всички необходими мерки за:

13.3.1.4. Защита на своята ИТ-инфраструктура и нейните компоненти, включително интерфейса си с другите системи от:

- проникване, кражба и измами;
- изтриване или повреждане на чувствителни данни;
- повреди или неизправност на инфраструктурата на BNBGSSS.

13.3.1.5. Отстраняване във възможно най-кратък срок на всеки възникнал проблем в инфраструктурата на BNBGSSS и нейните компоненти, включително нейния интерфейс, с останалите системи, например чрез прибегване до подходящи резервни и бизнес процедури при извънредни ситуации. Разрешаването на инциденти и проблеми следва принципите на добрата европейска практика, като се прилагат всички адекватни действия, при спазване на „Операционни процедури при комуникационни и технически проблеми“.

13.3.1.6. Информирание на участниците за инциденти и създаване на доклади за инциденти. Докладът за инцидент се изготвя с цел да се предостави на всички заинтересовани страни изчерпателен анализ върху събитията, възможните решения и последващите действия и предприетите коригиращи мерки. Първоначалният доклад за инцидента трябва да бъде предоставен в рамките до 4 часа от момента, в който значимият операционен или свързан със сигурността инцидент бъде открит за първи път. Окончателният доклад се предоставя до две седмици, след като бъде счетено, че нормалната оперативна дейност е възстановена.

13.3.1.7. ДДЦК извършва периодично изпитване и преглед на оперативните правила, политики и процедури с участниците в BNBGSSS в следните случаи:

- най-малко веднъж годишно, като профилактика на системата;
- при настъпване на съществени промени в Системата;
- след оперативни инциденти, засягащи безпрепятствено предоставяне на услуги от страна на ДЦК.

13.4. Цялост на емисиите.

13.4.1. BNBGSSS гарантира интегритета на всяка една емисия ДЦК от момента на нейното емитиране до падежа ѝ в съответствие с чл. 7 от Наредба № 31. За тази цел BNBGSSS прилага определени механизми за равнение (реконсиляция), които осигуряват, че съвкупната номинална стойност на всяка една емисия ДЦК, отразена по съответната сметка на емитента, е равна на сбора от номиналните стойности на ДЦК, отразени по сметките за сетълмент на ДЦК на участниците (собствени, общи клиентски и за ДЦК с наложена тежест).

13.4.2. BNBGSSS прилага принципа на двустранно счетоводно записване. Ежедневно, в края на системния ден се извършва равнение (реконсиляция) на данните за ДЦК, регистрирани в ЕСРОТ, с тези, водени по отделните сметки за сетълмент на ДЦК в СДЦК.

13.4.3. В случай че се установи неправомерно създаване или заличаване на държавни ценни книжа и BNBGSSS не успее да разреши проблема до края на работния ден, сетълментът се преустановява до отстраняване на проблема и се информират участниците в BNBGSSS, надзорния орган и всички други субекти, участващи в процеса на равнение.

13.4.4. BNBGSSS ежесечно извършва равнение на данните за ДЦК, водени по регистъра в BNBGSSS с данните за ДЦК, водени по регистрите на поддепозитарите на ДЦК и на емитента (МФ).

За успешното равнение:

- участниците в BNBGSSS подават файл със структурирани данни за собствени ДЦК и ДЦК, собственост на техни клиенти, водени по регистрите за ДЦК в техните системи;
- системата извършва валидация на всеки новопостъпил файл, като при евентуална грешка го отхвърля и генерира съобщение за вида на грешката;
- след успешното валидиране на файла, започва процесът по сравняване на данните, подадени от участниците, и данните за ДЦК, поддържани в системата;
- след приключване на процеса по сравняване, системата генерира протокол за резултатите;

- при пълно съвпадение на данните при сравняването на двата информационни потока, системата генерира файл със статус „реконсилирани и приети данни”;
- в случай на разлики при сравняването на двата информационни потока, системата генерира файл със статус „неравнение на данни”
- статусът може да се разглежда online от потребителя на участника и в случай на неравнение участникът трябва да направи анализ на причината и да коригира файла;
- участникът изпраща нов корекционен файл, като процесът може да бъде многократно повторен до постигането на пълно съвпадение на данните.

13.4.5. BNBGSSS предоставя по искане на участниците в системата извлечения за състоянието на регистъра им за ДЦК към съответна дата и/или за движението по него за определен период от време.

13.4.6. BNBGSSS осигурява достъп на участниците в системата в реално време до състоянието на регистъра им за ДЦК (собствени, клиентски и блокирани).

13.4.7. В BNBGSSS не са разрешени овърдрафти с ДЦК, дебитни салда и създаване на ДЦК.

13.5. Връзки с други депозитари, които използват обща инфраструктура на сетълмент

13.5.1. Преди установяването на връзка между ДДЦК и други централни депозитари на ценни книжа, ДДЦК установява, оценява, наблюдава и управлява всички възможни източници на рискове, произтичащи от връзката между тях.

13.5.2. Връзката се основава на подходяща договореност под формата на споразумение, в което се определят съответните права и задължения на свързаните депозитари. В договореностите, които пораждат последици в повече от една юрисдикция, се посочва недвусмислено съответното право, което урежда всеки отделен аспект на свързаните с връзка операции.

13.5.2.1. Свързаните с ДДЦК централни депозитари на ценни книжа трябва да разполагат с надеждни процедури за равнение (реконсиляция), за да гарантират точността на съхраняваните от тях данни.

13.5.2.2. Връзките на ДДЦК с други ЦДЦК позволяват сетълмент на принципа DvP/FoP. При временно прехвърляне на ДЦК между ЦДЦК, с които ДДЦК има установена връзка, е забранено обратното прехвърляне на ДЦК преди първоначалното прехвърляне да стане окончателно.

13.5.2.3. При присъединяването към платформата T2S ДДЦК установява с други ЦДЦК оперативно съвместими връзки, при които депозитарите се съгласяват да използват общите технически решения за сетълмент на T2S.

Чрез подписването на Рамковото споразумение за участие в T2S (T2S Framework Agreement) ЦДЦК се съгласяват да прилагат еквивалентни правила за момента на окончателност на прехвърлянето на ценни книжа и парични средства и да въведат:

- еднакви моменти на въвеждане на нарежданията;
- неотменимост на нарежданията за прехвърляне.

13.5.2.4. ДДЦК актуализира, най-малко веднъж на две години, рамката за оповестяване на самооценката на депозитаря за съответствие с принципите на инфраструктурите на финансовите пазари на CPMI и IOSCO. ДДЦК публикува на сайта на БНБ актуалната самооценка.

ДДЦК се ангажира да действа само в съответствие с инструкциите, подадени от участниците във вида и в сроковете, определени в настоящите Правила и процедури.

13.6. Отговорност на БНБ

Българската народна банка носи отговорност само за причинени вреди в следните случаи:

- чрез умишлено неправомерно поведение или груба небрежност;
- Българска народна банка при никакви обстоятелства не носи отговорност за: непреки, последващи, случайни или наказателни вреди, щети или разходи (включително загуба на приходи или очаквани печалби, загуба на бизнес, загуба на обществен имидж или увреждане на репутацията), дори ако БНБ е била информирана за такава загуба, щети или разходи;
- вреди в резултат на неспазване на правилата и процедурите, от който и да е участник, предвидени в настоящите Правила.

Българската народна банка не носи отговорност в случай на непреодолима сила, форсмажорни обстоятелства или други причини или външни събития, които не могат да бъдат приписани на БНБ, както и злонамерени щети, причинени от трети страни.

13.7. Отговорности на ръководния състав на ДДЦК в БНБ.

Депозитарят на ДЦК е в структурата на дирекция „Фискални услуги“, управление „Банково“ в БНБ. Ръководният състав на ДДЦК:

- определя функциите и задачите на ДДЦК в съответствие с договорните взаимоотношения с МФ, както и целите и стратегията за тяхното постигане, като създава необходимата организация за функционално развитие и усъвършенстване на оперираната от ДДЦК система;
- директорът на дирекция „Фискални услуги“ изпълнява функциите на мениджър по управление на риска, като за целта създава необходимата организация в

ДДЦК, свързана с разработване и прилагане на процедури за управление на риска; извършва цялостна оценка на операционните рискове и рисковете, свързани със сигурността, във връзка с дейността на ДДЦК, както и на адекватността на мерките за ограничаване и контролните механизми, прилагани от него спрямо тези рискове;

- организира, ръководи и координира цялостната дейност на ДДЦК по регистриране и обслужване на вътрешния държавен дълг, безпроблемното функциониране на пазара на ДЦК и регулирането и контрола съвместно с МФ на системите за регистрация на ДЦК при участниците в него;

- осигурява спазването на всички приложими за ДДЦК регулаторни и надзорни изисквания, ръководи и координира дейността по усъвършенстване на нормативната база, регламентираща пазара на ДЦК, емитирани на вътрешни пазар;

- подлага процедурите за управление на риска, спазването на изискванията и вътрешен контрол на редовен преглед и изпитване;

- консултира с Комитета на ползвателите на BNBGSSS въпроси свързан с проекти за нововъведения, изменения и доработки на софтуерните приложения на системата за регистрация и сетълмент на ДЦК, както и на средствата за комуникации на системата;

- организира и контролира провеждането на тестове с участниците в BNBGSSS на нови функционалности и доработки на системата, или при желание на някой участник. За целта създава необходимата организация в БНБ и с участниците за провеждането на тестовете и за своевременното им уведомяване за резултатите от тях.

14. Права и задължения на участниците.

14.1. Представителство и гаранции.

Всеки участник, заявява и гарантира пред БНБ, че:

- има правомощията да сключи споразумение за участие в BNBGSSS, да държи държавни ценни книжа в BNBGSSS и да участва в системата;

- е напълно запознат с цялата документация, свързана с изискванията за участие в BNBGSSS и спазва всички свои задължения съгласно настоящите Правила и процедури;

- спазва всички приложими нормативни документи, свързани с изискването за борбата с изпирането на пари и за финансиране на тероризъм или измама;

- спазва всички свои задължения в съответствие с нормативните изисквания на ЕС;

- всички приложими законови, данъчни или регулаторни изисквания за оповестяване или отчитане на държане, контрол и доказване на действителна

собственост по отношение на държавни ценни книжа, държани от участниците в BNBGSSS, са спазени;

- цялата информация за участника, предоставена от него на БНБ във връзка с участието му в BNBGSSS, по всяко време е била и ще бъде вярна, освен ако БНБ не е уведомена за противното.

14.2. Права и задължения на участниците.

14.2.1. Всеки участник има изключителното, персонално и непрехвърляемо право да използва BNBGSSS във връзка със сетълмента на сделки с държавни ценни книжа. За тази цел БНБ предоставя на всеки участник всички права, свързани със софтуера и приложенията на BNBGSSS, които са необходими, за да се осигури правото на съответния участник да използва BNBGSSS.

14.2.2. Всеки участник се задължава да:

14.2.2.1. Спазва нормативната уредба на българското и европейско законодателство и регулативните изисквания, приложими към неговото участие в BNBGSSS.

14.2.2.2. Спазва всички свои задължения съгласно настоящите Правила и процедури.

14.2.2.3. Информира БНБ за всички инциденти, възникнали в BNBGSSS, които могат да окажат влияние върху другите участници в Системата. БНБ може да изиска допълнителна информация за инцидента, както и да поиска от участника да вземе подходящи мерки за предотвратяване на повторна поява на такъв инцидент.

14.2.2.4. Спазва всички допълнителни изисквания за информационна сигурност, които БНБ може да наложи.

14.2.2.5. Изгражда и поддържа в изправност собствените си системи за работа с BNBGSSS;

14.2.2.6. Осигурява квалифициран персонал за работа с BNBGSSS.

14.2.2.7. При поискване, от страна на БНБ, да предостави всякаква информация, включително информация за клиентите си.

14.2.2.8. Прилага адекватен контрол за сигурност, за да защити своите системи от неоторизиран достъп и използване. Участниците носят изключителна отговорност за адекватна защита на поверителността, целостта и наличността на техните системи.

14.2.2.9. Не използва за каквито и да било цели държавните ценни книжа, които принадлежат на неговите клиенти, освен ако участникът не е получил предварителното изрично съгласие на клиента в съответствие с приложимото законодателство.

14.2.2.10. Участникът в Системата потвърждава и се съгласява, че ще изпълнява

инструкциите, получени в съответствие с настоящите Правила и процедури, като БНБ изцяло се доверява, че използваните средства за комуникация (удостоверяване на електронни сертификати с КЕП в комуникацията през VPN и идентификация на SWIFT съобщенията) произхождат от самия участник или от лице, което има пълномощно да представлява участника. Българската народна банка не носи никаква отговорност за характеристиките на тези средства за комуникация. Телефонните разговори между БНБ и представители на участник в Системата не пораждаат никакви задължения или отговорности, нито отказ от права за BNBGSSS.

14.2.2.11. Всеки участник в BNBGSSS, който е и директен участник в T2S, се задължава да спазва Правилата за работа с платформата T2S.

15. Действия при възникване на проблеми в BNBGSSS

15.1. Действия при възникване на комуникационни и технически проблеми

При възникване на проблем при работа с BNBGSSS участниците в Системата уведомяват дирекция „Фискални услуги“, отдел „Депозитар на ДЦК“, телефон (02) 9145 1336. На e-mail: BNBGSSS@bnbank.org се регистрират всички запитвания по проблеми, възникнали при работа със Системата. В случай че е възможно, при подаване на съобщението по e-mail, с него се изпраща и системното съобщение за появила се на екрана на съответната работна станция на BNBGSSS грешка.

15.2. Уведомяване при прекъсване на работата на BNBGSSS

Възможни причини, които могат да предизвикат прекъсване на процеса по регистрацията и сетълмента на операции с ДЦК:

- нарушаване работоспособността на BNBGSSS, поради технически причини;
- технически проблеми в РИНГС и ТАРГЕТ;
- наличие на форсмажорни обстоятелства, като прекъсване на ел. захранването и др.

При технически проблеми се уведомяват лицата за контакт, определени от участниците в Системата. При възстановяване на нормалния режим на работа участниците се уведомяват незабавно.

15.3. Не се считат за основание за обявяване на извънредна ситуация следните случаи:

15.3.1. Когато нормалният ход на операциите е нарушен поради ликвидни затруднения на някой от участниците в BNBGSSS;

15.3.2. Когато участник в BNBGSSS обяви за отпадане на някои от вътрешните му системи поради технически или друг проблем.

16. Ред и условия за подаване на жалби и оплаквания от участници в BNBGSSS до Депозитаря в БНБ

Всеки участник в BNBGSSS може да подава жалби лично или чрез пълномощник по един от следните начини:

- с писмо на адреса за кореспонденция, публикуван на официалната интернет страница на БНБ в раздел „Обслужване на клиенти“: БНБ, пл. „Княз Александър I“ № 1, 1000 София;
- на място в деловодството на БНБ в сградата на БНБ;
- на електронен адрес: **BNB-Delovodstvo@bnbank.org**.

Жалбата се подава писмено в свободен текст и се регистрира в деловодната система на БНБ в деня на получаването ѝ. Жалбата съдържа следната информация:

- а) име на жалбоподателя (вкл. на пълномощника, ако има такъв);
- б) пощенски и/или електронен адрес за кореспонденция и/или телефон за контакт;
- в) изложение на случая;
- г) опис на приложени документи (в случай че са налични);
- д) дата и подпис на лицето, подало жалбата.

Анонимни жалби не се разглеждат.

Регистрирана жалба се разглежда в дирекция „Фискални услуги“, като при необходимост се изисква съдействие от дирекция „Правна“.

Изготвя се мотивиран отговор в рамките на 15 календарни дни. Когато се налага удължаване на цитирания срок писмено се уведомява жалбоподателя. Максималният срок за изготвяне отговор на жалбата е един месец.

Българската народна банка съхранява цялата информация, свързана с постъпили жалби на електронен и/или хартиен носител, в рамките на нормативно определените срокове.

Депозитарят на ДЦК и участникът в BNBGSSS следва да положат всички усилия за разрешаване на всички възникнали спорове и постигане на споразумение. За неуредените въпроси се прилагат нормите на относимото българско законодателство.

17. Защита на поверителна информация и лични данни.

17.1. Защита на поверителна информация.

Дейността на BNBGSSS се осъществява при спазване на Вътрешните правила за опазване на информацията, представляваща тайна и Закона за защита на личните данни. Участниците в BNBGSSS не разкриват поверителна информация на трета страна.

Поверителна информация е всяка информация, свързана с характеристиките, настройките и функционирането на BNBGSSS, независимо дали информацията е от

търговско, финансово, регулаторно, техническо или друго естество, принадлежаща на БНБ или друг участник, която не е била публично оповестена без нарушаване на всяко задължение за поверителност.

Участниците имат право да използват поверителна информация относно BNBSSS само с оглед на експлоатацията, поддръжката, по-нататъшното развитие, съдействие за внедряване и услугите за обучение, свързани с BNBGSSS. По правило участниците не разкриват поверителна информация на която и да е трета страна или на което и да е друго лице освен техния персонал, клонове, изпълнители или друго лице, което задължително трябва да има достъп до него за правилното функциониране на BNBGSSS, освен с изричното предварително писмено съгласие на притежателя на поверителната информация. Участниците предприемат разумни технически мерки, за да ограничат достъпа до поверителна информация до лицата, на които е разрешено да имат такъв достъп, и гарантират, че техните служители, клонове, изпълнители или всяко друго лице, което получава или ще получи поверителна информация в съответствие с правилата определени в този член, действат в пълно съответствие с тези правила.

Всички инструкции, подадени от участниците, независимо дали от тяхно име или от името на техния клиент, както и всички данни, свързани с това, ще бъдат достъпни само за съответния участник и негов контрагент с единствената цел правилното уреждане на сделката.

Задълженията за поверителност по този член не се прилагат, когато се изисква разкриването ѝ:

- за защита в съдебни, арбитражни или подобни съдебни производства на законните интереси на БНБ или на участник, или
- съгласно приложимото национално законодателство или задължителна регулация, но само в строги граници наложено от такова национално законодателство или задължителна регулация.

Задълженията за поверителност, са валидни за неограничен период от време след датата на оттегляне или изключване на участник или прекратяване на участието му в BNBGSSS.

17.2. Защита на лични данни

Участникът в Системата уведомява БНБ за всяка промяна, свързана с личните данни, които е съобщил в рамките на Споразумението за участие в BNBGSSS.

Българската народна банка и участникът в BNBGSSS спазват приложимото законодателство за защита на данните по отношение на всяка обработка на лични данни в рамките на това споразумение, включително обработката на лични данни в BNBGSSS.

Участникът уведомява БНБ без ненужно забавяне за всяка промяна, свързана с личните данни, които е съобщил в рамките на Споразумението.

18. Неразделна част от тези Правила и процедури са следните документи:

Приложение № 1 - Таблица за използваните кодове на регистри/сметки за ДЦК на участник с код CCCC в BNBGSSS

Приложение № 2 - Кодове на видовете сделки/операции по Наредба № 5

Приложение № 3 - Типове SWIFT (ISO 15022) съобщения, използвани от BNBGSSS

Приложение № 4 - Валидни типове входящи SWIFT съобщения за съответните видове сделки

Приложение № 5 - Отговори на входящи съобщения

Приложение № 6 - Кодове на грешки при проверка и обработка на SWIFT съобщения, постъпили в Депозитаря на ДЦК

Приложение № 7 – График на системния ден на BNBGSSS

Приложение № 8 – Ключови участници в BNBGSSS

Приложение № 9 – Предоставяно ниво на обслужване

19. Влизане в сила

Настоящите Правила и процедури отменят утвърдените с № БНБ - 101339/08.09.2023 г. Правила и процедури за работата на системата за регистрация и сетълмент на ДЦК в БНБ - BNBGSSS