

ИНФОРМАЦИЯ

по делегиран Регламент (ЕС) 2019/980 НА КОМИСИЯТА на ЕС

Относно

Търгуем сертификат EURUSD 07

1.	РИСКОВИ ФАКТОРИ
1.1	<i>Рискът, присъщ на търгуемите сертификати, се изразява в реализирана загуба, от страна на губещата страна, като тази загуба е ограничена до размера на внесената гаранция по съответната сделка с Търгуем сертификат EURUSD 07. Размерът на гаранцията представлява абсолютна стойност, формирана от разликата между текущият референтен курс на ЕЦБ за деня и цената на сключения сертификат, умножена по броя сертификати (един сертификат е 1000 единици). Не съществуват обстоятелства, при които би могло да възникне допълнително задължение, водещо до финансов ефект.</i>
2.	ИНФОРМАЦИЯ ОТНОСНО ЦЕННИТЕ КНИЖА, КОИТО ЩЕ СЕ ПРЕДЛАГАТ/ДОПУСКАТ ДО ТЪРГОВИЯ
2.1.	Информация относно ценните книжа <i>Търгуемият сертификат, базиран на фиксинга на EUR, оповестен от Европейската централна банка спрямо USD EURUSD07 е безналичен и се води в регистър при Централен депозитар АД София. Валута на емисията ценни книжа е EUR. Липсва субординираност на сертификата.</i>
2.1.1	<i>Настоящият електронно търгуем сертификат има за цел да замени други деривативни инструменти върху базовия актив – EURUSD, като форуърди, суапове, фючърси, опции и варанти. Настоящият сертификат се стреми да бъде прозрачна ценна книга от отворен тип, позволяваща на инвеститорите да получат експозиция в базовия актив (било то къса или дълга) без да е необходимо да извършват физическа доставка. Чрез своята простота, лесна разпознаваемост и неограниченост в количествата, сертификатът може да послужи за хеджиране на търговски експозиции в базовия актив. Инвестицията в сертификата се влияе единствено от изменение на курса на базовия актив във времето (като разлика между двата курса).</i>
2.1.2	<i>Настоящият сертификат ще се търгува в една търговска сесия, което ще представлява и времеви диапазон за търговия.</i>
2.1.3	<i>Датата на окончателния сетълмент ще бъде 7-ия календарен ден (T+7) след деня на търговия (T0) по референтния курс на ЕЦБ за същия работен ден (определян от ЕЦБ на T+6). Ако T+7 е неработен ден, ще се ползва принципа на първият работен ден след T+7. Настоящият Сертификат ще се търгува само един ден (T0) и ще приключва на T+7, като ще бъде в серия за всеки работен ден от месеца – т.е. в един календарен месец ще има между 20 до 23 серии в зависимост от броя на работните дни. В деня на сетълмент на печелившата страна се заверява сметката в Централен депозитар АД с удвоената гаранция по сертификата.</i>
2.1.4	А) Гаранция/плащане по сертификата <i>Гаранцията по сертификата, дължимата в деня на сделката, се изчислява по следната формула:</i> $D = ABS(Pfix0 - P) \times Q \times 1000$ <i>където:</i> <i>D е размера на гаранцията в лева;</i> <i>ABS – абсолютна стойност на разликата от</i> <i>Pfix0 - текущият референтен курс на ЕЦБ за деня и</i> <i>P - цената на сключения сертификат;</i> <i>Q е количеството сертификати.</i> <i>Един сертификат е 1000 единици.</i> Б) Начинът, по който се реализира възвръщаемостта от дериватните ценни книжа <i>В деня на окончателния сетълмент се погасяват задълженията на страните по сделката със сертификата, като на печелившата страна в сметката ѝ в Централен депозитар АД се прехвърля удвоената гаранция по сделката. Датата на сетълмент е 7 (седем) календарни дни след последния ден за търговия.</i> В) Начин на изчисляване <i>Сравнение на договорената цена P с референтния курс на ЕЦБ за деня на окончателния сетълмент на сертификата. Крайната сума за парично плащане се определя както следва:</i> <i>1) Ако референтния курс на ЕЦБ в деня на сетълмента е по-висок от договорената цена P, то гаранциите по сертификата са в полза на Купувача.</i> <i>2) Ако референтния курс на ЕЦБ в деня на сетълмента е по-нисък от или равен на договорената</i>

	<i>цена P, то гаранциите по сертификата са в полза на Продавача.</i>
2.2	Информация относно базовия инструмент <i>Базовият инструмент на Търгуемият сертификат е валутния курс на евро към долар на САЩ (EURUSD), определян от Европейската централна банка (ЕЦБ).</i>
2.2.1	Цената на упражняване или крайната референтна цена на базовия инструмент. <i>Датата на окончателния сетълмент ще бъде 7-ият календарен ден (T+7) след денят на търговия (T0) по референтния курс на ЕЦБ за същия работен ден (определян от ЕЦБ на T+6). Ако T+7 е неработен ден ще се ползва принципа на първия работен ден след T+7.</i> <i>Сравнение на договорената цена P с референтния курс на ЕЦБ за деня на окончателния сетълмент на сертификата. Крайната сума за парично плащане се определя както следва:</i> <i>1) Ако референтния курс на ЕЦБ в деня на сетълмента е по-висок от договорената цена P, то гаранциите по сертификата са в полза на Купувача.</i> <i>2) Ако референтния курс на ЕЦБ в деня на сетълмента е по-нисък от или равен на договорената цена P, то гаранциите по сертификата са в полза на Продавача</i>
2.2.2.	Декларация за вида базов инструмент. <i>Валутен курс на евро към долар на САЩ (EURUSD).</i>
	<i>Информацията за базовия актив – EURUSD е широко разпространена в интернет и е безплатна. Информацията за минали периоди на референтната цена на ЕЦБ е достъпна безплатно на адрес:</i> https://www.ecb.europa.eu/stats/policy_and_exchange_rates/euro_reference_exchange_rates/html/index.bg.html
2.2.3.	Събития, водещи до смущения на пазара или сетълмента, или кредитни събития, които засягат базовия инструмент. <i>Събитията, които биха довели до смущения на пазара или сетълмента имат форсмажорен характер. В този случай възникват обстоятелства, които не могат да бъдат нито предотвратени, нито отстранени с човешки решения или с някакви мероприятия. Това са стихийните бедствия, наводненията, земетресенията и други климатични катаклизми, войните, революциите, и др., Кредитните събития, които засягат базовия инструмент са промени в кредитните рейтинги на ниво държава.</i>
2.2.4.	Правила за корекция във връзка със събития, засягащи базовия инструмент. <i>Видът на базовия инструмент - референтният курс на ЕЦБ за EUR/USD не предполага необходимост от правила за корекция</i>
	Валута на емисията ценни книжа. EUR
3	ДОПЪЛНИТЕЛНА ИНФОРМАЦИЯ
3.1	<i>Емитентът не възнамерява да предостави информация след емитирането.</i>