2026/1536

14.10.2026 г.

ДЕЛЕГИРАН РЕГЛАМЕНТ (ЕС) 2026/1536 НА КОМИСИЯТА

от 6 юли 2026 година

за изменение на регулаторните технически стандарти, установени в Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229 на Комисията за допълване на Регламент (ЕС) № 909/2014 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на регулаторните технически стандарти за дисциплина при сетълмента

(текст от значение за ЕИП)

ЕВРОПЕЙСКАТА КОМИСИЯ,

като взе предвид Договора за функционирането на Европейския съюз,

като взе предвид Регламент (ЕС) № 909/2014 на Европейския парламент и на Съвета от 23 юли 2014 г. за подобряване на сетълмента на ценни книжа в Европейския съюз и за централните депозитари на ценни книжа, както и за изменение на директиви 98/26/ЕО и 2014/65/ЕС и Регламент (ЕС) № 236/2012 ([1]), и по-специално член 6, параграф 5 и член 7, параграф 10 от него,

като има предвид, че:

(1) С Регламент (ЕС) 2025/2075 на Европейския парламент и на Съвета ([2]) беше изменен член 5, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 909/2014, като сделките за покупка с условие за последваща продажба и сделките за продажба с условие за последващо обратно изкупуване бяха премахнати от обхвата на тази разпоредба. Поради това е необходимо да се актуализира списъкът с видовете сделки, посочени в член 2, параграф 1 от Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229 на Комисията ([3]), които трябва да се представят като част от писмените разпределения.

(2) Въз основа на опита, натрупан от датата на прилагане на Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229, се откроi значимостта на съгласуването на необходимите за разпределенията и потвържденията полета за данни с необходимите за инструкциите за сетълмент, доколкото е възможно. В резултат на този опит също стана ясно, че мястото на сетълмент следва да се съобщи възможно най-рано в процеса на сетълмент с цел избягване на корекции на по-късен етап, които са от изключително съществено значение в контекста на по-кратък цикъл на сетълмент.

(3) С цел гарантиране на сетълмент на сделките без забавяне инвестиционните посредници следва да изискват от своите професионални клиенти да предоставят точни и актуални статични или референтни данни, включително информация за сметките, които трябва да бъдат заверени с финансовите инструменти и паричните средства, съответния пазар или място на сетълмент и банките депозитари или посредниците, чрез които комуникацията трябва навременно да се осъществи преди предвидената дата на сетълмент. Поради същата причина това изискване следва да се прилага и за информацията за сетълмент, изпращана от непрофесионалните клиенти.

(4) За да се поддържа висока ефикасност на сетълмента при нарастващ обем на сделките и да се гарантира навременният сетълмент на сделките, следва да се осигури широко разпространеното използване на цялостна автоматизирана обработка (STP) на пазара. За целта както преките, така и непреките участници на пазара следва да въведат вътрешна автоматизация, която е необходима, за да се възползват в пълна степен от наличните решения за STP. Следователно е целесъобразно настоящата възможност за професионалните клиенти да изпращат писмените разпределения и писмените потвърждения по електронен път да бъде заменена с изискване към инвестиционните посредници да гарантират, че тази комуникация се осъществява чрез електронен и машинночетим формат.

(5) Освен това ползите от STP не могат да бъдат реализирани напълно, докато участниците на пазара продължават да използват собствени или национални стандарти за изпращане на съобщения, а централните депозитари на ценни книжа (ЦДЦК) работят въз основа на международни процедури и стандарти за открита комуникация. С цел насърчаване на оперативната съвместимост и ефикасността обхватът на използването на международни процедури и стандарти за открита комуникация при изпращането на съобщения и референтни данни следва да бъде разширен чрез включване на предаването на разпределенията и потвържденията.

([1]) ОВ L 257, 28.8.2014 г., стр. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2014/909/oj.

([2]) Регламент (ЕС) 2025/2075 на Европейския парламент и на Съвета от 8 октомври 2025 г. за изменение на Регламент (ЕС) № 909/2014 по отношение на по-кратък цикъл на сетълмент в Съюза (ОВ L 2025/2075, 14.10.2025 г., ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2025/2075/oj).

([3]) 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 (ОВ L 230, 13.9.2018 г., стр. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2018/1229/oj).

(6) Резултатът от преминаването към по-кратък сетълмент не следва да е масова миграция на сетълмента от местата на търговия към извънборсовите пазари. Поради тази причина ЦДЦК и техните участници следва да използват поле, указващо мястото за търговия, в своите инструкции за сетълмент, за да подпомогнат наблюдението и отчитането на случаите на неуспешен сетълмент.

(7) С Регламент (ЕС) 2025/2075 беше изменен член 5, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 909/2014, като срокът за сетълмент беше съкратен от два работни дни след сключването на сделката на един работен ден. В резултат на това изменение са необходими промени в целия процес след сключването на сделката, и по-специално по отношение на съществуващата възможност съгласно член 2, параграф 2, буква б) от Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229 за професионалните клиенти да предоставят на инвестиционните посредници писмените разпределения и писмените потвърждения до 12:00 ч. CET в работния ден, следващ деня, в който е сключена сделката. Навременното подаване на инструкциите за сетълмент е от съществено значение за подобряването на оперативната ефективност и оптимизирането на нетирането с оглед прехода към цикъл на сетълмент Т+1 от страна на ЦДЦК. В този контекст някои ЦДЦК осъществяват етапи на сетълмент, по време на които се използват алгоритми за оптимизация с цел извършване на сетълмент на максимален брой сделки. ЦДЦК следва да насърчават участниците, които желаят да се възползват от такава оптимизация, да подават своите инструкции за сетълмент преди 23:59 ч. CET на датата на сделката. Подаването на инструкции за сетълмент след този срок обаче не следва да възпрепятства ЦДЦК да обработват тези инструкции, нито да е основание за парични санкции, които се прилагат само когато са изпълнени условията по член 7, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 909/2014.

(8) С оглед на допълнителното подпомагане на ефикасността на сетълмента и осигуряването на съвместимост с ускорението и автоматизацията, необходими за съкращаването на цикъла на сетълмент, всички ЦДЦК следва да предлагат функция за автоматичен частичен сетълмент. Тъй като обаче тази функция не е необходима във всички случаи, участниците в сделките следва да имат възможност се откажат от нейното активиране.

(9) Ползите от различните режими на сетълмент са различни. С брутния сетълмент в реално време се свеждат до минимум кредитният риск от контрагента и кредитната експозиция и се осигурява по-ефективно управление на ликвидността, докато с групите за сетълмент е възможна оперативна ефективност чрез нетиране. Поради това ЦДЦК следва да предлагат една от следните три възможности: брутен сетълмент в реално време, най-малкото сетълмент на три групи през един работен ден или комбинация от двете възможности.

(10) ЦДЦК следва да разполагат със системи с надеждни и ефикасни функционални възможности, както и с политики и процедури, които им позволяват да улесняват и осигуряват стимули за сетълмента на предвидената дата за сетълмент. Откакто се прилага режимът на дисциплина при сетълмента, стана очевидно колко ефективно допринасят за ефикасността на сетълмента функциите за автоматичен частичен сетълмент и за задържане и освобождаване. Следователно е целесъобразно да се отмени дерогацията по отношение на някои мерки за предотвратяване на случаите на неуспешен сетълмент, предвидена в член 12 от Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229.

(11) С предоставянето на паричен кредит в рамките на деня, гарантиран с обезпечение под формата на парична база или на парични средства на търговски банки, се осигурява значителна ликвидност за сетълмент. Тези ползи биха могли да се окажат от първостепенно значение по време на първоначалното въвеждане на по-кратък сетълмент. Поради това ЦДЦК следва да улесняват достъпа на своите участници до предоставянето на паричен кредит в рамките на деня, гарантиран с обезпечение чрез функция за автоматизирано обезпечаване. Това изискване не следва да се прилага по отношение на притежаващи лиценз за банкова дейност ЦДЦК, които пряко предоставят на своите участници паричен кредит в рамките на деня, гарантиран с обезпечение, вместо само да улесняват достъпа до такава функция.

(12) За да могат да установят главните причини за неуспешен сетълмент, ЦДЦК следва да изискват от участниците да ги информират относно главните причини за случаите на неуспешен сетълмент и относно предприетите мерки за предотвратяване на такива случаи на неуспешен сетълмент. Освен това, предвид промените, въведени с Регламент (ЕС) 2025/2075, който възлага на Европейския орган за ценни книжа и пазари (ЕОЦКП) задачата да наблюдава отблизо ефикасността на сетълмента при сделките за финансиране с ценни книжа, търгувани на места за търговия или извън тях, е необходимо да се добавят „сделки за покупка с условие за последваща продажба“ и „сделки за продажба с условие за последващо обратно изкупуване“ към списъка с видовете сделки като част от наблюдението на случаите на неуспешен сетълмент.

(13) С оглед установяването на работни договорености с участниците с цел намаляване на случаите на неуспешен сетълмент, ЦДЦК следва да могат да идентифицират участниците, чиито случаи на неуспешен сетълмент могат да имат значително въздействие. За да идентифицира тези участници, ЦДЦК следва да вземе предвид дела на случаите на неуспешен сетълмент на всеки участник в общия обем и стойност на инструкциите за сетълмент, обработени на нивото на системата за сетълмент на ценни книжа, управлявана от ЦДЦК. В противен случай по-малките участници с малко сделки могат да се окажат в списъка с участниците с най-много случаи на неуспешен сетълмент, ако процентът на техните случаи на неуспешен сетълмент се разглежда като абсолютна стойност.

(14) Наблюдението и справянето със случаите на неуспешен сетълмент съставляват съвместно усилие, в което участват както компетентните и съответните органи, така и ЦДЦК и техните участници. Поради това ЦДЦК следва редовно да информират компетентния орган и съответните органи относно динамиката на случаите на неуспешен сетълмент в управлявана от тях система за сетълмент и относно предприетите от тях мерки за справяне с тези случаи на неуспешен сетълмент. По същата причина ЦДЦК следва да гарантират, че техните участници полагат целенасочени усилия за подобряване на ефикасността на сетълмента.

(15) За да се осигури по-подробно наблюдение на ефикасността на сетълмента, ЦДЦК следва да докладват за неизправните участници с най-голям дял на случаите на неуспешен сетълмент в общия обем и стойност на инструкциите за сетълмент. По същата причина ЦДЦК следва да докладва данните за случаите на неуспешен сетълмент на база по-подробни категории сделки, независимо дали сделките се сключват на места за търговия, или извън тях, както и за продължителността на случаите на неуспешен сетълмент по вид финансов инструмент.

(16) С оглед на принципа за опростяване и намаляване на тежестта е важно да се избягват евентуални дублирания в изискванията за отчетност. Поради тази причина и предвид факта, че тази информация вече е включена в месечните доклади, които ЦДЦК трябва да представят, изискването към ЦДЦК да подават годишни отчети за случаите на неуспешен сетълмент следва да бъде отменено. При необходимост компетентният орган следва да има възможност да изисква от ЦДЦК по-често отчитане и допълнителна информация относно случаите на неуспешен сетълмент.

(17) С цел гарантиране на по-висока степен на прозрачност ЦДЦК следва да публикуват данни за случаите на неуспешен сетълмент по вид финансов инструмент, главните причини за неуспешния сетълмент и предложените мерки за справяне с тях.

(18) С оглед на структурните и организационните промени, необходими за прехода към по-кратък сетълмент, се изисква по-диференциран подход по отношение на датите на влизане в сила на различните разпоредби на настоящия делегиран регламент. По-конкретно, датата на влизане в сила следва да бъде отложена за разпоредбите, в които се съдържат изисквания, свързани с развитието на информационните технологии, включително насочените към повишаване на ефикасността на сетълмента функции на ЦДЦК. В същото време разпоредбите, с които се въвеждат по-кратки графици за предхождащите сетълмента процеси, чрез които се подпомага прехода към цикъл на сетълмент Т+1, следва да започнат да се прилагат на по-ранен етап, за да разполагат участниците на пазара с достатъчно време за тестване преди преминаването към Т+1.

(19) Другите изменения, и по-конкретно свързаните с отчитането и оповестяването на данни за случаите на неуспешен сетълмент от ЦДЦК, следва да започнат да се прилагат няколко месеца преди преминаването към Т+1, предвидено в член 5, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 909/2014. Тъй като ЕОЦКП трябва да докладва за ефикасността на сетълмента по искане на Комисията, от решаващо значение е да се разполага с адекватна информация за случаите на неуспешен сетълмент както преди, така и след преминаването към Т+1. В този контекст, на ЦДЦК и на пазарните участници следва да се предостави достатъчно време, за да могат да докладват данните в съответствие с допълнителните параметри, определени в приложения I и II към настоящия делегиран регламент, като същевременно се осигури достатъчно дълъг период на наблюдение, за да се оцени по смислен начин въздействието върху ефикасността на сетълмента преди преминаването към по-кратък сетълмент и след това.

(20) Поради това Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229 следва да бъде съответно изменен.

(21) Настоящият регламент е изготвен въз основа на проекта на регулаторни технически стандарти, представен на Комисията от ЕОЦКП.

(22) ЕОЦКП проведе открити обществени консултации по проекта на регулаторни технически стандарти, въз основа на които е изготвен настоящият регламент, анализира потенциалните разходи и ползи от него като част от документа за консултация и поиска становище от Групата на участниците от сектора на ценните книжа и пазарите, създадена в съответствие с член 37 от Регламент (ЕС) № 1095/2010 на Европейския парламент и на Съвета ([4]). Освен това, при изготвянето на своите препоръки ЕОЦКП проведе консултации с Комитета за пазарна инфраструктура и плащания към Европейската система на централните банки (ЕСЦБ) в съответствие с член 10 от Регламент (ЕС) № 1095/2010,

([4]) Регламент (ЕС) № 1095/2010 на Европейския парламент и на Съвета от 24 ноември 2010 г. за създаване на Европейски надзорен орган (Европейски орган за ценни книжа и пазари), за изменение на Решение № 716/2009/ЕО и за отмяна на Решение 2009/77/ЕО на Комисията (ОВ L 331, 15.12.2010 г., стр. 84, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2010/1095/oj).

ПРИЕ НАСТОЯЩИЯ РЕГЛАМЕНТ:

Член 1

Изменения на Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229

Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229 се изменя, както следва:

1) Член 2 се изменя, както следва:

а) параграф 1 се изменя, както следва:

i) първата алинея се изменя, както следва:

1) в буква а) се добавя следната подточка vi):

„vi) сделки за покупка с условие за последваща продажба или сделки за продажба с условие за последващо обратно изкупуване;“;

2) букви и)—к) се заличават;

3) добавят се следните букви м)—п):

„м) сумата на сетълмента за предоставяне или получаване;

н) идентификационните данни на участника, който доставя финансовите инструменти или паричните средства;

о) идентификационните данни на участника, който получава финансовите инструменти или паричните средства;

п) мястото на сетълмента (PSET).“;

ii) третата и четвъртата алинея се заменят със следното:

„Професионалните клиенти изпращат своите писмени разпределения, като използват стандартизиран електронен метод на комуникация, структуриран по начин, който позволява на софтуерните приложения лесно да идентифицират, разпознават и извличат конкретни данни, включително отделни фактически твърдения, както и тяхната вътрешна структура.

Инвестиционните посредници, които са получили потвърждение за изпълнение на нареждане за сделка, подадено от професионален клиент, гарантират чрез договорните споразумения, че професионалният клиент потвърждава, че приема условията на сделката, в писмен вид, като използва стандартизиран електронен метод на комуникация, структуриран по начин, който позволява на софтуерните приложения лесно да идентифицират, разпознават и извличат конкретни данни, включително отделни фактически твърдения, както и тяхната вътрешна структура, в рамките на определените в параграф 2 срокове. Това писмено потвърждение може също да бъде включено в писменото разпределяне.

Използването на методи на комуникация, които не са структурирани и поради това не позволяват на софтуерните приложения лесно да идентифицират, разпознават и извличат конкретни данни, включително отделни фактически твърдения, както и тяхната вътрешна структура, се допуска само в случаи на временна техническа недостъпност или прекъсване на услугата, при условие че тези обстоятелства са надлежно документирани и отстранени без необосновано забавяне.

Инвестиционните посредници изискват от своите професионални клиенти да изпращат писменото разпределение и писменото потвърждение, като използват международните процедури и стандарти за открита комуникация, посочени в член 2, параграф 1, точка 34 от Регламент (ЕС) № 909/2014.

Инвестиционните посредници изискват от своите професионални клиенти да прилагат нивата на допустимо отклонение по отношение на паричните средства, определени от съответния ЦДЦК в съответствие с член 6 от настоящия регламент, когато отчитат общата сума на паричните средства, които трябва да бъдат предоставени или получени, в своите писмени разпределения.“;

б) параграфи 2 и 3 се заменят със следното:

„2. Професионалните клиенти гарантират, че инвестиционният посредник получава писмените разпределяния и писмените потвърждения, посочени в параграф 1, във възможно най-кратък срок и не по-късно от 23:00 ч. CET в работния ден, в който е сключена сделката.

Инвестиционните посредници потвърждават получаването на писменото разпределяне и на писменото потвърждение в рамките на два часа от получаването. Когато получи писменото разпределяне и писменото потвърждение в рамките на по-малко от един час преди прекратяването на неговите операции, инвестиционните посредници потвърждават получаването на писменото разпределяне и на писменото потвърждение в рамките на един час след началото на операциите на следващия работен ден.

3. Инвестиционните посредници изискват от своите професионални клиенти да предоставят всички референтни данни, необходими за сетълмента на сделката, в стандартизиран електронен формат, структуриран по начин, който позволява на софтуерните приложения лесно да идентифицират, разпознават и извличат конкретни данни, включително отделни фактически твърдения, както и тяхната вътрешна структура. Инвестиционните посредници изискват от своите професионални клиенти и да поддържат тези референтни данни в актуализиран вид достатъчно рано, за да се гарантира навременният сетълмент на сделките. Инвестиционните посредници, които получат информацията, посочена в параграф 1, преди срока, указан в параграф 2, могат да се договорят в писмен вид със своите професионални клиенти, че не е необходимо да се изпращат съответните писмени разпределяния и писмени потвърждения.“;

2) Член 3 се заменя със следното:

„*Член 3*

Мерки по отношение на непрофесионалните клиенти

Инвестиционните посредници изискват от своите непрофесионални клиенти да им изпращат цялата информация, свързана със сетълмента на сделките, посочени в член 5, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 909/2014, във възможно най-кратък срок и не по-късно от 23:00 ч. CET в работния ден, в който е сключена сделката, освен когато даден клиент държи съответните финансови инструменти и парични средства при един и същ инвестиционен посредник.“;

3) Член 5 се изменя, както следва:

а) параграф 4 се заменя със следното:

„4. В допълнение към посочените в параграф 3 полета ЦДЦК изискват от своите участници да използват следните полета в инструкциите за сетълмент:

а) поле, указващо вида на сделката въз основа на следната таксономия:

i) покупка или продажба на ценни книжа;

ii) операции по управление на обезпечения;

iii) операции по предоставяне/вземане в заем на ценни книжа;

iv) репо сделки;

v) сделки за покупка с условие за последваща продажба или сделки за продажба с условие за последващо обратно изкупуване;

vi) други сделки (които могат да бъдат идентифицирани с по-конкретни кодове по ISO съгласно предвиденото от ЦДЦК);

б) поле, указващо мястото за търговия, в което се вписва идентификационният код на пазара (MIC) на мястото за търговия, където е сключена основната сделка.

За целите на буква б), когато MIC не се прилага, участниците използват други кодове, основани на международните процедури и стандарти за открита комуникация за изпращане на съобщения и референтни данни, посочени в член 2, параграф 1, точка 34 от Регламент (ЕС) № 909/2014, за попълване на съответното поле.“;

б) добавя се следният параграф 5:

„5. ЦДЦК изискват от участниците да изпращат инструкциите за сетълмент във възможно най-кратък срок и не по-късно от 23:59 ч. CET в работния ден, в който е сключена сделката.“;

4) В член 8 буква б) се заменя със следното:

„б) механизъм за освобождаване, който позволява цялостно или частично освобождаване на висящи инструкции за сетълмент, които са били блокирани от издалия инструкцията участник, с цел извършване на сетълмента.“;

5) Член 10 се заменя със следното:

„*Член 10*

Автоматичен частичен сетълмент

ЦДЦК разполагат с функция за автоматичен частичен сетълмент на сделките въз основа на наличността на ценни книжа в сметката на доставчика, без да се изисква ръчна намеса. Съответстващите инструкции за сетълмент отговарят на условията за такъв автоматичен частичен сетълмент, освен ако някой от участниците не се откаже от активирането му.“;

6) в член 11 параграф 4 се заменя със следното:

„4. ЦДЦК предлагат на участниците брутен сетълмент в реално време, най-малкото сетълмент на три групи през един работен ден или комбинация от двете възможности. Групите на сетълмент са разпределени в рамките на работния ден в съответствие с нуждите на пазара и въз основа на искане от комитета на ползвателите на ЦДЦК.“;

7) Член 12 се заменя със следното:

„*Член 12*

Функция за автоматично обезпечаване

ЦДЦК улесняват достъпа на своите участници до предоставянето на паричен кредит в рамките на деня, гарантиран с обезпечение чрез функция за автоматизирано обезпечаване. Притежаващите лиценз за банкова дейност ЦДЦК могат директно и самостоятелно да предоставят кредит в рамките на деня чрез функция за автоматизирано обезпечаване.“;

8) Член 13 се изменя, както следва:

а) параграф 1 се изменя, както следва:

i) буква а) се заменя със следното:

„а) причината за неуспешния сетълмент въз основа на информацията, която е на директно разположение на ЦДЦК или която му е предоставена от неговите участници;“;

ii) в буква г) се добавя следната точка vi):

„vi) сделки за покупка с условие за последваща продажба или сделки за продажба с условие за последващо обратно изкупуване;“;

б) добавя се следният параграф 1а:

„1а. „ЦДЦК изискват от участниците, посочени в полета 17 и 18 от таблица 1 в приложение I, да им докладват ежемесечно главните причини за случаите на неуспешен сетълмент и мерките за справянето с тях.“;

в) параграф 2 се заменя със следното:

„2. ЦДЦК сключват работни договорености с участниците, посочени в полета 17 и 18 от таблица 1 в приложение I, които оказват най-сериозно въздействие върху техните системи за сетълмент на ценни книжа, и, ако е приложимо, със съответните ЦК и места за търговия, за да анализират и да се справят, доколкото е възможно, с главните причини за случаите на неуспешен сетълмент.“;

9) Член 14 се заменя със следното:

„*Член 14*

Докладване на случаите на неуспешен сетълмент

1. ЦДЦК предават на компетентния орган и на съответните органи информацията, посочена в приложение I, в това число планираните или предприетите от ЦДЦК и от техните участници мерки за подобряване на ефикасността на сетълмента на управляваната от тях система за сетълмент на ценни книжа. Те трябва да предават тази информация ежемесечно и до прекратяване на операциите на петия работен ден от следващия месец.

Тази информация, посочена в първата алинея, включва съответните стойности в евро. Конвертирането на всяка сума в евро се извършва по официалния обменен курс на ЕЦБ за последния ден на отчетния период, когато има такъв обменен курс.

По искане на компетентния орган ЦДЦК докладват по-често и предоставят допълнителна информация относно случаите на неуспешен сетълмент.

2. ЦДЦК редовно наблюдават прилагането на мерките, които те и техните участници са планирали или предприели с цел подобряване на ефикасността на сетълмента в системите за сетълмент на ценни книжа, които управляват, и, при поискване, предоставят на компетентния орган и на съответните органи всички съответни констатации, направени въз основа на това наблюдение.

3. ЦДЦК предоставят информацията, посочена в параграф 1, в стандартизиран електронен формат, структуриран по начин, който позволява на софтуерните приложения лесно да идентифицират, разпознават и извличат конкретни данни, включително отделни фактически твърдения, както и тяхната вътрешна структура.

4. Стойността на инструкциите за сетълмент, посочени в приложения I и III, се изчислява по следния начин:

а) в случай на инструкции за сетълмент срещу плащане, сумата на сетълмента на паричното рамо;

б) в случай на инструкции за сетълмент без плащане, пазарната стойност на финансовите инструменти, посочени в член 32, параграф 3, или, ако не е известна, номиналната стойност на финансовите инструменти.“;

10) Член 23 се заменя със следното:

„*Член 23*

Прилагане на частичен сетълмент

1. Когато в последния работен ден от удължения срок, посочен в член 7, параграф 3 от Регламент (ЕС) № 909/2014, част от съответните финансови инструменти са предоставени за доставка на получаващия участник, получаващите и неизправните клирингови членове, членове на място за търговия или търгуващи страни, според случая, извършват частичен сетълмент на първоначалната инструкция за сетълмент.

2. Параграф 1 не се прилага, когато съответната инструкция за сетълмент е задържана в съответствие с член 8.“;

11) Приложение I към Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229 се изменя в съответствие с приложение I към настоящия регламент;

12) Приложение II към Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229 се заличава;

13) Приложение III към Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229 се изменя в съответствие с приложение II към настоящия регламент.

Член 2

Влизане в сила и прилагане

Настоящият регламент влиза в сила на двадесетия ден след деня на публикуването му в *Официален вестник на Европейския съюз*.

Той се прилага от 7 декември 2026 г. В същото време член 1, точка 3, буква а) по отношение на изменението на член 5, параграф 4, буква б) от Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229, точка 8, буква а), подточка i), точка 8, букви б) и в) и точки 9, 11, 12 и 13 се прилагат от 1 юли 2027 г. Член 1, точка 3, буква б) и точки 4, 5, 6, 7 и 10 се прилагат от 11 октомври 2027 г.

Настоящият регламент е задължителен в своята цялост и се прилага пряко във всички държави членки.

Съставено в Брюксел на 6 юли 2026 година.

За Комисията
Председател
Ursula VON DER LEYEN

ПРИЛОЖЕНИЕ I

Приложение I към Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229 се изменя, както следва:

(1) В таблица 1 редове 17, 18 и 41 се заменят със следното:

“17.	Първите 10 участници с най-високи проценти на случаи на неуспешен сетълмент през обхванатия от доклада период (въз основа на броя на инструкциите за сетълмент), класирани въз основа на дела на случаите на неуспешен сетълмент, причинени от всеки участник, в сравнение с общия брой на инструкциите за сетълмент на нивото на системата за сетълмент на ценни книжа.	За всеки участник, който е идентифициран с ИКПС	
		ИКПС на участник	Идентификационният код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442, 20 буквено-цифрени знака
		Общият брой на инструкциите за сетълмент на нивото на системата за сетълмент на ценни книжа през обхванатия от доклада период	До 20 цифрови знака, отчетени като цяло число без десетични числа
		Брой на случаите на неуспешен сетълмент на участник	До 20 цифрови знака, отчетени като цяло число без десетични числа
		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	Процентна стойност до 2 знака след десетичната запетая
		Обща стойност (EUR) на инструкциите за сетълмент на участник	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Попълва се най-малко един знак преди и един знак след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак.
		Стойност (в EUR) на случаите на неуспешен сетълмент на участник	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Попълва се най-малко един знак преди и един знак след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак.
		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	Процентна стойност до 2 знака след десетичната запетая.
18.	Първите 10 участници с най-високи проценти на случаи на неуспешен сетълмент през обхванатия от доклада период (въз основа на стойността (EUR) на инструкциите за сетълмент), класирани въз основа на дела на случаите на неуспешен сетълмент, причинени от всеки участник, в сравнение с общата стойност на инструкциите за сетълмент на нивото на системата за сетълмент на ценни книжа.	За всеки участник, който е идентифициран с ИКПС	
		ИКПС на участник	Идентификационният код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442, 20 буквено-цифрени знака
		Обща стойност (EUR) на инструкциите за сетълмент на нивото на системата за сетълмент на ценни книжа през обхванатия от доклада период	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Попълва се най-малко един знак преди и един знак след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак.

		Стойност (в EUR) на случаите на неуспешен сетълмент на участник	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Попълва се най-малко един знак преди и един знак след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак.
		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	Процентна стойност до 2 знака след десетичната запетая
		Общ брой на инструкциите за сетълмент на участник	До 20 цифрови знака, отчетени като цяло число без десетични числа.
		Брой на случаите на неуспешен сетълмент на участник	До 20 цифрови знака, отчетени като цяло число без десетични числа.
		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	Процентна стойност до 2 знака след десетичната запетая.
41	Средна продължителност на случаите на неуспешен сетълмент като брой дни (разликата между реалната дата на сетълмента и предвидената дата за сетълмент, претеглена спрямо стойността на неуспешния сетълмент) по вид финансов инструмент и като цяло	Брой дни, отчетени като число с един знак след десетичната запетая.“	

(2) Таблица 2 се заменя със следното:

„*Таблица 2*

Дневни данни за неуспешен сетълмент, които се докладват от ежемесечно ЦДЦК пред компетентните органи и съответните органи

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия ([1])	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
	Прехвърлими ценни книжа по член 4, параграф 1, точка 44, буква а) от Директива 2014/65/ЕС	Покупка или продажба на финансови инструменти	Вътрешни за ЦДЦК	DVP ([2])												
				DWP ([3])												
				PFOD ([4])												
				FoP ([5])												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Операции по управление на обезпеченията	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия [1]	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
		Предоставяне/ взимане в заем на ценни книжа	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Сделки за обратно изкупуване	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия [1]	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
		Покупка с условие за последваща продажба или продажба с условие за последващо обратно изкупуване	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Други сделки	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия [1]	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
	Държавен дългов инструмент съгласно определението в член 4, параграф 1, точка 61 от Директива 2014/65/ЕС	Покупка или продажба на финансови инструменти	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Операции по управление на обезпеченията	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия [1]	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
		Предоставяне/ взимане в заем на ценни книжа	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Сделки за обратно изкупуване	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия [1]	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
		Покупка с условие за последваща продажба или продажба с условие за последващо обратно изкупуване	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Други сделки	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия [1]	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
	Прехвърлими ценни книжа по член 4, параграф 1, точка 44, буква б) от Директива 2014/65/ЕС, различни от държавните дългови инструменти по член 4, параграф 1, точка 61 от Директива 2014/65/ЕС	Покупка или продажба на финансови инструменти	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Операции по управление на обезпеченията	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия [1]	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
		Предоставяне/ взимане в заем на ценни книжа	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Сделки за обратно изкупуване	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия ([1])	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
		Покупка с условие за последваща продажба или продажба с условие за последващо обратно изкупуване	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Други сделки	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия [1]	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
	Прехвърлими ценни книжа съгласно определението в член 4, параграф 1, точка 44, буква в) от Директива 2014/65/ЕС	Покупка или продажба на финансови инструменти	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Операции по управление на обезпеченията	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия [1]	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
		Предоставяне/ взимане в заем на ценни книжа	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Сделки за обратно изкупуване	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия [1]	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
		Покупка с условие за последваща продажба или продажба с условие за последващо обратно изкупуване	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Други сделки	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия ([1])	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
	Борсово търгувани фондове, както са определени в член 4, параграф 1, точка 46 от Директива 2014/65/ЕС	Покупка или продажба на финансови инструменти	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Операции по управление на обезпеченията	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия [1]	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
		Предоставяне/ взимане в заем на ценни книжа	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Сделки за обратно изкупуване	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия [1]	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
		Покупка с условие за последваща продажба или продажба с условие за последващо обратно изкупуване	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Други сделки	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия [1]	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
	Дялови единици в предприятия за колективно инвестиране, различни от борсово търгувани фондове	Покупка или продажба на финансови инструменти	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Операции по управление на обезпеченията	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия [1]	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
		Предоставяне/ взимане в заем на ценни книжа	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Сделки за обратно изкупуване	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия [1]	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
		Покупка с условие за последваща продажба или продажба с условие за последващо обратно изкупуване	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Други сделки	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия [1]	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
	Инструменти на паричния пазар, различни от държавните дългови инструменти по член 4, параграф 1, точка 61 от Директива 2014/65/ЕС	Покупка или продажба на финансови инструменти	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Операции по управление на обезпеченията	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия [1]	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
		Предоставяне/ взимане в заем на ценни книжа	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Сделки за обратно изкупуване	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия [1]	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
		Покупка с условие за последваща продажба или продажба с условие за последващо обратно изкупуване	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Други сделки	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия [1]	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
	Квоти за емисии	Покупка или продажба на финансови инструменти	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Операции по управление на обезпеченията	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия [1]	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
		Предоставяне/ взимане в заем на ценни книжа	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Сделки за обратно изкупуване	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия [1]	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
		Покупка с условие за последваща продажба или продажба с условие за последващо обратно изкупуване	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Други сделки	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия [1]	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
	Други финансови инструменти	Покупка или продажба на финансови инструменти	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Операции по управление на обезпеченията	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия [1]	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
		Предоставяне/ взимане в заем на ценни книжа	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Сделки за обратно изкупуване	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)																	
					Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
					Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
					Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)	Обем	Стойност (в EUR)
Място на търговия ([1])	Вид на финансовите инструменти	Вид на сделката	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията												
		Покупка с условие за последваща продажба или продажба с условие за последващо обратно изкупуване	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
		Други сделки	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												
			Между ЦДЦК	DVP												
				DWP												
				PFOD												
				FoP												

([1]) В тази колона се попълва идентификационният код на пазара (MIC) на мястото за търговия, където е сключена основната сделка; Когато MIC не се прилага, се използват други кодове, основани на международните процедури и стандарти за открита комуникация за изпращане на съобщения и референтни данни, посочени в член 2, параграф 1, точка 34 от Регламент (ЕС) № 909/2014, за попълване на съответното поле.

([2]) Обхващат се инструкции за сетълмент, предвиждащи DVP и RVP.

([3]) Обхващат се инструкции за сетълмент, предвиждащи DWP и RWP.

([4]) Обхващат се инструкции за сетълмент, предвиждащи DPFOD и CPFOD.

([5]) Обхващат се инструкции за сетълмент, предвиждащи DFP и RFP.“

ПРИЛОЖЕНИЕ II

В таблица 1 от приложение III към Делегиран регламент (ЕС) 2018/1229 се добавят следните точки:

„Данни, които обхващат видовете финансови инструменти		
19.	Брой на инструкциите за сетълмент за всеки вид от финансовите инструменти	За всеки вид финансови инструменти: До 20 цифрови знака, отчетени като цяло число без десетични числа.
20.	Брой на случаите на неуспешен сетълмент (обхванати са случаите на неуспешен сетълмент както поради липса на ценни книжа, така и на парични средства) за всеки вид финансови инструменти	За всеки вид финансови инструменти: До 20 цифрови знака, отчетени като цяло число без десетични числа.
21.	Годишен процент на случаите на неуспешен сетълмент за всеки вид финансови инструменти на база на обема (брой на случаите на неуспешен сетълмент/брой на инструкциите за сетълмент за всеки вид финансови инструменти)	Процентът за всеки вид от финансовите инструменти се изразява като процентна стойност до 2 знака след десетичната запетая.
22.	Стойност (в EUR) на инструкциите за сетълмент за всеки вид от финансовите инструменти	Стойността за всеки вид от финансовите инструменти се изразява с до 20 цифрови знака, вкл. знаци след десетичната запетая. Попълва се най-малко един знак преди и един знак след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак.
23.	Стойност (в EUR) за случаите на неуспешен сетълмент (обхванати са случаите на неуспешен сетълмент както поради липса на ценни книжа, така и на парични средства) за всеки вид финансови инструменти	Стойността за всеки вид от финансовите инструменти се изразява с до 20 цифрови знака, вкл. знаци след десетичната запетая. Попълва се най-малко един знак преди и един знак след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак.
24.	Годишен процент на случаите на неуспешен сетълмент за всеки вид финансови инструменти на база на стойността (стойност на случаите на неуспешен сетълмент/стойност на инструкциите за сетълмент за всеки вид финансови инструменти)	Процентът за всеки вид финансов инструмент се изразява като процентна стойност до 2 знака след десетичната запетая.
25.	Главни причини за случаите на неуспешен сетълмент и предложените мерки за справянето с тях	Свободен текст“