

ПРАВИЛА

ЗА ЛИЧНИТЕ СДЕЛКИ С ФИНАНСОВИ ИНСТРУМЕНТИ НА ЧЛЕНОВЕТЕ НА СЪВЕТА НА ДИРЕКТОРИТЕ И НА ЛИЦАТА, РАБОТЕЩИ ПО ДОГОВОР ЗА УПРАВЛЯВАЩОТО ДРУЖЕСТВО „АЛФА АСЕТ МЕНИДЖМЪНТ“ ЕАД И ЗА ДОКЛАДВАНЕ НА НАРУШЕНИЯ, ПОДОЗРИТЕЛНИ НАРЕЖДАНЯ И СДЕЛКИ

(заглавие изменено с Решение на СД от 16.12.2016 г.)

Раздел I

Общи разпоредби. Цели и основни изисквания на Правилата. Забрани за сключване на определени категории лични сделки и извършване на други дейности

Чл. 1. (1) Правилата за личните сделки с ценни книжа на членовете на съвета на директорите и лицата, работещи по договор за управляващото дружество (по-долу „Правилата“), уреждат изискванията, които следва да бъдат спазвани при сключване на сделки с финансови инструменти (с изключение на ДЦК и посочените в чл. 15 от настоящите Правила обстоятелства) в лично качество от членовете на Съвета на директорите (СД) на УД „Алфа Асет Мениджмънт“ ЕАД (УД) и лицата, работещи по договор за УД, всички посочени по-горе лица наричани обобщено „заинтересовани лица“.

(2) Цели на Правилата са:

1. (изм. с Решение на СД от 16.12.2016 г.) гарантиране, че няма да бъдат сключвани лични сделки или поддържани инвестиции от членовете на СД, позволяващи им заедно или поотделно да упражняват съществено влияние върху емитент, или които биха довели до конфликт на интереси, или са резултат на злоупотреба с информация, която са придобили във връзка с професионалната си дейност по смисъла на Закона за прилагане на мерките срещу пазарните злоупотреби с финансови инструменти.

2. гарантиране честното и равностойно третиране на всички клиенти на УД и инвеститорите в управляваните от УД колективни инвестиционни схеми (КИС) и други предприятия за колективно инвестиране (ДПКИ) и професионалното отношение на всички лица, спрямо които Правилата са приложими – към клиентите, като се ограничават възможностите за злоупотреби от страна на лица, които имат достъп до информация за клиентите на УД („клиентите“) и инвеститорите в управляваните от УД КИС и ДПКИ („инвеститорите“), и до всякакви други документи на УД, включително възможности за манипулации и сделки с вътрешна информация;

3. избягване на конфликти на интереси между заинтересованите лица и УД и заинтересованите лица и КИС, ДПКИ и другите инвеститори, чиято дейност и/или портфейл УД управлява или на които УД предоставя инвестиционни консултации включително, но не само, когато:

а) заинтересовано лице и УД са страни по сделка;

б) заинтересовано лице и КИС, ДПКИ или друг инвеститор, чиято дейност и/или портфейл УД управлява, са страни по сделка;

в) заинтересовано лице е оказало влияние върху вземането на решение за сключване на конкретна сделка за сметка на УД, управлявана от него колективна инвестиционна схема, друго предприятие за колективно инвестиране или друг инвеститор;

г) личните финансови интереси на заинтересовано лице са в конфликт с финансовите интереси на УД, колективна инвестиционна схема или друго предприятие за колективно инвестиране, които то управлява или на други инвеститори, с които има сключен договор за управление или за предоставяне на инвестиционни консултации;

4. информирание на клиентите и инвеститорите във всички случаи, когато не могат да бъдат избегнати конфликти на техните интереси с тези на заинтересованите лица, с оглед взимане на обосновано инвестиционно решение;

(3) Общи изисквания към УД и заинтересованите лица:

1. във всички случаи с приоритет се третират инвестиционните сделки на управляваните от УД КИС, други предприятия за колективно инвестиране и тези на клиентите пред сделките с финансови инструменти на заинтересованите лица;

2. заинтересованите лица в срок до 3 дни уведомяват УД относно всички реализирани лични сделки с финансови инструменти;

3. в съответствие с настоящите правила и в случаите, уредени в тях, за отделни сделки се изисква предварителното им одобрение от страна на УД.

Чл. 2. Забранява се на лицата, работещи по договор с УД и ангажирани в дейности, които могат да породят конфликт на интереси, или имащи достъп до вътрешна информация или до друга поверителна информация, свързана с колективна инвестиционна схема или със сделки на такава схема, съобразно извършваните от тях дейности и функции от името на управляващото дружество, да извършват следните дейности:

1. сключване на лична сделка, която отговаря на поне един от следните критерии:

а) (изм. с Решение на СД от 16.12.2016 г.) лицата по чл. 2 от Правилата нямат право да извършват такава лична сделка по смисъла на Закона за прилагане на мерките срещу пазарните злоупотреби с финансови инструменти;

б) сделката е свързана със злоупотреба или с неправомерно разкриване на поверителна информация;

в) сделката противоречи или има вероятност да противоречи на задължение на управляващото дружество съгласно ЗДКИСДПКИ или ЗПФИ;

2. съветване или подпомагане, извън нормалното за изпълнение на служебните или договорни задължения на лицата по чл. 2 от Правилата, на друго лице да извършва сделка с финансови инструменти, която ако би била лична сделка на лице, което работи по договор за управляващото дружество, би попадала в хипотезите по т. 1 или по друг начин би представлявала злоупотреба с информация, свързана с неизпълнени поръчки, както и

а) да не сключват лични сделки или сделки за сметка на друго лице, включително за УД и управляваните от УД КИС и ДПКИ, с финансови инструменти, за които се извършва инвестиционно изследване, предназначено за разпространение или е вероятно впоследствие да бъде разпространено публично или сред клиентите на УД, на отговорност на УД или на отговорност на член на групата, към която той принадлежи, или със свързани с тях финансови инструменти, със знанието за вероятния момент на оповестяване или за съдържанието на инвестиционното изследване; изречение първо се прилага, когато инвестиционното изследване не е достъпно за публиката или за клиентите и не може лесно да бъде направено въз основа на достъпна за публиката или клиентите информация; забраната по изречение първо важи, докато не бъде осигурена разумна възможност за адресатите на инвестиционното изследване да действат съгласно него;

б) извън случаите по буква „а“ лицата по чл. 2 от Правилата и другите лица, които участват в изготвянето на инвестиционното изследване, да не извършват лични сделки с финансови инструменти, до които се отнася инвестиционното изследване, или със свързани с тях финансови инструменти, в противоречие с дадени препоръки в периода, за който те са валидни, освен при

изключителни обстоятелства и с предварителното одобрение на лице от отдел „Контрол и управление на риска“ ;

3. (изм. с Решение на СД от 16.12.2016 г.) разкриване, извън нормалното за изпълнение на служебните или договорни задължения на лицата по чл. 2 от Правилата на всякаква информация или мнение, на друго лице, ако лице, което работи по договор за управляващото дружество, знае или би следвало да знае, че в резултат на това разкриване лицето ще предприеме или има вероятност да предприеме едно от следните действия:

а) да сключи сделка с финансови инструменти, която ако би била лична сделка на лице, което работи по договор за управляващото дружество, би попадала в хипотезите по т. 1 или т. 2 буква „а“ и буква „б“, или по друг начин би представлявала злоупотреба с информация, свързана с неизпълнени поръчки;

б) да съветва или да подпомага друго лице да извърши такава сделка.

Раздел II

Конфиденциалност и общи ограничения

Чл. 3. (1) Заинтересованите лица не могат да разгласяват, освен ако не са оправомощени за това, и да ползват за облагодетелстване на себе си или на други лица, включително на самото УД, факти и обстоятелства, засягащи наличностите и операциите по сметките за финансови инструменти на лицата, чиято дейност или портфейл УД управлява, както и всички други факти и обстоятелства, представляващи търговска тайна, които са узнали при изпълнение на служебните и професионалните си задължения.

(2) Заинтересованите лица при встъпване в длъжност или при започване на дейност за УД подписват декларация за спазване на изискванията по ал. 1.

(3) Ал. 1 е приложима и за случаите, когато посочените лица не са на служба или дейността им е преустановена.

(4) Освен на Комисията за финансов надзор (КФН), заместник-председателя на КФН, ръководещ управление “Надзор на инвестиционната дейност” и оправомощени длъжностни лица от администрацията на КФН, за целите на контролната им дейност и в рамките на заповедта за проверка, УД може да дава сведения по ал. 1 само със съгласие на клиента или инвеститора, или по решение на съда, издадено при условията и по реда на чл. 35, ал. 6 и 7 ЗПФИ, както и по искане на оправомощените лица и в случаите, предвидени в чл. 35, ал. 8 и 9 ЗПФИ.

Чл. 4 (1) СД на УД може да вземе решение, с което да ограничи честотата и/или обема или временно да наложи забрана на заинтересованите лица за сключване на лични сделки с дялове на колективни инвестиционни схеми и други предприятия за колективно инвестиране, управлявани от УД, както и с финансови инструменти от портфейлите на управляваните от УД колективни инвестиционни схеми и ПКИ, когато е налице обосновано предположение за възникване на конфликт на интереси, за неравностойно третиране на акционерите/притежателите на дялове в КИС и ДПКИ и/или съществува опасност да бъде увреден търговският престиж на УД.

(2) Решение по ал. 1 може да бъде взето включително, но не само, когато заинтересовано лице:

а) купува/продава дялове на управлявани от УД КИС и ДПКИ, включително прехвърля средства от една КИС (ДПКИ) в друга КИС или ДПКИ, в обеми и с честота, при които се създава опасност от възникване на ликвидна криза;

б) подава съответния вид поръчка въз основа на притежавана вътрешна информация по смисъла на ЗПЗФИ или въз основа на друга поверителна информация за клиенти или сделки за клиенти.

Чл. 5 (1) Заинтересованите лица са длъжни да осъществяват дейността си в съответствие с принципите на добросъвестната търговска практика, като проявяват лоялност и етика в отношенията си с клиентите.

(2) Заинтересованите лица са длъжни да не сключват сделки с ценни книжа на колективни инвестиционни схеми и ДПКИ, управлявани от УД, в обем, срокове и/или честота, които биха могли да доведат до конфликт на интереси, увреждане на репутацията на УД или неравностойно третиране на останалите акционери или притежатели на дялове в колективните инвестиционни схеми или ПКИ.

Чл. 6. Заинтересованите лица нямат право да откриват фиктивни сметки за финансови инструменти с цел да извършват сделки, които иначе биха били забранени или за да извършват сделки, при които действат фактически за собствена сметка или за сметка на свързани с тях лица.

Раздел III

Уведомления относно сключване на лични сделки и процедура за избягване на конфликти на интереси

Чл. 7 (1) Заинтересованите лица се задължават да предприемат всички необходими действия/мерки в съответствие с настоящите правила, с оглед избягване на настъпване на потенциален конфликт на интереси, преди сключване на лична сделка.

(2) След реализация на сделка, заинтересованите лица се задължават да уведомят своевременно сектор „Клиенти, сделки и отчетност“ на Управляващото дружество за конкретните параметри по извършената сделка.

(3) Уведомлението по предходната алинея се извършва от заинтересованите лица в писмен вид или чрез електронно съобщение.

(4) сектор „Клиенти, сделки и отчетност“ съхранява документите за декларираните по ал. 2 обстоятелства и води отчетност по начин, който изключва подмяна или заличаване на данните.

(5) УД води регистъра на личните сделки по чл. 125, ал. 2, т. 3 от Наредба № 44 за изискванията към дейността на колективните инвестиционни схеми, инвестиционните дружества от затворен тип и управляващите дружества (Наредба № 44) за личните сделки, за които управляващото дружество е информирано или които са установени от УД, включително всяко разрешение или забрана във връзка с такава сделка.

(6) Регистърът на личните сделки изпълнява функциите на дневник за личните сделки по смисъла на чл. 146 от Наредба № 44.

(7) Ако дейността по продажба и обратно изкупуване на дялове на колективна инвестиционна схема се извършва по делегация от трети лица, управляващото дружество изисква, включително и на основание на договор за дистрибуция на дяловете на КИС, от субекта, извършващ дейността, да поддържа регистър на личните сделки, извършени от лица, които работят по договор за управляващото дружество, и при поискване ще предоставя своевременно информация на управляващото дружество.

Раздел IVa

Мерки срещу пазарни злоупотреби с финансови инструменти. Откриване и съобщаване за подозрителни нареждания и сделки (заглавие изменено с Решение на СД от 16.12.2016 г.)

Чл. 8. (изм. с Решение на СД от 16.12.2016 г.) В случай, че някое от заинтересованите лица притежава вътрешна информация по смисъла на чл. 7 от Регламент (ЕС) № 596/2014, това лице не може:

1. да използва тази информация, като придобие или прехвърли, или опита да придобие или да прехвърли за своя или за чужда сметка, пряко или непряко, финансови инструменти, за които се отнася тази информация (тази забрана не се прилага за сделки, сключени в изпълнение

на изискуеми задължения за придобиване или прехвърляне на финансови инструменти, когато тези задължения са възникнали преди лицето да притежава вътрешна информация);

2. *(нова, приета с Решение на СД от 16.12.2016 г.)* да използва тази информация за отмяна или изменение на нареждане относно финансов инструмент, за който се отнася информацията, когато нареждането е направено преди съответното лице да разполага с вътрешната информация.

2. да разкрива вътрешната информация на друго лице, освен ако разкриването ѝ се извършва при обичайното упражняване на неговата служба, професия или задължения;

3. *(изм. с Решение на СД от 16.12.2016 г.)* да препоръчва или да убеждава друго лице въз основа на вътрешната информация да придобива или да прехвърля финансови инструменти, съответно да отмени или измени нареждане относно финансови инструменти за които се отнася тази информация.

Чл. 9. (1) На заинтересованите лица е забранено да манипулират пазара на финансови инструменти чрез:

1. извършване на сделки или подаването на нареждания, които създават или могат да създадат невярна или подвеждаща представа относно търсенето, предлагането или цената на финансови инструменти или които определят чрез действията на едно лице или чрез съвместни действия на две или повече лица цената на един или няколко финансови инструменти на необичайно или изкуствено ниво;

2. извършване на сделки или подаване на нареждания, при които се използват фиктивни способности или други форми на измамни действия;

3. разпространяване чрез средствата за масово осведомяване, включително чрез Интернет, или по какъвто и да е друг начин на информация, която създава или може да създаде невярна или подвеждаща представа относно финансови инструменти, включително разпространяване на слухове и неверни или заблуждаващи новини, когато лицето, което разпространява информацията, знае или е длъжно да знае, че информацията е невярна или подвеждаща.

(2) Манипулативни действия и сделки са и:

1. *(изм. с Решение на СД от 16.12.2016 г.)* действията на едно лице или съвместните действия на няколко лица, действащи организирано, с които си осигуряват господстващо положение по отношение на предлагането или на търсенето на даден финансов инструмент, което пряко или косвено води или може да доведе до определяне на покупните или продажните цени, или създаването или вероятността от създаване на други неравностойни условия за търговия;

2. *(изм. с Решение на СД от 16.12.2016 г.)* сключването на сделки с финансови инструменти при отварянето или затварянето на търговската сесия на регулирания пазар, които водят или могат да доведат до заблуждение инвеститорите, които действат на основата на изложените цени, включително цените при отваряне или затваряне на пазара;

3. *(нова, приета с Решение на СД от 16.12.2016 г.)* подаване, отмяна или промяна на нареждания чрез място на търговия, водещо до резултатите по т. 1 и 2, при което е налице смущаване или възможност за смущаване на мястото за търговия, затрудняване при установяването на действителни нареждания, претоварване на системата за обработване на нареждания, както и подаване на нареждания с цел оказване на влияние върху тенденцията на мястото за търговия.

3. *(нова, приета с Решение на СД от 16.12.2016 г.)* възползването от случаен или редовен достъп до традиционни или електронни медии чрез даване на мнение за финансов инструмент и извличане впоследствие на полза от въздействието на мненията, дадени за цената на този

инструмент, без към момента на изявата този конфликт на интереси да е бил направен по подходящ и ефективен начин публично достояние;

4. други действия и сделки, чрез които се осъществява манипулиране на пазара на финансови инструменти.

Чл. 10. Както при извършване на дейност за УД, за което работят по договор, така и при извършването на лични сделки с финансови инструменти, заинтересованите лица нямат право да водят преговори и/или сключват договори за покупко-продажба, замяна и заем на финансови инструменти, както и да предоставят каквато и да било информация относно финансови инструменти, като използват неистински благоприятстващи данни или премълчават неблагоприятни данни, които са от съществено значение за вземането на решение за придобиване или разпореждане с финансови инструменти.

Чл. 11. (изм. с Решение на СД от 16.12.2016 г.) В допълнение на горепосочените изисквания и забрани, заинтересованите лица, които участват в извършването на дейности, които могат да породят конфликт на интереси, или които поради осъществяването от тях дейност за УД имат достъп до вътрешна информация по смисъла на Регламент (ЕС) № 596/2014 или до друга поверителна информация за клиенти или сделки със или за клиенти, включително при осъществяване на дейности по управление в съответствие със сключен с клиента договор на портфейл, включително портфейл на предприятие за колективно инвестиране, включващ финансови инструменти, по собствена преценка, без специални нареждания на клиента, инвестиционни консултации относно финансови инструменти или съхранение и администриране на дялове на предприятия за колективно инвестиране, не могат:

1. да сключват лична сделка, която отговаря на някое от следните условия:

а) (изм. с Решение на СД от 16.12.2016 г.) осъществяването ѝ от това лице е нормативно забранено;

б) (изм. с Решение на СД от 16.12.2016 г.) е свързана със злоупотреба или неправомерно разкриване на поверителна информация;

в) осъществяването ѝ е в противоречие или може да доведе до противоречие със задължение на УД съгласно ЗПФИ или актовете по прилагането му;

2. извън обичайно осъществяваната от тях дейност за УД да предоставят съвет или оказват съдействие на друго лице да сключи сделка с финансови инструменти;

3. извън обичайно осъществяваната от тях дейност за УД да разкриват информация или мнение на друго лице, при условие че лицето, което работи по договор за УД, знае или обосновано може да се предположи, че знае, че в резултат на това разкриване лицето ще извърши или е вероятно да извърши някое от следните действия:

а) да сключи сделка с финансови инструменти, която, ако би била лична сделка на лицето, което работи по договор за УД, би била забранена съгласно настоящите Правила;

б) да предостави съвет или да окаже съдействие на друго лице да сключи сделка по буква "а".

Раздел IVб

Докладване на нарушения по Закона за прилагане на мерките срещу пазарните злоупотреби с финансови инструменти и Регламент (ЕС) 596/2014 г. (нов, приет с Решение на СД от 16.12.2016 г.)

Чл. 11а. (1) Въз основа на критериите за манипулативно поведение или опит за такова във връзка с неверни или подвеждащи сигнали и с определянето на дадена цена, както и показателите във връзка с употреба на фиктивни срудства и дуги форми на измама или заблуда съгласно Приложение I към Регламент (ЕС) 596/2014 г., които са неизчерпателно изброени и извършен анализ на база всички данни и обстоятелства във връзка с конкретна транзакция, УД

подава доклад за подозрителна сделка или нареждане (ДПСН). ДПСН се подава при възникване на основателно съмнение за действителна злоупотреба с вътрешна информация или манипулиране на пазара, или опит за такава злоупотреба или манипулиране, чрез осъществяването на текущ и периодичен (най-малко веднъж годишно) мониторинг от страна на отдел "Контрол и управление на риска".

(2) ДПСН се изготвя от отдел "Контрол и управление на риска" при отчитане на елементите съставляващи реална злоупотреба с вътрешна информация или манипулиране на пазара, или опит за такива съгласно Приложението по ал. 1, в резултат на самосезиране при възникнали съмнения относно действия, сделка или нареждане, в хода на осъществяване на функциите на отдела или след подаване на вътрешен сигнал за съмнителни действия, сделка или нареждане от страна на служители м УД.

(3) Докладът се подава по образец – Приложение № 1 към настоящите правила в съответствие с утвърдената форма по Деегиран регламент (ЕС) 2016/957 на Комисията след съгласуването му с изпълнителния директор на УД.

(4) При подаване на ДПСН, ясно и точно се попълват информационните полета, свързани с докладваните нареждания или сделки.

(5) ДПСН се подава незабавно след установяване наличието на съответните критерии и показатели до компетентния орган по смисъла на чл. 4 от Закона за прилагане на мерките срещу пазарните злоупотреби с финансови инструменти съгласно актуалните указания, обявени от Комисия за финансов надзор.

(6) ДПСН може да се подава и за сделки и нареждания, извършени в предходен период, когато подозрението възниква във връзка с последващи събития и информация, като УД пояснява в ДПСН фактите и обстоятелствата във връзка с подаваните минали транзакции.

(7) ДПСН се изготвя и подава при спазване на принципа на необходимото знание по отношение на служителите на УД и при стриктна конфиденциалност на процедурата спрямо лицето, по отношение на което се подава ДПСН и спрямо всяко друго лице, което не е необходимо да знае, че ще бъде подаден ДПСН.

(8) УД предоставя на компетентния орган всякаква относима допълнителна информация, която му е станала известна след първоначалното подаване на ДПСН, както и всякаква информация или документи, изискани от компетентния орган.

Раздел V

Информация относно Правилата и политиката на управляващото дружество по прилагането им

Чл. 12. (1) Ръководителят на отдел "Контрол и управление на риска" предоставя срещу подпис на заинтересованите лица копие от настоящите Правила и промените в тях.

(2) При назначаване на служители на работа в УД, ръководителят на отдел „Контрол и управление на риска“ ги инструктира относно задълженията им съгласно Правилата, съществуващите ограничения за личните сделки и мерките, установени от УД, във връзка с личните сделки и разкриването на информация по чл. 125, ал. 2, т. 1 във връзка с ал. 1 от Наредба № 44.

(3) Ръководителят на отдел „Контрол и управление на риска“ инструктира заинтересованите лица при внасяне на съществени промени в Правилата.

Чл. 13. (1) Актуален текст на Правилата се публикува на страницата в Интернет на УД.

(2) Информация, насочена към клиентите и инвеститорите, относно политиката на УД за личните сделки, както и относно прилагането на Правилата се публикува на страницата в Интернет на УД най-малко веднъж годишно.

Раздел VI

Приложими разпоредби

Чл. 14. (изм. с Решение на СД от 16.12.2016 г.) В случай на несъответствие на настоящите Правила с разпоредби на Закона за дейността на колективните инвестиционни схеми и на други предприятия за колективно инвестиране, Закона за публично предлагане на ценни книжа, Закона за прилагане на мерките срещу пазарните злоупотреби с финансови инструменти, Закона за пазарите на финансови инструменти, актовете по прилагането им и други нормативни актове, се прилагат нормите на указаните актове.

Раздел VII

Изключения

Чл. 15. Настоящите правила не се прилагат към следните видове лични сделки:

1. лични сделки, извършени като част от управление на портфейл, когато във връзка със сделките няма предварителна комуникация между управляващия портфейла и лице, което работи по договор за управляващото дружество, или друго лице, за чиято сметка се извършва сделката;

2. лични сделки с КИС или с дялове на ДПКИ, които са предмет на надзор съгласно действащото законодателство в страната, което изисква еквивалентно ниво на разпределение на риска сред неговите активи, когато лице, което работи по договор за управляващото дружество, и другото лице, за чиято сметка се извършват сделките, не участват в управлението на това предприятие.

Допълнителни разпоредби

§1. „Лична сделка“ е сделка с финансови инструменти, извършена от или от името на лице, което работи по договор за УД, ако е изпълнено едно от следните условия:

а) лицето, което работи по договор за УД, действа извън обхвата на дейността, която извършва в това свое качество;

б) сделката се извършва за сметка на някое от следните лица:

аа) лицето, което работи по договор за УД;

бб) лице, с което лицето по буква "аа" има семейна връзка или с което е свързано лице;

вв) лице, което има отношения с лицето по буква "аа", въз основа на които лицето по буква "аа" има пряк или непряк имуществен интерес от резултата от сделката, различен от такси или комисиони за изпълнение на сделката.

Преходни и заключителни разпоредби

§1. Настоящите правила за личните сделки с финансови инструменти на членовете на съвета на директорите и на лицата, работещи по договор за управляващото дружество УД „Алфа Асет Мениджмънт“ ЕАД се приемат на основание чл 32 от ЗДКСИДПКИ и чл. 125 от Наредба № 44.

§ 2. (изм. с Решение на СД от 16.12.2016 г.) Настоящите Правила са приети от СД на Дружеството на заседание, проведено на 02.08.2012 г. и изменени с решение на СД на Дружеството от 16.12.2016 г.

ИЗПЪЛНИТЕЛЕН ДИРЕКТОР: _____

/Любомир Евстатиев/

ПРИЛОЖЕНИЕ I Образец на доклад за подозрителна сделка и нареждане /ДПСН/	
РАЗДЕЛ 1 — ИДЕНТИФИКАЦИОННИ ДАННИ НА СУБЕКТ/ЛИЦЕ ПОДАВАЩО ДПСН Лицата, натоварени професионално с организирането или извършването на сделки/пазарните оператори и инвестиционните посредници, които управляват място на търговия — посочват за всеки отделен случай:	
Име на физическото лице	[Собствено име (имена) и фамилия (и) на физическото лице, което отговаря за подаването на ДПСН в подаващия субект.]
Длъжност в рамките на докладващия субект	[Длъжност на физическото лице, което отговаря за подаването на ДПСН в подаващия субект.]
Наименование на докладващия субект	[Пълно наименование на докладващото лице, включително за юридически лица: — правната форма според търговския регистър на държавата, съгласно чието право то е учредено, ако е приложимо, — Идентификационен код на правния субект (ИКПС) код в съответствие с ISO 17442 LEI код, където е приложимо.]
Адрес на докладващия субект	[Пълен адрес (напр. улица, номер, пощенски код, град, област/провинция, държава.)]
Качеството, в което действа субектът, по отношение на нарежданията или сделките, които биха могли да представляват злоупотреба с вътрешна информация, манипулиране на пазара или опит за злоупотреба с вътрешна информация или манипулиране на пазара	[Описание на качеството, в което докладващият субект е действал по отношение на нареждането (нарежданията) или сделката (сделките), които биха могли да представляват злоупотреба с вътрешна информация, манипулиране на пазара или опит за злоупотреба с вътрешна информация или манипулиране на пазара, например изпълнение на нареждания от името на клиенти, търгуване за собствена сметка, управление на място на търговия, систематичен участник.]
Вид търговска дейност (поддържане на пазара, арбитраж и др.) и вид на търгувания от докладващия субект инструмент (ценни книжа, деривати и др.) (ако има такъв) Връзка с лицето, по отношение на което е подадено ДПСН	[Описание на всички договорни, корпоративни или организационни мерки или обстоятелства или правоотношения]
Контакт за допълнително искане за информация	[Име на лице за контакт в рамките на докладващия субект, за допълнително искане за информация във връзка с настоящия доклад (напр. отговорник по съответствието) и съответните данни за контакт: — собствено (и) име (на) и фамилия(и) — длъжност на лицето за контакт в докладващата единица; — служебен електронен адрес.]

РАЗДЕЛ 2 — СДЕЛКА/НАРЕЖДАНЕ	
<p>Описание на финансовия инструмент:</p>	<p>[Опишете финансовия инструмент, който е предмет на ДПСН, като посочите:</p> <ul style="list-style-type: none"> — пълното наименование или описание на финансовия инструмент; — идентификационния код на инструмента, както е определен в Делегиран регламент на Комисията, приет съгласно член 26 от Регламент (ЕС) № 600/2014, когато е приложимо, или с други кодове; — вида финансов инструмент в съответствие с таксономията, използвана за класифициране на финансовия инструмент и свързания с нея код (CFI код) съгласно стандарта ISO 10962.] <p>[Допълнителни елементи за нареждания и сделки, свързани с извънборсовите деривати</p> <p>(Списъкът на данните по-долу не е изчерпателен)</p> <ul style="list-style-type: none"> — Определете вида на извънборсовия дериват (например договори за разлики (CFD), суапове, суаповете за кредитно неизпълнение (CDS) и извънборсови (OTC) опции) посредством типовете, посочени в член 4, параграф 3, буква б) от Регламент за изпълнение (ЕС) № 1247/2012 на Комисията. — Опишете характеристиките на извънборсовите деривати, включително най-малко, когато те са свързани с конкретния вид на деривата, следното: — номинална сума (номинална стойност); — валута, в която е деноминнирана цената; — дата на падежа; — премия (цена); — лихвен процент. <p>— Опишете най-малкото следното, когато е приложимо за конкретния тип извънборсови деривати:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Марж, предварително плащане и номинален размер или стойност на стоящия в основата финансов инструмент; — Условието, като например цената на упражняване, условията на договора (например спред на печалбата или загубата в зависимост от стъпката на котировката) <p>— Описание на финансовия инструмент — базовата позиция на извънборсовите деривати, с които се уточняват:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Пълното наименование на базовия финансов инструмент или описание на финансовия инструмент; — Идентификационния код на инструмента, както е определен Делегиран регламент на Комисията, приет съгласно член 26 от Регламент (ЕС) № 600/2014, когато е приложимо, или с други кодове; <p>Вида финансов инструмент в съответствие с таксономията, използвана за класифициране на финансовия инструмент и свързания с нея код (CFI код) съгласно стандарта ISO 10962.)]</p>
<p>Дата и час на нарежданията или сделките, които биха могли да представляват злоупотреба с вътрешна информация, манипулиране на пазара или опит за злоупотреба с вътрешна информация или манипулиране на</p>	<p>[Посочете датата и часа на нареждането (нарежданията) или сделката (сделките), като укажете и часовата зона.]</p>

<p>Пазар, на който са възникнали нареждането или сделката</p>	<p>[Уточнете: —наименование и код за идентифициране на мястото за търговия, систематичните участници или организираната платформа за търговия извън Съюза, на която нареждането е направено, а сделката е извършена, както е определено в Делегирания регламент на Комисията, приет съгласно член 26 от Регламент (ЕС) № 600/2014, или — ако нареждането не е било направено или сделката не е била изпълнена на някое от горепосочените места, моля, отбележете „извън място за търговия“.]</p>
<p>Местоположение (държава)</p>	<p>[пълно наименование на държавата и стандарт ISO 3166-1, двубуквен код на държавата.] /https://www.iso.org/obp/ui/#search – средна колона - Alpha-2 code (за Република България е - BG)/ /http://www.iso.org/iso/country_codes_glossary.html/ [Уточнете: — къде е направено нареждането (ако е известно); — къде е изпълнено нареждането.]</p>

<p>Описание на нареждането или сделката</p>	<p>[Опишете най-малко следните характеристики на докладваното нареждане (нареждания) или сделката (сделки)</p> <ul style="list-style-type: none"> — референтен номер на сделката/нареждането референтен номер (ако е приложимо); — дата и час на сетълмент; — покупна цена/продажна цена; — обем/количество на финансовите инструменти <p>[При наличие на множество нареждания или сделки, които биха могли да представляват злоупотреба с вътрешна информация, манипулиране на пазара или опит за злоупотреба с вътрешна информация или манипулиране на пазара, данните за цените и обемите на такива нареждания и сделки може да бъдат предоставени на компетентните власти в приложение към ДПСН.]</p> <ul style="list-style-type: none"> — информация за подаване на нареждането, включително най-малко следното: <ul style="list-style-type: none"> — вид на нареждането (напр. „купи при ограничение X EUR“); — начина, по който е направено нареждането (напр. електронен дневника на нарежданията); — момента, в който нареждането е направено; — лицето, което реално е пуснало нареждането; — лицето, което реално е получило нареждането; — начина, по който нареждането е предадено. — Информация за отмяна или промяна на нареждането (когато е приложимо): <ul style="list-style-type: none"> — момента на промяна или отмяна; — лицето, което е променило или отменило нареждането; — естеството на промяната (например промяна в цената или количеството) и степента на промяната; <p>[При наличие на множество нареждания или сделки, които биха могли да представляват злоупотреба с вътрешна информация, манипулиране на пазара или опит за злоупотреба с вътрешна информация или манипулиране на пазара, данните за цените и обемите на такива нареждания и сделки може да бъдат предоставени на компетентните власти в приложение към ДПСН.]</p> <ul style="list-style-type: none"> — средствата за промяна на нареждането (например по електронната поща, телефон и т.н.).]
<p>РАЗДЕЛ 3 — ОПИСАНИЕ НА ХАРАКТЕРА НА ПОДОЗРЕНИЕТО</p>	
<p>Характер на подозрението</p>	<p>[Уточнете вида на нарушението, който докладваните нареждания или сделки може да представляват:</p> <ul style="list-style-type: none"> — манипулиране на пазара; — злоупотреба с вътрешна информация; — опит за манипулиране на пазара; — опит за злоупотреба с вътрешна информация.]

Причини за подозрението	<p>[Описание на дейността (сделки и нареждания, начин на подаване на нарежданията или извършване на сделката, както и характеристиките на нарежданията и сделките, които ги правят подозрителни) и как проблемът е привлякъл вниманието на докладващото лице, като се посочват основанията за подозрение.</p> <p>Описанието може да включва следните водещи критерии (списъкът е неизчерпателен):</p> <ul style="list-style-type: none"> — за финансовите инструменти, допуснати до търгуване/, търгувани на място за търговия—описание на естеството на отбелязаните в дневника на нарежданията взаимодействия/сделки, които биха могли да представляват злоупотреба с вътрешна информация, манипулиране на пазара или опит за злоупотреба с вътрешна информация или манипулиране на пазара; —за извънборсовите деривати—подробности относно сделки или нареждания, подадени в базовия актив, и информация за всяка възможна връзка между операциите на паричния пазар на основния актив и докладваните операции с извънборсови деривати.]
<p>РАЗДЕЛ 4 —ИДЕНТИФИКАЦИОННИ ДАННИ ЗА ЛИЦЕТО, ЧИИТО НАРЕЖДАНИЯ ИЛИ СДЕЛКИ БИХА МОГЛИ ДА ПРЕДСТАВЛЯВАТ ЗЛОУПОТРЕБА С ВЪТРЕШНА ИНФОРМАЦИЯ, МАНИПУЛИРАНЕ НА ПАЗАРА ИЛИ ОПИТ ЗА ЗЛОУПОТРЕБА С ВЪТРЕШНА ИНФОРМАЦИЯ ИЛИ МАНИПУЛИРАНЕ НА ПАЗАРА („ЗАПОДОЗРЯНО ЛИЦЕ“)</p>	
Име	<p>[За физически лица: лично и фамилно име.] [За юридически лица: пълно наименование, включително правна форма, според търговския регистър на държавата, съгласно чието право то е учредено, ако е приложимо, и идентификационен код на правния субект (ИКПС) код в съответствие с ISO 17442, / https://www.gmeiutility.org/actions/Search - за търсене по наименование на ю.л./]</p>
Дата на раждане	[Само за физически лица.] [гггг-мм-дд]
Национален идентификационен номер (където е приложимо)	[Ако е приложимо в съответната държава членка.] [Номер и/или текст] (ЕГН/ЕИК и т.н)
Адрес	[Пълен адрес (напр. улица, номер, пощенски код, град, област/провинция, държава.)]
Информация за местоработата — Място — Длъжност	[Информация за длъжността на заподозряното лице, от източници на информация на вътрешноведомствено разположение на отчитащото се предприятие (например документация, свързана със сметките — когато става въпрос за клиенти, информационна система за персонала — когато става въпрос за служители на докладващия субект).]
Номер на сметката (сметките)	[Номер на сметката (сметките) за парични средства и ценни книжа, каквито и да било общи сметки или всякакви пълномощни във връзка със сметката, притежавани от заподозрения субект/лице.]

Клиентски идентификационен код при докладване на сделките съгласно Регламент (ЕС) № 600/2014 относно пазарите на финансови инструменти (или каквито и да било други идентификационни кодове)	[В случай че заподозряното лице е клиент на докладващия субект.]
Отношения с емитента на финансовите инструменти (когато е приложимо и когато е известен)	[Описание на всички договорни, корпоративни или организационни мерки или обстоятелства или правоотношения]
<p>РАЗДЕЛ 5 —ДОПЪЛНИТЕЛНА ИНФОРМАЦИЯ Контекст или всякаква друга информация, която докладващият субект смята за уместна за доклада</p>	
<p>[Неизчерпателен списък във връзка с допълнителната информация.</p> <ul style="list-style-type: none"> — Позицията на заподозряното лице (напр. непрофесионален клиент, институции); — Характер на интервенцията на заподозрения субект/лице (за собствена сметка, за сметка на клиент, други); — Размер на финансовия портфейл на заподозрения субект/лице; — Датата, на която са започнали деловите отношения с клиента, ако заподозреният субект/лице е клиент на докладващото лице/субект; — Вид дейност на търговската платформа, ако има такава, на заподозрения субект; — Търговски модели на заподозряното лице/субект. С цел предоставяне на насоки — по-долу са дадени примери за информация, която може да бъде полезна: <ul style="list-style-type: none"> — обичайни търговски практики на заподозряното лице/субект по отношение на използването на ливъридж и късите продажби, както и честотата на употреба; <ul style="list-style-type: none"> съпоставимост на размера на докладваното нареждане/сделка със среден размер на подадените нареждания/сделки, извършвани от заподозряното лице/субект за последните 12 месеца; — обичайни практики на заподозряното лице/субект по отношение на емитентите, чиито ценни книжа се търгуват от него, или видовете финансови инструменти, търгувани през последните 12 месеца, по-специално <ul style="list-style-type: none"> дали докладваното нареждане/сделка е свързано с емитент, чиито ценни книжа са се търгували от заподозряното лице/субект през изминалата година. — Други субекти/лица, за които се знае, че са свързани с нареждания или сделки, които биха могли да представляват злоупотреба с вътрешна информация, манипулиране на пазара или опит за злоупотреба с вътрешна информация или манипулиране на пазара: <ul style="list-style-type: none"> — Имена; — Дейност (напр. изпълнение на нареждания от името на клиенти и търгуване за собствена сметка, управление на място на търговия, системни участници и т.н.).] 	
<p>РАЗДЕЛ 6 —ПРИЛОЖЕНА ИНФОРМАЦИЯ</p>	
<p>[Списък на документи и материали, прилагани към ДПСН.</p> <p>Примери за такива документи са съобщения по електронната поща, записи на разговори, записи на нареждания/сделки, потвърждения, брокерски доклади, пълномощни документи и коментари в медиите, когато това е уместно.</p> <p>Когато подробната информация относно нарежданията/сделките, посочени в раздел 2 от настоящия образец, са представени в отделно приложение, да се посочи заглавието на приложението.]</p>	