

# Наредба № 31

## на БНБ

### от 4 октомври 2007 г.

### за сетълмент на държавни ценни книжа

(Обнародвана в „Държавен вестник“, бр. 85 от 23 октомври 2007 г.;  
изм. и доп., бр. 100 от 2013 г.; изм. и доп., бр. 22 от 2022 г.)

#### Глава първа

#### Общи положения

**Чл. 1.** С тази наредба се урежда сетълментът на сделките с безналични държавни ценни книжа, емитирани от министъра на финансите на вътрешния пазар, наричани по-нататък „държавни ценни книжа“ (ДЦК) в Българската народна банка (БНБ), и воденето на индивидуални сметки от поддепозитарите на ДЦК по реда на Наредба № 5 от 2007 г. за реда и условията за придобиване, регистриране, изплащане и търговия с държавни ценни книжа (Наредба № 5 от 2007 г.).

**Чл. 2.** (Доп. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.) Сетълмент на сделки с ДЦК в БНБ е прехвърляне на ДЦК със или без прехвърляне на парични средства въз основа на искане/уведомление за сделка, подадено чрез електронната система за регистриране и обслужване на търговията с безналични ДЦК – ЕСРОТ.

**Чл. 3.** (1) Българската народна банка изгражда и организира система за сетълмент на ДЦК (СДЦК), в която участват най-малко трима членове, които могат да бъдат първични дилъри, поддепозитари на ДЦК и други лица – участници в ЕСРОТ, определени по реда на чл. 3 от Наредба № 5 от 2007 г.

(2) (Доп. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.) Прехвърляне на парични средства по сделки с ДЦК се извършва чрез системата за брутен сетълмент в реално време – РИНГС (RINGS, Real-time INterbank Gross-settlement System) и Трансевропейската автоматизирана система за брутен сетълмент на експресни преводи в реално време TARGET2.

**Чл. 4.** (1) Българската народна банка е агент по сетълмента на държавни ценни книжа.

(2) (Изм. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.) Българската народна банка създава и поддържа системите по чл. 2 и чл. 3, ал. 1 с общи правила, гарантиращи изпълнението на задълженията, свързани с участието в системите на основата на споразумение.

(3) Искане/уведомление за регистриране на сделка с ДЦК, изпратено към системата ЕСРОТ в съответствие с нейните правила, не може да бъде отменено след момента, посочен в правилата на системата. Действия, извършени от участник в системата или от трето лице след този момент,

които имат за цел да оттеглят или отменят това искане/уведомление за регистрация на сделката, са невалидни.

**Чл. 5.** (Изм. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.) Като агент по сетълмента БНБ служебно извършва сетълмента на сделки с ДЦК на първичния и вторичния пазар по сметките за сетълмент на парични средства на участниците в РИНГС и ТАРГЕТ2 и сметките за сетълмент на ДЦК, водени в системата СДЦК.

**Чл. 6.** (1) Сетълментът по сделките с ДЦК може да бъде:

1. с движение на парични средства при спазване на принципа „гоставка срещу плащане“ (DVP – delivery versus payment), при който трансферът на ДЦК и парични средства се осъществява едновременно на брутна база („DVP – Модел 1“);

2. (изм. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.) без движение на парични средства (FOF – free of payment).

(2) (Изм. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.) Сетълментът по сделките с ДЦК се извършва по предварително обявен от МФ и БНБ график на системния ден на ЕСРОТ в съответствие с работното време на системите РИНГС и ТАРГЕТ2.

(3) Сетълментът по сделките с ДЦК, с изключение на тези по чл. 20, ал. 2 и 3 от Наредба № 5 от 2007 г., се извършва при спазване на принципа на двустранното уведомление – по едно искане за извършване на сделката от всяка една от страните.

(4) Извършените сделки се потвърждават в най-кратък срок след приключването на сделките.

## *Глава втора*

### **Откриване, водене и закриване на сметки за сетълмент на гържавни ценни книжа**

(Загл. изм. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.)

**Чл. 7.** (Изм. и доп. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.) Българската народна банка открива сметка за сетълмент на ДЦК на емитента, по която се отразяват всички ДЦК от една емисия при първоначалното емитиране, обратно изкупуване преди падежа и падежирането им. Българската народна банка гарантира интегритета на всяка една емисия ДЦК от момента на нейното емитиране до падежа ѝ.

**Чл. 8.** (1) (Доп. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.) Българската народна банка открива и води в СДЦК сметки за сетълмент на ДЦК, както следва:

1. сметка „ДЦК, собственост на участници в СДЦК“;
2. сметка „ДЦК, притежавани общо от клиенти на участници в СДЦК“;
3. сметка „ДЦК, собственост на участници в СДЦК с наложена тежест“.

(2) (Доп. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.) По преценка на БНБ могат да се откриват и други сметки за сетълмент на ДЦК на участниците в системата за сетълмент на ДЦК.

(3) Блокиране на ДЦК по сметката по ал. 1, т. 3 се извършва при:

- а) учредяване на залог по Закона за особените залози;
- б) обезпечаване на средства по сметки и депозити на бюджетни организации в банки;
- в) други случаи.

**Чл. 9.** Българската народна банка служебно открива сметките по чл. 8 за всяка емисия ДЦК, придобити на първичния и/или вторичния пазар, въз основа на подадено писмено искане по образец съгласно приложение № 1.

**Чл. 10.** (1) (Изм. и доп. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.) По откритите сметки за сетълмент на ДЦК се отразява извършеният сетълмент на сделките с ДЦК на първичния и вторичния пазар по номинална стойност на ДЦК, предмет на сделката. Сетълментът на сделките с ДЦК е финален, след като се завери сметката за сетълмент на ДЦК на приобретателя.

(2) (Доп. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.) Информация за състоянието на сметките за сетълмент на ДЦК се предоставя на титуляря на сметките ежедневно при движение по тях и месечно при поискване.

**Чл. 11.** (1) Поддепозитарите на ДЦК откриват и водят индивидуални сметки за ДЦК, отчитащи притежаваните ДЦК от техни клиенти и от клиенти на участници в ЕСПОТ, които не са поддепозитари. Откриването и воденето на сметките на клиенти на участник в ЕСПОТ, който не е поддепозитар, се осъществява на базата на уведомления от участника в ЕСПОТ до поддепозитаря в съответствие със сключен между участника и поддепозитаря договор. Отговорността за изготвянето и предаването на съответните уведомления и тяхното основание е изцяло на участника в ЕСПОТ, който не е поддепозитар.

(2) Поддепозитарите отделят собствените ДЦК от тези на клиентите, като не отговарят пред кредиторите си с ДЦК на клиенти, за които водят сметки по ал. 1.

**Чл. 12.** (1) (Доп. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.) Сметките за сетълмент на ДЦК по чл. 8, водени на името на участниците в сетълмента, се закриват при получено писмено искане от титуляря на сметките (приложение № 2). Сметките се закриват в двудневен срок от получаване на искането, за което се уведомява титулярята.

(2) (Доп. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.) Сметките за сетълмент на ДЦК, открити за емисия ДЦК по реда на чл. 8, се закриват служебно от БНБ при настъпване падежа на емисията ДЦК.

### Глава трета

## Сетълмент на ДЦК при първоначално придобиване, изплащане на ДЦК и лихвите по тях и обратно изкупуване или замяна

**Чл. 13.** (Изм. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.) При придобиване на ДЦК на първичния пазар по реда на глава втора от Наредба № 5 от 2007 г. БНБ извършва сетълмента, като задължава сметките за сетълмент на парични средства в РИНГС, съответно в ТАРГЕТ2, посочени от участниците в ЕСРОТ, с общата стойност на придобитите от тях и техни клиенти ДЦК, заверява сметката на емитента при БНБ и същевременно записва по номинална стойност придобитите от участниците ДЦК по техните сметки за сетълмент на ДЦК и по сметките за сетълмент на ДЦК, отчитащи придобитите общо от техните клиенти ДЦК.

**Чл. 14.** (Изм. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.) При изплащане на ДЦК с настъпил падеж и/или на лихвите по тях по реда на чл. 35 от Наредба № 5 от 2007 г. БНБ задължава сметката на емитента при БНБ, заверява сметките за сетълмент на парични средства, посочени от участниците, с размера на дължимите суми за изплащане на притежаваните от тях и техни клиенти ДЦК и отписва от сметките за сетълмент на ДЦК на участниците и от сметките за сетълмент на ДЦК на техните клиенти номиналната стойност на падежираните ДЦК.

**Чл. 15.** (1) При обратно изкупуване на ДЦК преди падежа чрез изплащане по реда на глава шеста от Наредба № 5 от 2007 г. БНБ извършва сетълмента по реда на чл. 14.

(2) (Доп. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.) При обратно изкупуване на ДЦК преди падежа чрез замяна/подписки за замяна на ДЦК по реда на глави шеста и седма от Наредба № 5 от 2007 г. БНБ извършва сетълмента, като отписва ДЦК от съответната емисия от сметките за сетълмент на ДЦК на участниците и записва по сметките им ДЦК от новата емисия по номинална стойност.

### Глава четвърта

## Сетълмент на ДЦК на вторичния пазар

**Чл. 16.** Българската народна банка извършва сетълмента на сделките с ДЦК на вторичния пазар, посочени в чл. 16 от Наредба № 5 от 2007 г.

**Чл. 17.** Сетълментът по сметките на участниците при сделки с ДЦК, сключени по реда на глава трета, раздел I от Наредба № 5 от 2007 г., се извършва, като:

1. (изм. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.) при сделки с движение на парични средства се задължава сметката за сетълмент на парични средства, посочена от приобретателя, и се заверява сметката за сетълмент на парични средства, посочена от прехвърлителя, със сумата, посочена в искането за сделката, и

едновременно с това се задължава сметката за сетълмент на ДЦК на прехвърлителя и се заверява сметката за сетълмент на ДЦК на приобретателя с номиналната стойност на ДЦК, предмет на сделката;

2. (изм. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.) при сделки без движение на парични средства се задължава сметката за сетълмент на ДЦК на прехвърлителя и се заверява сметката за сетълмент на ДЦК на приобретателя с номиналната стойност на ДЦК, предмет на сделката.

**Чл. 18.** (Доп. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.) При сделки с ДЦК, сключени по реда на глава трета, раздел II от Наредба № 5 от 2007 г., сетълментът по сметките на участниците и техните клиенти се извършва, като се задължава сметката за сетълмент на ДЦК на прехвърлителя и се заверява сметката за сетълмент на ДЦК на приобретателя с номиналната стойност на ДЦК, предмет на сделката.

**Чл. 19.** (Изм. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.) Българската народна банка извършва сетълмента на ДЦК при сделки по глава четвърта от Наредба № 5 от 2007 г., като задължава/заверява сметките за сетълмент на ДЦК, собственост на участниците в ЕСРОТ, и заверява/задължава сметките им за сетълмент на ДЦК с наложена тежест по номинална стойност.

### *Глава четвърта „а“*

## **Неуспешен сетълмент на ДЦК на вторичния пазар**

(Нова – ДВ, бр. 22 от 2022 г.)

**Чл. 19а.** (Нов – ДВ, бр. 22 от 2022 г.) В случай че сетълмент не може да се извърши на предвидената за това дата поради липса на ДЦК или на парични средства, БНБ унифицира повторно инструкции за сетълмент на ДЦК ежедневно в срок от четири работни дни.

**Чл. 19б.** (Нов – ДВ, бр. 22 от 2022 г.) (1) Член 19а не се прилага в случаите на сделки с ДЦК, посочени в чл. 16, ал. 1, т. 2 и 3 от Наредба № 5 от 2007 г., ако вальорът на репо сделката и вальорът на падежа на заема е на дата, по-ранна от определения четириднешен срок.

(2) Участниците в ЕСРОТ могат двустранно да отменят вече стиковани инструкции за сетълмент, които са част от една и съща сделка и чийто сетълмент е бил неуспешен в определения по чл. 19а срок.

**Чл. 19б.** (Нов – ДВ, бр. 22 от 2022 г.) (1) За всяка инструкция за сетълмент, по която сетълментът е бил неуспешен, БНБ начислява наказателна лихва на участника, причинил неуспешния сетълмент.

(2) Наказателната лихва по ал. 1 се начислява и удържа в края на всеки работен ден, в който не е извършен сетълментът по инструкцията за сетълмент, в определения по чл. 19а срок.

(3) Наказателната лихва се събира служебно от БНБ и се превежда на участника, засегнат от неуспешния сетълмент.

(4) Наказателната лихва по ал. 1 се изчислява, както следва:

1. при неуспешен сетълмент поради липса на ДЦК – 0.10 базисни точки от пазарната стойност на ДЦК за определения по чл. 19а срок, предмет на сделката;

2. при неуспешен сетълмент поради липса на парични средства – размерът на основния лихвен процент на БНБ плюс разликата между лихвения процент по пределното кредитно улеснение на ЕЦБ и лихвения процент по основните операции по рефинансиране на ЕЦБ за определения по чл. 19а срок върху пазарната стойност на ДЦК, предмет на сделката.

(5) В случай че на регулиран пазар или на многостранна система за търговия не е налична пазарна стойност за съответната емисия ДЦК или същата е под номинала на ДЦК, при изчислението на наказателната лихва по ал. 4 се използва номиналната стойност на ДЦК.

**Чл. 19г.** (Нов – ДВ, бр. 22 от 2022 г.) Българската народна банка публикува ежегодно на интернет страницата си данни съгласно приложение III от 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 дисциплина при сетълмента за случаите на неуспешен сетълмент и ги докладва на Министерството на финансите.

## *Глава пета*

### **Изключване на участник от сетълмента на ДЦК**

**Чл. 20.** Не се обработват искания/уведомления и не се извършва сетълмент на сделки с ДЦК, когато участието в ЕСПОТ е прекратено по реда на чл. 6, ал. 1 от Наредба № 5 от 2007 г.

**Чл. 21.** Сетълментът по сметките, отчитащи общо притежаваните ДЦК от клиенти на участник, спрямо който е приложена мярка по чл. 20, се извършва съгласно чл. 36, ал. 2 от Наредба № 5 от 2007 г.

**Чл. 22.** Отнемането на лиценза на участник в СДЦК, както и откриването на производство по несъстоятелност спрямо друг участник в системата, не засягат задължението на системата да обработи и извърши сетълмент на подадените от този участник нареждания за регистриране на прехвърляне, както и валидността и противоположимостта спрямо трети лица на такива нареждания, ако те са били приети от системата в съответствие с нейните правила.

## *Глава шеста*

### **Коригиране на грешки**

**Чл. 23.** (1) При установяване на данни за грешни вписвания в ЕСПОТ БНБ извършва незабавна проверка по реда на Наредба № 15 от 2007 г.

(2) В случай че при проверката се установи, че погрешното вписване в ЕСРОТ е извършено от БНБ, тя извършва служебно коригиращи операции с текущ валюор, като уведомява участника/участниците за това.

(3) В случай че при проверката се установи, че погрешното вписване в ЕСРОТ е резултат от изпълнено искане/уведомление от участници в ЕСРОТ, изпратено по реда на Наредба № 5 от 2007 г., БНБ извършва коригиращи операции с текущ валюор въз основа на получено от участниците искане/уведомление по реда на глави трета и четвърта от Наредба № 5 от 2007 г.

**Чл. 24.** Българската народна банка не отговаря за вреди, свързани с регистрацията и сетълмента на сделки с ДЦК, причинени в резултат на непълна, невярна или неточна информация, предоставена от участниците в ЕСРОТ.

## Допълнителна разпоредба

§ 1. По смисъла на тази наредба:

1. (изм. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.) „Сметка за сетълмент на ДЦК“ е сметка при централна банка или агент по сетълмента, използвана за съхраняване на държавни ценни книжа и за сетълмент по сделки между участници в системата.

2. (изм. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.) „Сметка за сетълмент на парични средства“ е сметка при централна банка или агент по сетълмента, използвана за съхраняване на парични средства и за сетълмент по сделки между участници в системата. Сметките за сетълмент на парични средства могат да бъдат в левове в РИНГС и в евро в ТАРГЕТ2.

3. (изм. и доп. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.) „Искане/уведомление за сделка“ е нареждане на участник в сетълмента на ДЦК, предадено по електронен път към БНБ, за осъществяване на прехвърляне на ДЦК по определена сметка за сетълмент в СДЦК, със или без движение по сметките за сетълмент на парични средства.

4. (доп. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.) „Прехвърлител“ е лице, прехвърлящо ДЦК от неговите сметки за сетълмент на ДЦК.

5. (доп. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.) „Приобретател“ е лице, придобиващо ДЦК по неговите сметки за сетълмент на ДЦК.

6. „Потвърждение на сделка“ е изпратеният до участниците счетоводен документ (МО) за извършения сетълмент по сделката.

7. (Нова – ДВ, бр. 22 от 2022 г.) „Неуспешен сетълмент“ е липса на сетълмент на сделка с държавни ценни книжа на предвидената дата за сетълмент поради липса на ДЦК или парични средства, независимо от причината за тази липса.

8. (Нова – ДВ, бр. 22 от 2022 г.) „Предвидена дата на сетълмент“ е дата, на която страните по сделката са се договорили, че трябва да се извърши сетълментът.

9. (Нова – ДВ, бр. 22 от 2022 г.) „Пазарна с тойност“ е понятие по смисъла на чл. 7, буква „б“ от Делегиран регламент (ЕС) 2017/389 на Комисията от 11 ноември 2017 г. за допълване на Регламент (ЕС) № 909/2014 по отношение на параметрите за изчисляване на паричните санкции за неуспешен сетълмент и на операциите на ЦДЦК в приемащите държави членки.

### **Преходни и заключителни разпоредби**

§ 2. Тази наредба е издадена на основание чл. 36, ал. 3 от Закона за държавния дълг, приета е с Решение № 113 от 4 октомври 2007 г. на Управителния съвет на БНБ и влиза в сила от 1 ноември 2007 г.

§ 3. Тази наредба отменя Наредба № 31 за сетълмент на ДЦК (ДВ, бр. 70 от 2003 г.).



Приложение № 1

към чл. 9

(Изм. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.)

До Българска народна банка, Управление „Фискални услуги“	Наименование на участника
<b>ИСКАНЕ</b> за откриване на сметки за сметмент на ДЦК	
Открийте на – (наименование на участника, в полза на който се откриват сметките)	
Седалище и адрес	Адрес за кореспонденция
Сметки за сметмент на ДЦК по чл. 8 от Наредба № 31 от 2007 г.	Водят се в СДЦК
Със сметките могат да се разпореждат – (трите имена и длъжността на лицата, които представляват участника и могат да се разпореждат със сметките, както и на упълномощените от тях други лица да подписват документи за извършване на сделки с ДЦК):	
Известни са ни и имат задължителна сила за нас условията по Наредба № 31 от 2007 г., Наредба № 5 от 2007 г. и Наредба № 15 от 2007 г., както и други приложими норми, свързани с пазара на ДЦК.	
Декларираме, че са ни известни условията, при които БНБ открива, води и закрива служебно сметките за ДЦК.	
Задължаваме се при промяна на лицата, упълномощени да се разпореждат със сметките, своевременно да Ви уведомим и Ви представим нужните документи.	
Известно ни е, че за неверни данни подписалите това искане носят наказателна отговорност.	
Място и дата на подаване	Подписи на лицата, които имат право да представляват участника

Приложение № 2

към чл. 12, ал. 1

(Изм. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.)

До БНБ – У-ние „Фискални услуги“ \_\_\_\_\_

Име на титуляря на сметки за сетълмент на ДЦК \_\_\_\_\_

Адрес \_\_\_\_\_

Адрес \_\_\_\_\_

**ИСКАНЕ ЗА ЗАКРИВАНЕ НА СМЕТКИ ЗА СЕТЪЛМЕНТ НА ДЦК**

Закрийте сметки за сетълмент на ДЦК по чл. 8 от Наредбата на БНБ за сетълмент на ДЦК, открити на наше име в СДЦК.

Място на подаване

Подписи на лицата, които имат право да представляват участника

Дата

**Наредба за изменение и допълнение  
на Наредба № 31 от 2007 г.  
за сетълмент на държавни ценни книжа**  
(Обн. – ДВ, бр. 100 от 2013 г.)

.....

**Заключителни разпоредби**

§ 18. Тази наредба се издава на основание чл. 36, ал. 3 от Закона за държавния дълг и е приета с Решение № 87 от 31 октомври 2013 г. на Управителния съвет на БНБ.

§ 19. В приложения № 1 и 2 навсякъде думите „сметки за ДЦК“ се заменят със „сметки за сетълмент на ДЦК“.

**Наредба за изменение и допълнение  
на Наредба № 31 от 4 октомври 2007 г.  
за сетълмент на държавни ценни книжа**  
(Обн. – ДВ, бр. 22 от 18 март 2022 г.)

.....

**Заключителна разпоредба**

§ 3. Тази наредба е издадена на основание чл. 36, ал. 3 от Закона за държавния дълг, приета е с Решение № 73 от 8 март 2022 г. на Управителния съвет на БНБ и влиза в сила от деня на обнародването ѝ в „Държавен вестник“.

