

КОМИСИЯ ЗА ФИНАНСОВ НАДЗОР

УТВЪРДИЛ:

ВЛАДИМИР САВОВ
ЧЛЕН НА КОМИСИЯ ЗА ФИНАНСОВ НАДЗОР,
ИЗПЪЛНЯВАЩ ПРАВОМОЩИЯТА НА ЗАМЕСТНИК-
ПРЕДСЕДАТЕЛ НА КОМИСИЯТА ЗА ФИНАНСОВ НАДЗОР,
РЪКОВОДЕЩ УПРАВЛЕНИЕ „НАДЗОР НА
ИНВЕСТИЦИОННАТА ДЕЙНОСТ”

У К А З А Н И Я

по попълването и представянето в Комисията за финансов надзор на справка, съгласно чл. 38, ал. 1 от Закона за пазарите на финансови инструменти (ЗПФИ)

Съгласно чл. 38, ал. 1 от ЗПФИ инвестиционният посредник уведомява Комисията за финансов надзор (Комисията) за сключените от него сделки с финансови инструменти, допуснати до търговия на регулиран пазар. За изпълнение на посоченото задължение инвестиционният посредник подава в КФН справка по образец, публикуван на интернет страницата на Комисията (www.fsc.bg).

I. Попълване на справката

1. Справката по чл. 38 ал. 1 от ЗПФИ се попълва във формат, публикуван на интернет страницата на Комисията: **www.fsc.bg**, раздел „Административни документи”, подраздел „Форми и образци”, „Капиталов пазар”.
2. Под попълнената справка се изписват имената на лицето подаващо справката.
3. В справката по т. 1 се попълват данни само в посочените колони и не се разрешава добавянето на нови колони.
4. При липса на сключени сделки за деня не е необходимо в Комисията да се подава празен файл.
5. В справката по т. 1 съществуват незадължителни полета. Тези полета се подават празни, ако в тях не присъстват никакви данни, като не се допуска изписването на никакви символи в тях.
6. При попълване на справката по т. 1 не се подават празни редове между данните или празен първи ред.

7. При попълване на справката по т. 1 е необходимо данните да бъдат сортирани, така че в началото да са сделките с ISIN кодовете, а в края да са сделките с OTC кодове.
8. За сделките с ISIN кодове задължително трябва да се попълнят следните полета:
 - Идентификация на инструмента;
 - ИП - BIC код на ИП;
 - Дата на търгуване;
 - Време на търгуване;
 - Индикатор;
 - Търговско качество;
 - Код на инструмента;
 - Единична цена;
 - Парична единица;
 - Количество;
 - Количествена единица;
 - Контрагент: MIC код, BIC код или вътрешен код;
 - Идентифициране на мястото;
 - Референтен номер на сделката;
 - Идентификация на крайния клиент.
9. За сделките с OTC трябва да се попълнят и останалите полета освен горепосочените, а именно:
 - Идентифициране на базовия инструмент
 - Вид на кода на базовия инструмент
 - Вид на инструмента
 - Дата на падежа
 - Вид на деривата
 - Пут / Кол
 - Цена на упражняване
 - Множител на цената
 - Указание за канселиране
10. Колона „Идентификация на инструмента” се попълва задължително. Възможни стойности в нея - ISIN кода на инструмента (12 символа). ISIN кодът на инструмента трябва да бъде изписан на латиница с главни букви.
11. Колона „ИП - BIC код на ИП” се попълва задължително. Възможни стойности в нея - BIC код на ИП (11 символа). BIC кодът на инструмента трябва да бъде изписан на латиница с главни букви.
12. Колона „Дата на търгуване” се попълва задължително. Форматът на подадените данни трябва да бъде DD.MM.YYYY.
13. Колона „Време на търгуване” се попълва задължително. Форматът на подадените данни трябва да бъде HH:MM.
14. Колона „Индикатор” се попълва задължително. Възможни стойности в нея – B и S (B – купува и S – продава). Стойностите трябва да бъдат изписани на латиница с главни букви.

15. Колона „Търговско качество” се попълва задължително. Възможни стойности в нея – Р и А (Р – когато действа за собствена сметка и А – когато действа като агент). Стойностите трябва да бъдат изписани на латиница с главни букви.
16. Колона „Код на инструмента” се попълва задължително. Възможни стойности в нея – ISIN и OTC (ISIN – за инструмент, OTC – за дериват). Стойностите трябва да бъдат изписани на латиница с главни букви.
17. Колона „Единична цена” се попълва задължително. Възможни стойности в нея – число разделено с десетична точка. Числото не трябва да бъде повече от 19 символа общо, а след десетичната точка 5 символа. В колоната не трябва да присъства стойност „0”, като самостоятелно число. Ако колоната съдържа десетично число, то тя трябва да бъде форматирана с 5 символа след десетичната точка.
18. Колона „Парична единица” се попълва задължително. Големината на полето е три символа и се използва кода от номенклатурата на валутите. Стойностите трябва да бъдат изписани на латиница с главни букви.
19. Колона „Количество” се попълва задължително. Възможни стойности в нея – число разделено с десетична точка. Числото не трябва да бъде повече от 19 символа общо, а след десетичната точка 5 символа. В колоната не трябва да присъства стойност „0”, като самостоятелно число. Ако колоната съдържа десетично число, то тя трябва да бъде форматирана с 5 символа след десетичната точка.
20. Колона „Количествена единица” се попълва задължително. В тази колона се попълва количествената единица.
21. Колона „Контрагент: МІС код, ВІС код или вътрешен код” се попълва задължително. Възможни стойности в нея - МІС код на пазар от номенклатурата на пазарите (4 символа) или ВІС код на фирмата (11 символа) или вътрешен код (40 символа). Стойностите трябва да бъдат изписани на латиница с главни букви.
22. Колона „Идентифициране на мястото” се попълва задължително. Възможни стойности в нея - МІС код на пазар от номенклатурата на пазарите (4 символа) или ВІС код на фирмата (11 символа) или XOFF при сделки на извънборсов пазар или XXXX при дериват. Стойностите трябва да бъдат изписани на латиница с главни букви.
23. Колона „Референтен номер на сделката” се попълва задължително. Възможните стойности в нея са до 40 символа.
24. Колона „Идентификация на крайния клиент” се попълва задължително. Възможни стойности в нея - ВІС код на фирмата (11 символа) или вътрешен код (40 символа).

25. Колоната „Идентифициране на базовия инструмент” се попълва за ОТС. Възможни стойности в нея - ОТС кода на инструмента (12 символа). ОТС кодът на инструмента трябва да бъде изписан на латиница с главни първи букви.
26. Колоната „Вид на кода на базовия инструмент” се попълва за ОТС кодовете.
27. Колоната „Вид на инструмента” се попълва за ОТС кодовете.
28. Колоната „Дата на падежа” се попълва за ОТС кодовете. Форматът на подадените данни трябва да бъде DD.MM.YYYY.
29. Колоната „Вид на деривата” се попълва за ОТС кодовете. Възможни стойности в нея – O - Options; W - Warrants; F - Future/forwards; D - CfDs and TRS; X - Spread bets; S - Swaps other than CfDs, TRS and CDS; Z – CDS; и K –Complex derivatives.
30. Колоната „Пут / Кол” се попълва за ОТС кодовете. Възможни стойности в нея - P - за Put и C - за Call.
31. Колоната „Цена на упражняване” се попълва за ОТС кодовете. Възможни стойности в нея - число разделено с десетична точка. Числото не трябва да бъде повече от 19 символа общо, а след десетичната точка 5 символа. В колоната не трябва да присъства стойност „0”, като самостоятелно число. Ако колоната съдържа десетично число, то тя трябва да бъде форматирана с 5 символа след десетичната точка.
32. Колоната „Множител на цената” се попълва за ОТС кодовете. Възможни стойности в нея - число разделено с десетична точка. Числото не трябва да бъде повече от 19 символа общо, а след десетичната точка 5 символа. В колоната не трябва да присъства стойност „0”, като самостоятелно число. Ако колоната съдържа десетично число, то тя трябва да бъде форматирана с 5 символа след десетичната точка.
33. Колоната „Указание за канселиране” се попълва за ОТС кодовете. Възможни стойности в нея - C - при канселиране на вече подадена сделка.

II. Подаване на справките към Комисията

34. Инвестиционните посредници подават справката по чл. 38 от ЗПФИ в публикувания на страницата на Комисията формат, подписана с квалифициран електронен подпис. Подаването на документите се осъществява чрез електронен адрес: delovodstvo@fsc.bg . В полето „Subject” е необходимо да се попълни „Справка по чл. 38 от ЗПФИ” и пълното наименование на дружеството подаващо сделката. Прикачените файлове не трябва да са криптирани.
35. При подаване на справката по т. 1 инвестиционните посредници спазват приета конвенция на именуване на файла, а именно:

BIC_ddmmyyyy.xls;

където:

„BIC” се заменя с BIC кода на дружеството, подаващо сделката;

„ddmmyyyy” се заменя с точната дата на осъществяване на сделката.

36. При неспазване на зададените параметри на справката, същата не може да бъде обработена и изпратена чрез система TREM. В тези случаи съответният инвестиционния посредник ще бъде уведомен за повторно изпращане на справката при спазване на поясненията.

Приложение: образец на справка.