

Наредба за изменение и допълнение на Наредба № 8 от 03.09.2020 г. за изискванията към дейността на централните депозитари на ценни книжа, централния регистър на ценни книжа и други лица, осъществяващи дейности, свързани със сетълмента на ценни книжа

(обн., ДВ, бр. 81 от 2020 г., изм. и доп., бр. 62 от 2021 г.)

§ 1. В чл. 1, ал. 3 след думите „по ал. 1“ се поставя запетая и се добавя „т. 1“, а думите „четвърта и шеста“ се заменят с „четвърта, шеста и осма „а“.

§ 2. В чл. 44, т. 2 думите „места за търговия“ се заменят с „места на търговия“, а думите „на извънборсови пазари“ се заменят с „извън места на търговия“.

§ 3. След чл. 71 се създава глава осма „а“ с чл. 71а – 71н:

„Глава осма „а“

Докладване на случаи на неуспешен сетълмент по чл. 7 от Регламент (ЕС) № 909/2014
Раздел I

Обхват на данните, които се докладват от централните депозитари на ценни книжа

Чл. 71а. По смисъла на тази глава:

1. „краен срок“ е срокът, определен в правилата на системния оператор за приемането на инструкции за сетълмент за даден цикъл на сетълмент;

2. „обем“ е броят на инструкциите за сетълмент по отношение на инструкциите за сетълмент, посочени в приложенията към Делегиран регламент (ЕС) № 2018/1229 на Комисията от 25 май 2018 г. за допълване на Регламент (ЕС) № 909/2014 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на регулаторните технически стандарти за дисциплината при сетълмента (ОВ, L 230/1 от 13 септември 2018 г.), наричан по-нататък „Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229“.

Чл. 71б. (1) Когато представя на основание чл. 7, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 909/2014 доклад на Комисията и на съответните органи по чл. 12 от Регламент (ЕС) № 909/2014, централният депозитар на ценни книжа представя отделни доклади за всяка управлявана от него система за сетълмент на ценни книжа, които обхващат всички финансови инструменти, посочени в чл. 5, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 909/2014, регистрирани при него, с изключение на акциите, чието основно място за търговия се намира в трета държава.

(2) За определянето на местоположението на основното място на търговия на акции по ал. 1, за целите на чл. 7, параграф 13 от Регламент (ЕС) № 909/2014, централният депозитар на ценни книжа използва списъка на освободените акции относно късите продажби, публикуван от Европейския орган за ценни книжа и пазари.

(3) В доклада по ал. 1 централният депозитар на ценни книжа представя информация относно всички инструкции за сетълмент, попадащи в обхвата на чл. 7, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 909/2014, независимо дали се отнасят до сделки, сключени на местата на търговия или сключени извън местата на търговия.

(4) За неуредените в тази глава въпроси относно съдържанието на доклада по ал. 1 се прилагат изискванията на Насоките относно докладването на случаи на неуспешен сетълмент по чл. 7 от Регламента за централните депозитари на ценни книжа (ESMA70-

156-4717), за които Комисията е взела решение за прилагането им съгласно чл. 13, ал. 1, т. 26 от Закона за Комисията за финансов надзор, наричани по-нататък „Насоки относно докладването на случаи на неуспешен сетълмент“.

(5) Централният депозитар на ценни книжа уведомява Комисията при предоставянето на докладите по ал. 1 на съответните органи по чл. 12 от Регламент (ЕС) № 909/2014, ако не са изпратени до тези органи и Комисията едновременно.

Чл. 71в. За докладите по чл. 71б, ал. 1 централният депозитар на ценни книжа взема предвид всички съгласувани инструкции за сетълмент, въведени в управляваната от него система за сетълмент на ценни книжа, както и инструкциите, посочени в чл. 5, параграф 2, буква „в“ от Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229, за които не се изисква съгласуване.

Раздел II

Параметри за докладване на данни

Чл. 71г. (1) Докладите по чл. 71б, ал. 1 включват броя и стойността на изпълнените инструкции през обхванатия в докладите период, които могат да бъдат изчислени чрез приспадане на броя и стойността на случаите на неуспешен сетълмент от общия брой и стойността на инструкциите за сетълмент.

(2) За целите на ал. 1 инструкциите за сетълмент се считат за неизпълнени инструкции за сетълмент от момента, в който сетълментът на предвидената дата на сетълмент вече не е възможен, поради липса на ценни книжа или парични средства.

(3) Инструкциите за сетълмент, представени в съответния краен срок, се включват в данните относно случаи на неуспешен сетълмент, ако те все още не са изпълнени след приключването на съответния цикъл на сетълмент.

(4) В случай че през период, обхванат от доклад, по дадена инструкция за интернализирания сетълмент не може да бъде извършен сетълмент няколко работни дни след предвидената дата за сетълмент, включително в случаите, когато инструкцията за сетълмент бъде отменена след съответния краен срок, тя трябва да бъде посочена като неуспешна за всеки работен ден, в който сетълментът ѝ е бил неуспешен. Инструкцията трябва да бъде посочена като инструкция с успешен сетълмент, ако сетълментът ѝ е извършен през обхванатия от доклада период.

(5) Инструкциите за сетълмент, които са отменени преди съответния краен срок, не се посочват в категориите „общо подадени инструкции“ и „неизпълнени инструкции“ само за деня, в който инструкциите за сетълмент са отменени, и само за частта от инструкциите за сетълмент, която е отменена.

Чл. 71д. (1) Процентът на случаите на неуспешен сетълмент се изчислява, като се вземат предвид и повтарящите се случаи на неуспешен сетълмент, които продължават повече от един работен ден.

(2) За обобщените стойности, включени в месечните доклади съгласно таблица 1 от приложение I към Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229, централният депозитар на ценни книжа взема предвид сбора на броя, съответно на стойността на отделните инструкции за сетълмент, допустими за сетълмент, за всеки работен ден от месеца.

Чл. 71е. В докладите по чл. 71б, ал. 1 централният депозитар на ценни книжа представя информация относно инструкция за частичен сетълмент, която е неуспешна и е обработена, при условие че инструкцията за сетълмент не е напълно изпълнена.

Чл. 71ж. (1) Централният депозитар на ценни книжа уведомява за късно съгласуване на инструкциите за неуспешен сетълмент за всеки работен ден, считано от предвидената дата на сетълмент.

(2) В случай че са налице значителни несъответствия между годишния доклад и

обобщените стойности в месечните доклади, централният депозитар на ценни книжа проверява причините за несъответствията и представя коригираните доклади.

Чл. 71з. Централният депозитар на ценни книжа отразява стойността на всички инструкции за сетълмент, като за стойност на всяка инструкция за сетълмент се приема стойността на ценните книжа или на паричния ѝ компонент.

Чл. 71и. (1) При представяне на ежедневните данни, посочени в таблица 2 от приложение I към Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229, за да се направи разграничение между случаите на неуспешен сетълмент, дължащи се на недоставяне на ценни книжа, и тези, дължащи се на недоставяне на парични средства, централният депозитар на ценни книжа взема предвид причината за всеки неуспешен сетълмент във формата, съобразно насока 17 от Насоките относно докладването на случаи на неуспешен сетълмент .

(2) Обемът и стойността на всички инструкции за сетълмент се представят като общи инструкции в раздел „недоставяне на ценни книжа“ и раздел „недоставяне на парични средства“ на таблицата по ал. 1.

(3) Обемът и стойността на всички инструкции за сетълмент, които са изпълнени, се представят като изпълнени инструкции в раздел „недоставяне на ценни книжа“, както и в раздел „недоставяне на парични средства“ на таблицата по ал. 1.

(4) Обемът и стойността на всички инструкции за сетълмент, които не са изпълнени, се представят само като случаи на неуспешен сетълмент в съответния раздел „недоставяне на парични средства“ или „недоставяне на ценни книжа“ на таблицата по ал. 1, в зависимост от причината за всеки случай на неуспешен сетълмент.

(5) За целите на ал. 1 централният депозитар на ценни книжа проверява първо сетълмента на ценните книжа и, ако той е неуспешен, не прави допълнителни проверки на сетълмента на паричните средства.

(6) Когато двойка съответстващи инструкции за сетълмент, предвиждащи доставка срещу плащане и получаване срещу плащане, не са изпълнени поради неизпълнение на задължението за доставка на ценни книжа, включително когато инструкцията, предвиждаща доставка срещу плащане е задържана, се докладват и двете в раздел „недоставяне на ценни книжа“ на таблицата по ал. 1. По реда на изречение първо се докладва и в случай на закъсняла инструкция, когато участникът, доставящ ценните книжа, последен е съгласувал двойката съответстващи инструкции по изречение първо.

(7) Двойка съответстващи инструкции, които не са изпълнени поради неизпълнение на задължение за доставка на парични средства, включително когато инструкцията предвиждаща получаване срещу плащане е задържана, се докладват и двете в раздел „недоставяне на парични средства“ на таблицата по ал. 1. По реда на изречение първо се докладва и в случай на закъсняла инструкция, когато доставящия паричните средства участник последно е съгласувал двойката инструкции по изречение първо.

(8) Когато случай на неуспешен сетълмент се отнася до двойка съответстващи инструкции за сетълмент без плащане, които включват инструкции за сетълмент, предвиждащи доставка без плащане и получаване без плащане, включително когато инструкциите за сетълмент са задържани, и двете инструкции се докладват в раздел „недоставяне на ценни книжа“ на таблицата по ал. 1. По реда на изречение първо се докладва и в случай на закъсняла инструкция, независимо от участника, който последно е съгласувал двойката съответстващи инструкции за сетълмент.

Чл. 71к. Средната продължителност на случаите на неуспешен сетълмент, която се докладва от централния депозитар на ценни книжа, в съответствие с ред 41 от таблица 1 от приложение I към Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229, се изчислява като сборът от стойностите на всички случаи на неуспешен сетълмент, включени в доклада по чл. 71б, ал. 1 през текущия отчетен период, независимо дали предвидената дата на сетълмент

попада в същия отчетен период, се разделя на сбора от стойностите на случаите на неуспешен сетълмент на предвидената дата на сетълмент, докладвани през текущия отчетен период.

Чл. 71л. Месечните доклади относно случаите на неуспешен сетълмент, посочени в чл. 14, параграф 1 от Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229, включват само работните дни на съответния месец.

Чл. 71м. В съответствие с чл. 14, параграф 1 от Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229 всички стойности, включени в докладите по чл. 71б, ал. 1, се посочват в евро.

Чл. 71н. (1) Централният депозитар на ценни книжа представя информация относно броя и стойността на паричните санкции, посочени в полета 39 и 40 на таблица 1 от приложение I към Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229, във връзка със събраните и разпределени санкции през отчетния месец, обхващащ предходния месец.

(2) Броят на паричните санкции по ал. 1, които се докладват, отразява броя на инструкциите за сетълмент, отнасящи се до „неизправни участници“.

§ 4. В чл. 91, ал. 2, т. 1 думите „на комисията от 25 май 2018 г. за допълване на Регламент (ЕС) № 909/2014 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на регулаторните технически стандарти за дисциплина при сетълмент (ОВ, L 230/1 от 13 септември 2018 г.), наричан по-нататък „Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229“ се заличават.

§ 5. Навсякъде в наредбата думата „комисията“ се заменя с „Комисията“.

§ 6. Наредбата е приета с решение № на Комисията за финансов надзор.