

ПРИЛОЖЕНИЕ № 1

към

**Указание за определяне съдържанието и реда за подаване на формите за
сключените сделки на междубанковия паричен пазар и на валутния пазар в
България**

**ИЗГОТВЯНЕ И ДОКЛАДВАНЕ НА ФОРМА ЗА СКЛЮЧЕНИТЕ СДЕЛКИ НА
МЕЖДУБАНКОВИЯ ПАРИЧЕН ПАЗАР В “ИНТЕГРИРАНАТА ИНФОРМАЦИОННА
СИСТЕМА ЗА ФИНАНСОВИ ПАЗАРИ И ЗМР”**

София, 2018 г.

Съдържание

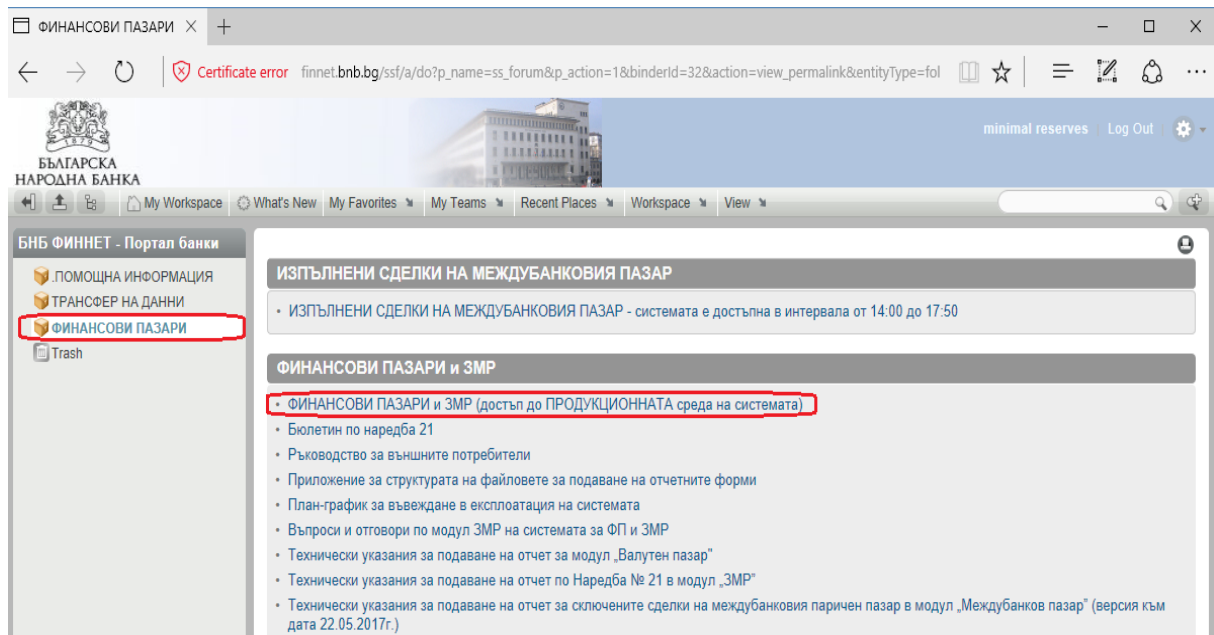
1.	Достъп до Системата.....	3
2.	Подаване на отчет чрез попълване на екранна форма	3
2.1.	Отчетна форма „Сделки на междубанковия пазар”	3
2.2.	Отчетна форма „Канцелирани сделки на междубанковия пазар”	11
3.	Подаване на отчет чрез зареждане на файл	13
3.1.	Характеристики на файла	13
3.2.	Подаване на отчет.....	13
3.3.	Отчетна форма „Сделки на междубанковия пазар”	15
3.3.1.	Структура на XML файла	15
3.3.2.	Примерни файлове	17
а)	Примерен файл на отчет със сделка без обезпечение (левов депозит)	17
б)	Примерен файл на отчет със сделка с обезпечение (репо-сделка)	19
3.4.	Отчетна форма „Канцелирани сделки на междубанковия пазар”	20
3.4.1.	Структура на XML файла	20
3.4.2.	Примерен файл	21

1. Достъп до Системата

„Интегрираната информационна система за финансови пазари и ЗМР“ е достъпна през „ФИННЕТ - Портал на БНБ за услуги на финансовите институции“ > меню „Финансови пазари“ > ФИНАНСОВИ ПАЗАРИ И ЗМР

ФИННЕТ порталът е достъпен чрез линка:

https://www.finnet.bnb.bg/ssf/a/do?p_name=ss_forum&p_action=1&binderId=32&action=view_permalink&entityType=folder&vibeonprem_url=1?vibeonprem_root=1



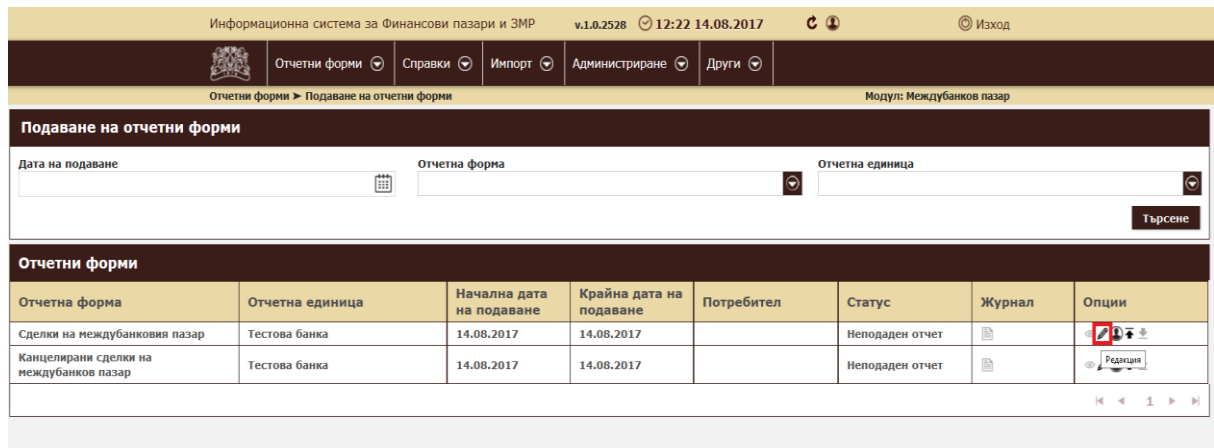
The screenshot shows a web browser window displaying the BNB Finnet portal. The page title is 'ФИНАНСОВИ ПАЗАРИ'. The left sidebar contains a menu with items: 'ПОМОЩНА ИНФОРМАЦИЯ', 'ТРАНСФЕР НА ДАННИ', 'ФИНАНСОВИ ПАЗАРИ' (highlighted with a red box), and 'Trash'. The main content area has two sections: 'ИЗПЪЛНЕНИ СДЕЛКИ НА МЕЖДУБАНКОВИЯ ПАЗАР' and 'ФИНАНСОВИ ПАЗАРИ И ЗМР'. The second section contains a list of links, with the first item 'ФИНАНСОВИ ПАЗАРИ И ЗМР (достъп до ПРОДУКЦИОННАТА среда на системата)' highlighted with a red box.

2. Подаване на отчет чрез попълване на екранна форма

2.1. Отчетна форма „Сделки на междубанковия пазар“

Подаването на отчета за сключените сделки на междубанковия паричен пазар чрез попълване на екранна форма се извършва в следните стъпки:

2.1.1. Избира се меню Отчетни форми > Подаване на отчетни форми > Сделки на междубанковия паричен пазар > бутон „Редакция“ (✎)



The screenshot shows the 'Поддаване на отчетни форми' (Submission of reports) form. The form has fields for 'Дата на подаване' (Submission date), 'Отчетна форма' (Report form), and 'Отчетна единица' (Reporting unit). Below the form is a table of reports:

Отчетна форма	Отчетна единица	Начална дата на подаване	Крайна дата на подаване	Потребител	Статус	Журнал	Опции
Сделки на междубанковия пазар	Тестова банка	14.08.2017	14.08.2017		Неподаден отчет		✎
Канцелирани сделки на междубанковия пазар	Тестова банка	14.08.2017	14.08.2017		Неподаден отчет		✎



The 'Redaction' button (✎) in the 'Опции' column of the first row is highlighted with a red box.


2.1.2. В меню „Отчетна форма“ се попълва общият брой на сключените сделки на междубанковия паричен пазар с вальор датата на отчета.


На екрана автоматично са попълнени полетата:

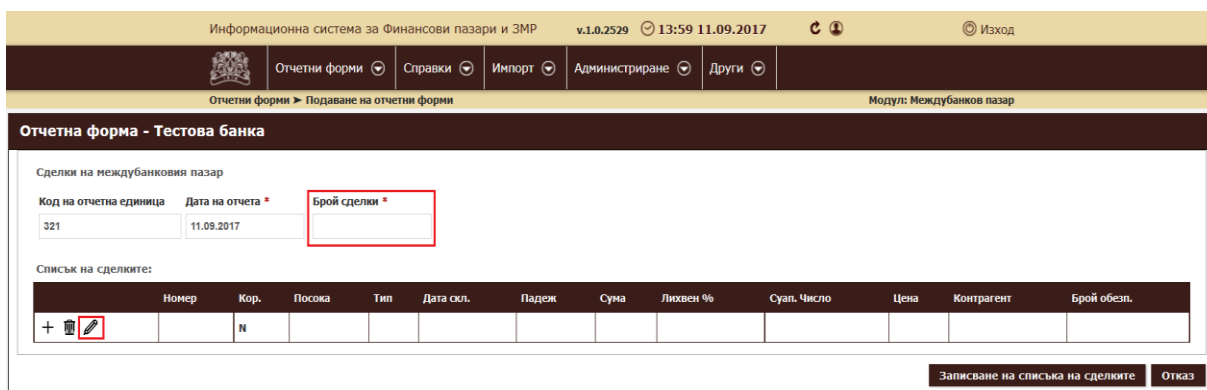
- Код на отчетна единица – зарежда се автоматично от системата според потребителя, който подава отчета. Представя последните 3 цифри от БАЕ кода на отчетната единица (вж. Таблица № 1);
- Дата на отчета – текущата дата, която съответства на датата на вальора за всички сделки докладвани за деня.

В табличен вид на същия екран следва списък на сделките за деня, съдържащ основните характеристики за всяка отделна сделка.

За въвеждане на данни за сделка се избира бутон „Редакция“ (). Бутонът „Редакция“ () се използва и за въвеждане на промени по данните за конкретната сделка в рамките на същия ден.

Добавяне на сделка към списъка за деня се извършва с бутона „Добавяне“ ().

Изтриване на сделка от текущ отчет, се извършва чрез бутона „Премахване“ () на реда на сделката.



Информационна система за Финансови пазари и ЗМР v.1.0.2529 13:59 11.09.2017 Изход

Отчетни форми Справки Импорт Администриране Други



Отчетни форми > Подаване на отчетни форми Модул: Междубанков пазар

Отчетна форма - Тестова банка


Сделки на междубанковия пазар

Код на отчетна единица 321 Дата на отчета * 11.09.2017 Брой сделки *

Списък на сделките:

	Номер	Кор.	Посока	Тип	Дата скл.	Падеж	Сума	Лихвен %	Суап. Число	Цена	Контрагент	Брой обезп.
 		N										

Записване на списъка на сделките Отказ

2.1.3. С избора на бутон „Редакция“ () се визуализира/отваря екрана за попълване на характеристиките на конкретната сделка.

Полетата, които са отбелязани със * са задължителни за въвеждане за всички типове сделки. Полетата, чиито имена са бледо сиви са недостъпни за въвеждане за избрания тип сделка.

Данни за сделката -					
Номер *	<input type="text"/>	(N/C) *	New <input type="button" value="v"/>	Номер на сделката, която се коригира	<input type="text"/>
Дата на сделката, която се коригира	<input type="text"/>	Вид *	-- <input type="button" value="v"/>	Тип *	-- <input type="button" value="v"/>
Овернайт	<input type="checkbox"/>	Сключена на *	<input type="text"/>	Вальор *	<input type="text"/>
Падеж *	<input type="text"/>	Сума *	<input type="text"/>	Валута *	-- <input type="button" value="v"/>
Лихвен %	<input type="text"/>	Суапово число	<input type="text"/>	Фиксиран лихвен %	<input type="text"/>
Плаващ лихвен %	<input type="text"/>	Плаващ лихвен % - наименование	-- <input type="button" value="v"/>		
Контрагент *	-- <input type="button" value="v"/>	Предоговорена	<input type="checkbox"/>	Брой обезпечения *	<input type="text"/>

2.1.4. На екрана за попълване на характеристиките на конкретната сделка се включват следните полета:

- Пореден номер на сключената сделка за деня – за деня номерацията започва от 1 и максимално достига общия брой сделки отбелязан на екрана „Отчетна форма“;
- Флаг за корекция – флаг, посочващ дали сделката е ново-подадена или се извършва корекция по въведени в предходни дни данни.

Възможни стойности „N“ (New) и „C“ (Correction). Това поле се попълва единствено за корекция на данните подадени в предходни дни – т.е. не се попълва при нужда от промяна на параметри по сделката, отчета в текущия ден. При избор на опцията „C“, съответните полета, характеризиращи поредния номер и датата на подаване на отчета в БНБ на сделката, която се коригира, стават достъпни (не са осветени в сиво) и следва да бъдат попълнени.

Преди корекцията да бъде въведена в Системата се изисква БНБ да бъде информирана и да осигури техническата възможност за това;

- Номер на сделката, която се коригира – попълват само при флаг на корекция „C“ и представя поредния номер на сделката, както е попълнена в предходния отчет;
- Дата на сделката, която се коригира – попълват само при флаг на корекция „C“ и представя деня, в който сделката е първоначално подадена;
- Флаг за посока на сделката – латинска буква със следните допустими стойности: „S“ за сделка продава или „B“ за сделка купува.

Стойност „S“ се попълва от институцията предоставяща/заемаща паричните средства, а „B“ се попълва от институцията получаваща/взимаща паричните средства. При репо-сделка (и всяка друга операция с обезпечения) посоката на сделката винаги представя частта на паричните средства, а не на

обезпечението. При сделка тип „Суап в лева“ стойност „S“ се попълва когато рапортуващата институция предоставя средствата с фиксирана лихва и получава плаваща лихва; стойност „B“ се попълва когато рапортуващата институция получава средствата с фиксирана лихва и предоставя плаваща лихва;

- Тип на сделката – избор от номенклатура (вж. Таблица № 2);
- Флаг за сделка овърнайт – въвежда се за типовете сделки [1] „Левов депозит“, [2] „Репо-сделка“ и [8] „Валутен депозит“. Попълва се за всички сделки с дата на сключване съпадаща с датата на вальора, чиито падеж е на следващия работен ден след датата на вальора;
- Дата на сключване на сделката – датата на която е сключена сделката;
- Вальор на сделката – дата на сетълмента на сделката, т.е. датата, на която се изпълнява/стартира трансакцията (следва да съответства на текущата дата на подаване);
- Падеж на сделката – въвежда се за типовете сделки [1] „Левов депозит“, [2] „Репо-сделка“ и [8] „Валутен депозит“. Представя датата, на която трябва да бъдат върнати/получени паричните средства предмет на сделката (и получено/върнато обезпечението в случаите, в които е приложимо);
- Сума на сделката – в **единици** лева или съответната валута на сделката. Сумата се докладва като цяло число в единици, закръглени нагоре до всеки пълен лев или съответната валута (т.е. без въвеждане на стотинки, центове и др.);
- Валута – избира се от номенклатура и представлява три буквен код на валутата на сделката по ISO 4217 (BGN, USD, EUR, и др.);
- Лихвен процент на сделката – въвежда се за типовете сделки [1] „Левов депозит“, [2] „Репо-сделка“ и [8] „Валутен депозит“. Представя стойността на лихвения процент, по който се начислява дължимото лихвено плащане в деня на падежа. Представя се като десетично дробно число, с точност до 5-ия знак след десетичния разделител;
- Суапово число – въвежда се само за сделка тип [6] „Суап в лева“. Представя стойността на суаповото число по сделката, като отношение между фиксирания и плаващия лихвен процент за периода на сделката. Представя се като десетично дробно число, с точност до 6-ия знак след десетичния разделител;
- Фиксиран лихвен процент – въвежда се само за сделка тип [6] „Суап в лева“. Представя стойността на фиксирания лихвен процент по суаповата сделка. Представя се като десетично дробно число, с точност до 5-ия знак след десетичния разделител;
- Плаващ лихвен процент – въвежда се само за сделка тип [6] „Суап в лева“. Представя стойността на плаващия лихвен процент по суаповата сделка, ако е известна към датата на вальора. Представя се като десетично дробно число, с точност до 5-ия знак след десетичния разделител;

- Плаващ лихвен процент - наименование – въвежда се само за сделка тип [6] „Суап в лева“. Представя наименованието на плаващия лихвен процент по суаповата сделка. Избира се от наличните в Системата лихвени индекси (Таблица № 3)¹;
- Контрагент – от наличния в Системата списък (обхващащ извършващите към дадения момент банкова дейност институции в Република България) се избира другата страна по сделката;
- Флаг за предоговорена сделка – отбелязва се за сделки с тип [1] „Левов депозит“, [2] „Репо-сделка“ и [8] „Валутен депозит“.

Като „предоговорена“ следва да се разбира всяка сделка, за която няма движение на парични средства и книжа по сметките на банката, независимо дали има или няма промяна в параметрите на сделката при нейното подновяване²;

- Брой обезпечения за сделката – въвежда се цяло число >0 , ако сделката има обезпечения и 0, ако сделката няма обезпечения. При сделка тип [6] „Суап в лева“ винаги се въвежда 0.
- Списък с обезпечения по сделката – в табличен вид се въвеждат обезпеченията по сделката, ако в полето брой обезпечения е въведено число >0 .

Обезпечения към сделката

Пореден номер	Тип на обезпечението	Номинал	Сума на обезпечението	Валута	ISIN код на емисия ценни книжи
+	<input type="text"/>	--	<input type="text"/>	--	<input type="text"/>

2.1.5. За всяко обезпечение се въвежда следната информация:

- Пореден номер на обезпечението за сделката – за всяка сделка номерацията на обезпеченията започва от 1;
- Тип на обезпечението – възможни стойности: [1] ДЦК, [2] Валута, [3] Други.
 - Тип на обезпечението [1] „ДЦК“ се избира, когато обезпечението е под формата на българска емисия ДЦК в лева, евро, щатски долари или друга валута, емитирани на вътрешния пазар (идентифицирани с ISIN, стартиращ


¹ В случай, че индексът прилаган като плаващия лихвен процент по сделката не е част от списъка, подателят на данни информира БНБ.


² Например, при репо-операция извършена с DVP (Delivery vs. Payment) – т.е. с движение по сметките на двете страни по сделката, сделката не следва да се отбелязва като „предоговорена“.

В същото време при сделка, която се подновява с промяна в параметрите (обем, лихвен процент, падеж или др.), но без движение по сметките на контрагентите, същата следва да се отбелязва като „предоговорена“; в случай че има частично движение по сметките (например промяна в обема на сделката, в следствие на това, че главницата по договора се увеличава или намалява), но това не е придружено с разплащане на предходната операция и нейното цялостно прекратяване, то тази сделка следва да се отбелязва като „предоговорена“.

с BG) или на международните пазари (евро-облигации, идентифицирани с ISIN, стартиращ с XS).

- Тип на обезпечението [2] „Валута“ се избира, когато обезпечението е под формата на сума валутни единици, различна от валутата, в която се извършва сделката.
- Тип на обезпечението [3] „Други“ се избира, когато обезпечението е под формата на ценна книга, различна от българска емисия ДЦК (например корпоративни акции/облигации или ДЦК на друга държава).
- Номинал – попълва се за обезпечение от тип [1] ДЦК и [3] Други. Представя стойността на ценната книга по номинал. Номинала се докладва в **единици**, закръглени нагоре до всеки пълен лев или съответната валута;
- Сума на обезпечението – попълва се за обезпечение от тип [2] Валута. Представя общата сума на валутата в **единици** лева или съответната валута;
- Валута – избира се от номенклатура и представлява три буквен код на валутата на сделката по ISO 4217 (BGN, USD, EUR, и др.);
- ISIN код – попълва се за обезпечение от тип [1] ДЦК и [3] Други. Представя идентификация на ценната книга използвана за обезпечение чрез въвеждане на ISIN кода на емисията.

При нужда от добавяне на обезпечение към сделка се избира бутон Добавяне () , чрез който се създава отделен нов ред за въвеждане на информацията по допълнителното обезпечение.

Изтриване на обезпечение се извършва чрез бутон Премахване () .

2.1.6. Запазването на данните за сделката се извършва чрез бутон „Добавяне към списъка на сделките“ (с което потребителят се връща към предходния екран – „Отчетна форма“).

С бутон „Отказ“ се преустановява въвеждането на данните или направените промени по сделката.

Данни за сделката -

Номер *	<input type="text"/>	(N/C) *	New <input type="button" value="v"/>	Номер на сделката, която се коригира	<input type="text"/>
Дата на сделката, която се коригира	<input type="text"/>	Вид *	-- <input type="button" value="v"/>	Тип *	-- <input type="button" value="v"/>
Овернайт	<input type="checkbox"/>	Сключена на *	<input type="text"/>	Вальор *	<input type="text"/>
Падеж *	<input type="text"/>	Сума *	<input type="text"/>	Валута *	-- <input type="button" value="v"/>
Лихвен %	<input type="text"/>	Суаопово число	<input type="text"/>	Фиксиран лихвен %	<input type="text"/>
Плаващ лихвен %	<input type="text"/>	Плаващ лихвен % - наименование	-- <input type="button" value="v"/>		
Контрагент *	-- <input type="button" value="v"/>	Предоговорена	<input type="checkbox"/>	Брой обезпечения *	<input type="text"/>

Обезпечения към сделката

Пореден номер	Тип на обезпечението	Номинал	Сума на обезпечението	Валута	ISIN код на емисия ценни книги
+ <input type="button" value="x"/>	<input type="text"/>	-- <input type="button" value="v"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	-- <input type="button" value="v"/>

2.1.7. Запазване на отчета за деня се извършва чрез бутона „Записване на списъка на сделките“ (с което потребителят се връща към предходния екран – „Отчетни форми“).

В случай, че съответния ден не са осъществени сделки с вальор същия работен ден се подава отчет с брой сделки „0“.

Отчетна форма -

Сделки на междубанковия пазар

Код на отчетна единица Дата на отчета * 11.09.2017 Брой сделки *

Списък на сделките:

Номер	Кор.	Посока	Тип	Дата скл.	Падеж	Сума	Лихвен %	Суап. Число	Цена	Контрагент	Брой обезп.
+ <input type="button" value="x"/>		N									

2.1.8. След запазване на отчета за деня потребителят следва да извърши проверка за коректността на въведените данни. За целта, в екрана „Отчетни форми“ се проверява статуса на отчета в колона „Статус“.

В случай, че Системата е установила, че има некоректно подадени данни – т.е. такива не преминали успешно автоматичните проверки за формален и логически контрол – потребителят ще бъде предупреден за това посредством съобщение; в допълнение статусът на отчета за деня ще гласи „Подаден с грешни данни“. В

този случай, потребителят следва да се запознае с детайлите около некоректно подадените данни посредством съобщението налично в „Журнал“.

Следва да се премине към корекция на данните чрез въвеждане на промени по характеристиките на конкретната сделка за деня (чрез бутонът „Редакция“ (✎) на реда на съответната сделка в екран „Отчетна форма“).

Зареждането на отчета е неуспешно. Вижте грешките в журнала.

Подаване на отчетни форми

Дата на подаване: 14.06.2017 Отчетна форма: Отчетна единица: 321 Тестова банка **Търсене**

Отчетни форми

Отчетна форма	Отчетна единица	Начална дата на подаване	Крайна дата на подаване	Потребител	Статус	Журнал	Опции
Сделки на междубанковия пазар	Тестова банка	14.06.2017	14.06.2017		Подаден с грешни данни	✎	🔍 ⬇️ ⬆️ ⬇️
Канцелирани сделки на междубанков пазар	Тестова банка	14.06.2017	14.06.2017		Неподаден отчет	📄	🔍 ⬇️ ⬆️ ⬇️

Зареждането на отчета е неуспешно

Подаване на отчетни форми

Дата на подаване: 14.06.2017 **Търсене**

Отчетни форми

Отчетна форма: Отчетна единица: **Търсене**

Сделки на междубанковия пазар Тестова банка

Канцелирани сделки на междубанков пазар Тестова банка

ИС Финансови пазари и ЗМР

Резултат от обработката на файл:

Затвори

Тип	Дата на обработка:	Съобщение
INFO	12.09.2017 11:20:16	Начало на зареждане на отчет
ERROR	12.09.2017 11:20:28	пореден елемент 1: За този тип сделка се попълва Лихвен %.
ERROR	12.09.2017 11:20:28	пореден елемент 1: Валюрът и датата на отчитане трябва да съвпадат.
INFO	12.09.2017 11:20:28	Край на зареждане данни на отчет

Журнал **Опции**

📄 🔍 ⬇️ ⬆️ ⬇️

📄 🔍 ⬇️ ⬆️ ⬇️

2.1.9. След запазването на коректния отчет за деня се избира меню „Приключване на подаването“, където потребителят следва да отбележи текущия ден и да приключи подаването. С това подаването на отчета за сключените сделки на междубанковия паричен пазар за деня приключва.

Приключването на деня е задължително и в случаите, когато няма извършени сделки, съответно отчета за деня е с брой сделки „0“.

Приключването на подаването не ограничава използването на Системата в рамките на същия ден.

Информационна система за Финансови пазари и ЗМР v.1.0.2500 17:11 07.06.2017 Изход					
Отчетни форми		Администриране			
Отчетни форми > Подаване на отчетни форми					
Отчетни форми					
Отчет	Дата на данните в отчета	Дата и час на приключване на подаването	Статус	Журнал	Опции
Сделки на междубанковия пазар	07.06.2017		Подаден с верни данни		
Канцелирани сделки на междубанков пазар	07.06.2017		Неподаден отчет		

2.2. Отчетна форма „Канцелирани сделки на междубанковия пазар”

Отчетна форма „Канцелирани сделки на междубанковия пазар” се подава, когато се налага премахване на сделки, подадени с отчет за предходен ден (предишния работен ден или по-назад във времето).

Преди изпращането на отчет за канцелиране на сделки на междубанковия паричен пазар, БНБ трябва да бъде информирана и да осигури техническата възможност отчета да бъде запазен в Системата.

Подаването се извършва в следните стъпки:

2.2.1. Избира се меню Отчетни форми > Подаване на отчетни форми > Канцелирани сделки на междубанков паричен пазар > бутон „Редакция“ ()

Информационна система за Финансови пазари и ЗМР v.1.0.2529 12:08 12.09.2017 Изход									
Отчетни форми		Справки		Импорт		Администриране		Други	
Отчетни форми > Подаване на отчетни форми						Модул: Междубанков пазар			
Подаване на отчетни форми									
Дата на подаване		Отчетна форма			Отчетна единица				
12.09.2017					321 Тестова банка			Търсене	
Отчетни форми									
Отчетна форма	Отчетна единица	Начална дата на подаване	Крайна дата на подаване	Потребител	Статус	Журнал	Опции		
Сделки на междубанковия пазар	Тестова банка	12.09.2017	12.09.2017		Неподаден отчет				
Канцелирани сделки на междубанков пазар	Тестова банка	12.09.2017	12.09.2017		Неподаден отчет				

2.2.2. На екрана „Отчетна форма“ автоматично са попълнени полетата:

- Код на отчетна единица – зарежда се автоматично от системата според потребителя, който подава отчета. Представя последните 3 цифри от БАЕ кода на отчетната единица (вж. Таблица № 1);

- Дата на отчета – текущата дата.

Данните, които трябва да се въведат от потребителя са:

- Брой сделки за канцелиране;
- Списък на сделките за канцелиране, съдържащ:
 - Пореден номер на сделката за канцелиране, както е подадена в първоначалния отчет към БНБ;
 - Дата на отчета, в който е била подадена сделката, която ще се канцелира;

- Причини за канцелиране на сделката – избира се от списък с номенклатура („Канцелиране поради техническа грешка“ или „Канцелиране поради промяна в договора“).

Добавяне на нова сделка за канцелиране се извършва с бутона „Добавяне“ (+), чрез който ще се създаде нов ред за въвеждане на информацията за идентифициране на сделката.

Изтриване на сделка се извършва чрез бутона „Премахване“ (🗑️) на реда на сделката.

Потребителят има възможност в един отчет за канцелиране да въвежда сделки, които са изпратени в различни предходни дни.

Пореден номер	Дата на отчета, в който е била подадена сделката	Причини за канцелиране на сделката
		Канцелиране поради техническа грешка Канцелиране поради промяна в договора

2.2.3. Запазване на отчета се извършва чрез бутона „Записване на списъка на сделките“ (с което потребителят се връща към предходния екран – „Отчетни форми“). С това подаването на отчета за канцелираните сделки на междубанковия паричен пазар за деня приключва.

Пореден номер	Дата на отчета, в който е била подадена сделката	Причини за канцелиране на сделката
		Канцелиране поради техническа грешка Канцелиране поради промяна в договора

2.2.4. Подобно на правилата приложими за отчетна форма „Сделки на междубанковия пазар“ потребителят следва (1) да се увери в коректността на подадения отчет, (2) да предприеме действия за коригиране, ако има нужда от такова, както и (3) да приключи подаването за деня.

3. Подаване на отчет чрез зареждане на файл

3.1. Характеристики на файла

Файлът с отчета следва да е в XML (eXtensible Markup Language) формат и да следва структурата според описанието на конкретната отчетна форма.

При подаването на отчетни форми с файл се изисква файлът да е с разширение „.xml“, да е с кодировка UTF-8 и с правилно попълнени тагове според описанието на конкретната отчетна форма. Името на файла не се проверява от Системата и може да бъде произволно.

Форматът на датата във файловете е *dd.mm.yyyy*.

За тип данни десетични числа, за обособяване на дробната част, се използва разделител точка [“.“](например стойността за цена на ценна книга трябва да бъде въведена като 100.21, а не 100,21). В зависимост от подаваните данни може да са наложени ограничения за размер на дробната част (например до втория знак след десетичната точка).


В XML файла трябва да са въведени като тагове всички характеристики (атрибути) на сделките, вкл. и тези, които нямат стойност за конкретната сделка; пример за таг без стойност:

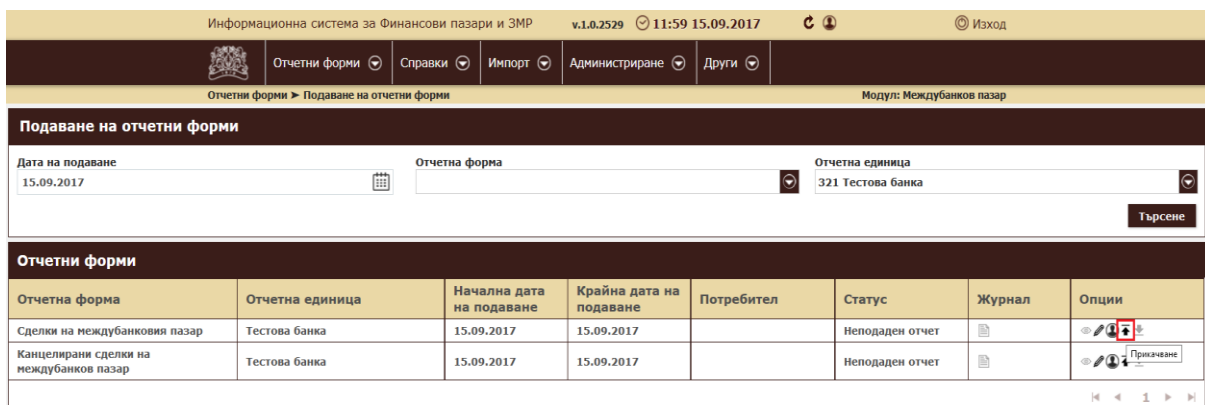
```
<td ind="TagName"></td>
```

```
<td ind="TagName" />
```

3.2. Подаване на отчет

Подаването на отчета за сключените сделки (и за канцелираните сделки) на междубанковия паричен пазар чрез въвеждане на файл се извършва в следните стъпки:

- а) Избира се меню Отчетни форми > Подаване на отчетни форми > Сделки на междубанковия паричен пазар (или Канцелирани сделки на междубанковия пазар) > бутон „Прикачване“ ()



Информационна система за Финансови пазари и ЗМР v.1.0.2529 11:59 15.09.2017 Изход

Отчетни форми | Справки | Импорт | Администриране | Други

Отчетни форми > Подаване на отчетни форми Модул: Междубанков пазар

Подаване на отчетни форми

Дата на подаване: 15.09.2017
Отчетна форма: [dropdown]
Отчетна единица: 321 Тестова банка
Търсене

Отчетни форми

Отчетна форма	Отчетна единица	Начална дата на подаване	Крайна дата на подаване	Потребител	Статус	Журнал	Опции
Сделки на междубанковия пазар	Тестова банка	15.09.2017	15.09.2017		Неподаден отчет		
Канцелирани сделки на междубанковия пазар	Тестова банка	15.09.2017	15.09.2017		Неподаден отчет		Прикачване

Navigation: < > 1 >

- б) В меню „Прикачване на отчетна форма“ се избира предварително подготвения XML файл (стъпка 1), след което избрания файл се зарежда в системата (стъпка 2):

Информационна система за Финансови пазари и ЗМР v.1.0.2529 11:59 15.09.2017 Изход

Отчетни форми > Подаване на отчетни форми Модул: Междубанков пазар

Прикачване на отчетна форма

Сделки на междубанковия пазар

Отчет *

Избор на файл

Зареждане на файл

Отказ

- с) След запазване на отчета за деня потребителят следва да извърши проверка за коректността на въведените данни. За целта, в екрана „Отчетни форми“ се проверява статуса на отчета в колона „Статус“.

В случай, че Системата е установила, че има некоректно подадени данни – т.е. такива не преминали успешно автоматичните проверки за формален и логически контрол – потребителят ще бъде предупреден за това посредством съобщение; в допълнение статусът на отчета за деня ще гласи „Подаден с грешни данни“. В този случай, потребителят следва да се запознае с детайлите около некоректно подадените данни посредством съобщението налично в „Журнал“.

Следва да се премине към корекция на данните, чрез въвеждане на промени по характеристиките на конкретната сделка за деня (чрез бутонът „Редакция“ (✎) на реда на съответната сделка в екран „Отчетна форма“) или чрез зареждане на нов отчет с отразени корекции. Системата запазва последно зареденият отчет със сделки.

Зареждането на отчета е неуспешно. Вижте грешките в журнала.

Подаване на отчетни форми

Дата на подаване: 14.06.2017

Отчетна форма: [dropdown]

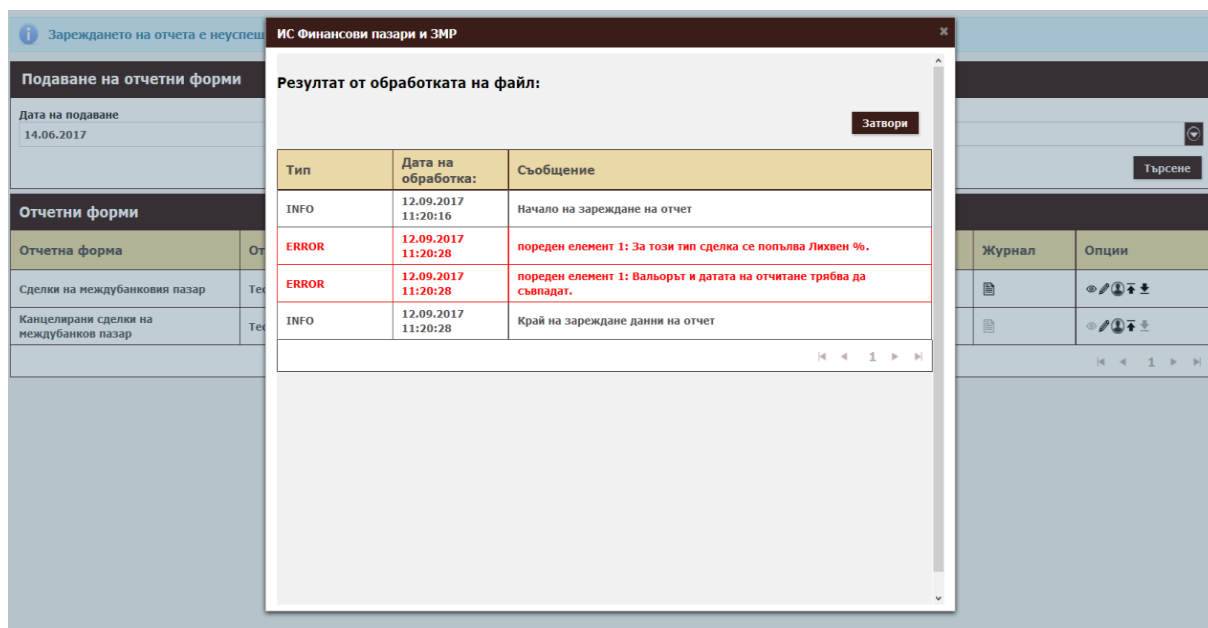
Отчетна единица: 321 Тестова банка

Търсене

Отчетни форми

Отчетна форма	Отчетна единица	Начална дата на подаване	Крайна дата на подаване	Потребител	Статус	Журнал	Опции
Сделки на междубанковия пазар	Тестова банка	14.06.2017	14.06.2017		Подаден с грешни данни	📄	🔍/📄/📄/📄
Канцелирани сделки на междубанков пазар	Тестова банка	14.06.2017	14.06.2017		Неподаден отчет	📄	🔍/📄/📄/📄

« 1 »



- d) След запазването на коректния отчет за деня се избира меню „Приключване на подаването“, където потребителят следва да отбележи текущия ден и да приключи подаването чрез бутона „Запис“. С това подаването на отчета за сключените сделки на междубанковия паричен пазар за деня приключва.

Приключването на деня е задължително и в случаите, когато няма извършени сделки, съответно отчета за деня е с брой сделки „0“.

Приключването на подаването не ограничава използването на Системата в рамките на същия ден.

Информационна система за Финансови пазари и ЗМР v.1.0.2500 17:11 07.06.2017 Изход					
Отчетни форми > Подаване на отчетни форми					
Отчет	Дата на данните в отчета	Дата и час на приключване на подаването	Статус	Журнал	Опции
Сделки на междубанковия пазар	07.06.2017		Подаден с верни данни	📄	🔍 ⬆ ⬇ ⬅
Канцелирани сделки на междубанков пазар	07.06.2017		Неподаден отчет	📄	🔍 ⬆ ⬇ ⬅

Нотификация за приключване на подаване

Дата на подаване

Запис **Отказ**

3.3. Отчетна форма „Сделки на междубанковия пазар“

3.3.1. Структура на XML файла

В началото на XML файла – в таг `<form>`, се съдържат общи данни за отчета.

В таг `<name>` се попълват данните за името на отчетната форма:
`<name reportcode="interbankTransactions"/>`

В същата част на отчетната форма има следните индикатори в тагове `<info>`:

- **UnitCode** – Код на отчетната единица (по номенклатура, вж. Таблица 1);
- **ReportDate** – Дата на отчета, съвпадаща с датата на вальора на сделките включени в отчета;
- **ReportCnt** – Брой сделки, съдържащи се във файла/отчета;

В следващата част на XML файла – в таг `<table>`, се описват сделките в отчета. Всеки ред (таг `<tr>`) описва една сделка в отчета. В тагове `<td>` се описват следните характеристики (атрибути) на сделката³:

- **Num** – Номер (пореден номер, уникален за датата на отчета);
- **FlagCorr** – Флаг за корекция с допустими стойности **N** (New/нова сделка) или **C** (Correction/корекция на сделка);
- **CorrDealNumber** – Номер на сделката, която се коригира;
- **CorrDate** – Дата на отчета включващ сделката, която се коригира;
- **Direction** – Посока на сделката от гледна точка на подаващия отчета с възможни стойности **B** (Buy/купува) или **S** (Sell/продава);
- **DealType** – Тип (по номенклатура, виж Таблица 2);
- **FlagOvernight** – Флаг за овърнайт с допустими стойности **Y** (Yes/ сделката е овърнайт) или **N** (No/сделката не е овърнайт);
- **TradeDate** – Дата на сключване;
- **ValueDate** – Вальор;
- **MaturityDate** – Падеж;
- **DealAmount** – Сума, представена като цяло число, в единици лева или съответната валута на сделката;
- **DealCurrency** – Код на валутата на сделката (3 буквен код по ISO 4217 (BGN, USD, EUR и др.));
- **InterestRate** – Лихвен процент, представен като десетично число, с точност до 5-ия знак след десетичния разделител;
- **SwapPoints** – Суапово число, представено като десетично число, с точност до 6-ия знак след десетичния разделител;
- **FixedInterestRate** – Фиксиран лихвен процент, представен като десетично число, с точност до 5-ия знак след десетичния разделител;
- **FloatingInterestRate** – Плаващ лихвен процент, представен като десетично число, с точност до 5-ия знак след десетичния разделител;
- **FloatingInterestRateName** – Наименование на плаващия лихвен процент, избор от номенклатура;
- **Counterparty** – Контрагент, подава се код на отчетна единица според номенклатура в Таблица 1;

³ За детайли относно правилата за попълване на различните характеристики (атрибути) по сделките вж. точка 2.1.4

- **FlagRenegotiated** – Флаг за преговорена сделка с допустими стойности **Y** (Yes/сделката е преговорена) или **N** (No/сделката не е преговорена);
- **Collaterals** – Брой обезпечения.

В последният таг `<td>` се описват обезпеченията към сделката, като втора таблица вложена в първата таблица. Тази част може да се мултиплицира в зависимост от броя обезпечения към сделката.

В тагове `<td>` се описват следните характеристики (атрибути) на обезпечението⁴:

- **NumCollaterals** – Пореден номер на обезпечението за сделката, уникално в рамките на сделката, стартиращо от 1;
- **TypeCollaterals** – Тип на обезпечението с допустими стойности **[1]** за ДЦК, **[2]** за Валута, **[3]** за Други.
- **NominalCollaterals** – Номинал на ценна книга, представен като цяло число, в единици лева или съответната валута;
- **CollateralAmount** – Сума на обезпечението, представена като цяло число, в единици лева или съответната валута;
- **CollateralCurrency** – Код на валута на обезпечението (3 буквен код по ISO 4217 (BGN, USD, EUR и др.));
- **CollateralISIN** – ISIN код на емисия ценна книга.

3.3.2. Примерни файлове

a) Примерен файл на отчет със сделка без обезпечение (левов депозит)

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<inputForm>
  <body>
    <form>
      <name reportcode="interbankTransactions" />
      <info ind="UnitCode">300</info>
      <info ind="ReportDate">18.03.2016</info>
      <info ind="ReportCnt">1</info>
    </form>
    <table id="dealList">
      <tr>
        <td ind="Num">1</td>
        <td ind="FlagCorr">N</td>
        <td ind="CorrDealNumber" />
        <td ind="CorrDate" />
      </tr>
    </table>
  </body>
</inputForm>
```

⁴ За детайли относно правилата за попълване на различните характеристики (атрибути) по обезпечението вж. точка 2.1.5

```
<td ind="Direction">S</td>
<td ind="DealType">1</td>
<td ind="FlagOvernight">Y</td>
<td ind="TradeDate">18.03.2016</td>
<td ind="ValueDate">18.03.2016</td>
<td ind="MaturityDate">19.03.2016</td>
<td ind="DealAmount">100000</td>
<td ind="DealCurrency">BGN</td>
<td ind="InterestRate">0.2</td>
<td ind="SwapPoints" />
    <td ind="FixedInterestRate" />
    <td ind="FloatingInterestRate" />
    <td ind="FloatingInterestRateName" />
<td ind="Counterparty">800</td>
<td ind="FlagRenegotiated">N</td>
<td ind="Collaterals">0</td>
<td>
    <table id="securityList">
        <tr>
            <td ind="NumCollaterals" />
            <td ind="TypeCollaterals" />
            <td ind="NominalCollaterals" />
            <td ind="CollateralAmount" />
            <td ind="CollateralCurrency" />
            <td ind="CollateralISIN" />
        </tr>
    </table>
</td>
</tr>
</table>
</body>
</inputForm>
```

b) Примерен файл на отчет със сделка с обезпечение (репо-сделка)

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<inputForm>
  <body>
    <form>
      <name reportcode="interbankTransactions" />
      <info ind="UnitCode">300</info>
      <info ind="ReportDate">27.12.2016</info>
      <info ind="ReportCnt">1</info>
    </form>
    <table id="dealList">
      <tr>
        <td ind="Num">1</td>
        <td ind="FlagCorr">N</td>
        <td ind="CorrDealNumber" />
        <td ind="CorrDate" />
        <td ind="Direction">B</td>
        <td ind="DealType">2</td>
        <td ind="FlagOvernight">N</td>
        <td ind="TradeDate">27.12.2016</td>
        <td ind="ValueDate">27.12.2016</td>
        <td ind="MaturityDate">29.12.2016</td>
        <td ind="DealAmount">1000000</td>
        <td ind="DealCurrency">BGN</td>
        <td ind="InterestRate">0.2</td>
        <td ind="SwapPoints" />
        <td ind="SwapPoints" />
          <td ind="FixedInterestRate" />
          <td ind="FloatingInterestRate" />
          <td ind="FloatingInterestRateName" />
        <td ind="Counterparty">800</td>
        <td ind="FlagRenegotiated">N</td>
        <td ind="Collaterals">1</td>
      <td>
```

```

<table id="securityList">
  <tr>
    <td ind="NumCollaterals">1</td>
    <td ind="TypeCollaterals">1</td>
    <td ind="NominalCollaterals">1100000</td>
    <td ind="CollateralAmount" />
    <td ind="CollateralCurrency">BGN</td>
    <td ind="CollateralISIN">BG2040016219</td>
  </tr>
</table>
</td>
</tr>
</table>
</body>
</inputForm>

```

3.4. Отчетна форма „Канцелирани сделки на междубанковия пазар”

Отчетна форма „Канцелирани сделки на междубанковия пазар” се подава, когато се налага премахване на сделки, подадени с отчет за предходен ден (предишния работен ден или по-назад във времето).

Преди изпращането на отчет за канцелиране на сделки на междубанковия паричен пазар БНБ трябва да бъде информирана и да даде изричното си съгласие отчета да бъде запазен в Системата.

3.4.1. Структура на XML файла

В началото на XML файла – в таг `<form>`, се съдържат общи данни за отчета.

В таг `<name>` се попълват данните за името на отчетната форма:

```
<name reportcode="CancelInterbankTrans" depends="interbankTransactions"/>
```

В същата част на отчетната форма има следните индикатори в тагове `<info>`:

- **UnitCode** – Код на отчетната единица (по номенклатура, вж. Таблица 1);
- **ReportDate** – Дата на отчета (текущия ден);
- **ReportCnt** – Брой сделки за канцелиране, съдържащи се във файла/отчета;

В следващата част на XML файла – в таг `<table>`, се описват канцелираните сделки в отчета. Всеки ред (таг `<tr>`) описва една канцелирана сделка. В тагове `<td>` се описват следните характеристики (атрибути) на сделката:

- **Num** – Пореден номер на сделката за канцелиране както е подадена в първоначалния отчет към БНБ;

- **DealDate** – Дата на отчета, в който е била подадена сделката, която ще се канцелира;
- **Note** – Причини за канцелиране на сделката. Допустими стойности: [1] („Канцелиране поради техническа грешка“) или [2] („Канцелиране поради промяна в договора“).

3.4.2. Примерен файл

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<inputForm>
  <body>
    <form>
      <name reportcode="CancelInterbankTrans" depends="interbankTransactions"/>
      <info ind="UnitCode">300</info>
      <info ind="ReportDate">17.03.2016</info>
      <info ind="ReportCnt">1</info>
    </form>
    <table id="dealList">
      <tr>
        <td ind="Num">1</td>
        <td ind="DealDate">14.03.2016</td>
        <td ind="Note">1</td>
      </tr>
    </table>
  </body>
</inputForm>
```

Таблица № 1: Код на отчетната единица (UnitCode)⁵

Код на отчетна единица (UnitCode)	Банка	БАЕ код
120	Инвестбанк АД	IORT9120
130	Общинска банка АД	SOMB9130
145	ИНГ Банк Н.В. - кл. София	INGB9145
150	Първа инвестиционна банка АД	FINV9150
155	Райфайзенбанк (България) ЕАД	RZBB9155
160	Българо-американска кредитна банка АД	BGUS9160
170	Банка Пиреос България АД	PIRB9170
200	Обединена българска банка АД	UBBS9200
230	ПроКредит Банк (България) АД	PRCB9230
240	Търговска банка Д АД	DEMI9240
250	Ситибанк Европа АД, клон България	CITI9250
260	Токуда Банк АД	CREX9260
300	Банка ДСК ЕАД	STSA9300
310	ТИ БИ АЙ Банк ЕАД	TBIB9310
350	Те-Дже Зираат Банкасы - клон София	TCZB9350
400	Сосиете Женерал Експресбанк АД	TTBB9400
440	БНП Париба С. А. - клон София	BNPA9440
444	БНП Париба Пърсънъл Файненс С.А. - клон БЪЛГАРИЯ	BPEF9290
470	Интернешънъл Асет Банк АД	IABG9470
480	Търговска банка "Виктория" ЕАД	BINV9480
545	Тексим Банк АД	TEXI9545
561	Алианц Банк България АД	BUI9561
620	Българска банка за развитие АД	NASB9620
790	Централна кооперативна банка АД	CECB9790
800	УниКредит Булбанк АД	UNCR9660
920	Юробанк България АД	BPBI9920

⁵ Към 1 октомври 2018 г.

Таблица № 2: Типове сделки (DealType)

Тип (DealType)	Наименование
1	Левов депозит
2	Репо-сделка
6	Суап в лева
8	Валутен депозит

Таблица № 3: Наименование на плаващ лихвен процент

Наименование
ЛЕОНИЯ Плюс
ОЛП
EONIA
3M EURIBOR
3M USD LIBOR
ESTER
SOFR