



ЦЕНТРАЛЕН ДЕПОЗИТАР АД

Наш изх.№ 01-2018-811 / 29-05-2018

ДО: КАПМАН АД

НА ВНИМАНИЕТО НА: АНГЕЛ ХАДЖИЙСКИ
ИЗПЪЛНИТЕЛЕН ДИРЕКТОР

Уважаеми г-н Хаджийски,

В отговор на Вашето искане, приложено Ви изпращам текста на Процедурата за приключване на сделки с Търгуеми сертификати. Процедурата е приета на заседание на Съвета на директорите на Централен депозитар като част от Инструкциите за работа на членовете на ЦД със Системата за Клиринг и Сетълмент и предстои да бъде активирана след изпълнение на всички предварителни условия.

С уважение:

Васил Големански,
Изпълнителен директор



Приключване на сделки с Търгуеми сертификати.

1. Предварително условие за да се извършва сетълмент на Търгуеми сертификати е емисията да бъде заявена и регистрирана в ЦД с всички параметри на продукта – в това число: ISIN код, Базов актив, обем, базова цена, начин на формиране на обезпечение, срочност, ден на търговия и др.
2. Обезпеченията/гаранциите по сделки с Търгуеми сертификати се съхраняват по специална сметка на Централен депозитар до датата на сетълмента. Паричните средства, които следва да бъдат заделени като обезпечение/гаранция по всяка сделка се прехвърлят от сетълмент сметките на участниците в сделката, след мачването на инструкциите и след установяване на достатъчна наличност.

Сделките за Търгуеми сертификати се приключват по следния начин:

3. Страните по дадения финансов инструмент – Търгуем сертификат, подават стандартните инструкции за приключване на сделките съгласно изискванията на Инструкцията за работа на членовете със СКС, за приключване на борсови или извън борсови сделки с ФИ с осигурено DVP (MT 541/MT543) . С код на полето за тип на сделката CDAD\XX...
4. В полето за дата на сетълмент се посочва датата на вальора – дата на която трябва да приключи сделката, в зависимост от продължителността на сертификата. Датата трябва да съвпада с продължителността на инструмента – сертификата.
5. Инструкциите към СКС се подават в деня на сключване на сделките за извън борсовите сделки със Търгуеми сертификати. За сделки сключени на регулиран пазар или МТС инструкциите се подават до края на системния ден T+1 на сключване на сделките.
6. Съобщенията на инструкциите се проверяват за съответствие на синтаксиса.
7. Инструкциите се проверяват за наличие на насрещна инструкция и съответствие с подадена от съответната търговска система информация. Критериите за насрещни сделки са : номер на сделка, обем на сделката, цена на сделката, насрещни страни по сделката , пазара на сключване, ISIN код, дата на сетълмент, дата на сключване.
8. При наличие на насрещни съвпадащи си инструкции по дадена сделка то се отбелязва , че има мачване на инструкциите.
9. При наличие на мачване на инструкциите СКС изчислява съгласно зададените правила на конкретния инструмент размера на обезпеченията/гаранциите по него съгласно параметрите на сключената сделка.
10. Гаранциите се изчисляват и за двете страни по сделката – продавач и купувач.
11. Получените суми, изчислени по т.9, се зареждат в системата като суми за плащане по сделката от двете страни по сделката.
12. Сумите за обезпечението по т.10 се превеждат по съответната сметка на Централен депозитар по т.2.
13. ЦД включва плащанията по т.11 в потока от плащания по сетълмент на сделки с финансови инструменти в RINGS съгласно дневния си график на сетълмент.
14. Сумите натрупани по специалната сметка за управление на обезпечението по т.2 , в съответствие с броя на сделките, не подлежат на ползване до датата на падежа на Търгуемия сертификат.

15. При липса на инструкции от някой от участниците, СКС изчаква докато съответния участник изпрати необходимото съобщение.
16. При липса на достатъчно парични средства за гаранция, тази сделка се отделя и се маркира като чакаща, до получаване на съответната сума за гаранция.
17. При настъпване на падеж по Търгуем сертификат в зависимост от условията на по конкретния продукт ЦД освобождава обезпечението и на двете страни по сделката и съобразно правилата на инструмента ги превежда на печелившата страна като ги включва в платежния поток през RINGS. Плащанията са от специалната сметка за съхранение на обезпечението към сетълмент сметката на страната определена от правилата на МТС с право да получи обезпечението по тази сделка.