

**БЪЛГАРСКА  
ФОНДОВА  
БОРСА - СОФИЯ**



БЪЛГАРСКА  
ФОНДОВА БОРСА  
СОФИЯ

**УСЛУГА ЗА ОБМЕН НА ФАЙЛОВЕ  
ВЪВ ВРЪЗКА С  
ДЕЛЕГИРАН РЕГЛАМЕНТ (ЕС) 2017/580  
(AUDIT TRAIL DATA EXCHANGE)**

## 1. Въведение

Настоящият документ представлява описание на услугата за обмен на файлове, която БФБ-София ще използва във връзка с предстоящото влизане в сила на регулации и изисквания, свързани с разпоредбите на директивата за пазарите на финансови инструменти, Markets in Financial Instruments Directive (MiFID II) 2014/65EU и регламента за пазарите на финансови инструменти, Markets in Financial Instruments Regulation (MiFIR) 600/2014, както и свързаните с тях регулаторни технически стандарти (RTS).

Съгласно чл. 25, ал. 2 от MiFIR, както и Делегиран Регламент (ЕС) 2017/580 (RTS 24), БФБ-София следва да предоставя на компетентните органи за всяка въведена в системата за търговия борсова поръчка, използвайки единни стандарти и формати, информация за:

- клиентите на борсовите членове;
- лицето, което взема инвестиционното решение във връзка с въведената поръчка;
- лицето, което е отговорно за изпълнението на поръчката.

## 2. Специфики при въвеждане на поръчки в Xetra 17.0 във връзка с Делегиран Регламент (ЕС) 2017/580

Във връзка с описаните нови регулаторни изисквания, считано от 20.11.2017г, след имплементацията на Xetra версия 17.0, при въвеждане на всяка поръчка в търговската система борсовите членове ще е необходимо да попълват информацията, описана по-долу, във връзка със своите клиенти и лицата, които взимат инвестиционни решения. Изискването за рапортуване на тази информация влиза в сила считано от 03.01.2018г. Преди тази дата, в съответното поле при въвеждане на поръчки за сметка на клиент в Системата, е възможно да се въведат произволно избрани цифри, които да отговарят на изискването на полето – максимален брой 19 цифрови символи, като максималното число е  $2^{63}-1$ . До края на годината информацията в полетата, касаещи инвестиционно решение в рамките на борсовия член, може да не бъде попълвана.

- Client ID – кратък код на клиента на борсовия член

В полето се въвежда краткия код на клиента на борсовия член – физическо или юридическо лице. Кодът е цяло положително число от 1 до 19 цифри, като е уникален за съответния клиент в борсовия член. Когато става въпрос за групова (агрегирана поръчка) като Client ID се използва индикатора AGGR (борсовият член въвежда числото 1). Когато става въпрос за предстоящо разпределение и клиентът все още не е ясен се използва индикатора PNAL (въвежда се числото 2). В тази връзка борсовите членове не следва да използват кратки кодове 1 и 2 за други цели, освен горепосочените.

- Investment Decision ID - кратък код на физическо лице или алгоритъм, отговорни за инвестиционното решение в рамките на борсовия член.
-

В случай, че се подава поръчка за сметка на борсовия член, полетата за идентифициране на лицето или алгоритъма в рамките на борсовия член следва да бъдат попълнени. Възможните сценарии за инвестиционното решение в рамките на борсовия член са посочени в Таблица 1 по-долу:

**Таблица 1**

	<b>Сценарий</b>	<b>InvInd<sup>1</sup>, който да се въведе</b>	<b>InvDec<sup>2</sup>, който да се въведе</b>	<b>Данни за КФН</b>
1	Поръчката е за собствена сметка. Решението е взето от алгоритъм.	1	Algo ID	Algo ID
2а	Поръчката е за собствена сметка. Решението е взето от лице, различно от брокера.	2	Кратък код	Национален идентификационен код на физическо лице
2б	Поръчката е за собствена сметка. Решението е взето от брокера.	2	Непопълнено	Национален идентификационен код на брокера
3	Поръчката е за собствена сметка.	0	Непопълнено	Национален идентификационен код на брокера

Останалите две задължителни за рапортуване полета съгласно Делегиран Регламент (ЕС) 2017/580, ParticipantID и ExecutionID, ще бъдат служебно присвоявани от БФБ-София съобразно съществуващата информация, съответно за борсовия член и за борсовия посредник, въвел поръчката.

### 3. Кратки кодове

В съответствие с практиката на повечето регулирани пазари в ЕС, БФБ-София смята да използва т.н. кратки кодове (short codes) за идентификация на клиентите на борсовите членове (Client ID по-горе) и на лицата, взимащи инвестиционни решения за съответните поръчки (Investment ID по-

<sup>1</sup> Investment Indicator

<sup>2</sup> Investment Decision ID

горе). Тези кодове ще се въвеждат при подаване на поръчки и следва да са уникални за борсовия член по отношение на клиентите и лицата, взимащи инвестиционни решения. В тази връзка, не е необходима повторна регистрация на едно и също физическо лице, когато то се явява за определени поръчки клиент на инвестиционния посредник, а за други – лице, вземащо инвестиционното решение.

Данните от кратките кодове, въведени при подаване на поръчка, ще се свързват с национален идентификационен код за физическо лице, в съответствие с Приложение II на делегиран Регламент 2017/590, или LEI код, в съответствие със стандарт ISO 17442 за юридическо лице, като следва да бъдат представени в БФБ-София във формата, описан в т. 4 от настоящия документ.

Всеки борсов член следва да представи в БФБ-София **за всеки свой активен клиент физическо и юридическо лице, както и лице, което взема инвестиционно решение** следната информация:

- Идентификационен код на правния субект по ISO 17442 (LEI код) за клиента на борсовия член, в случай че този клиент е юридическо лице;
- Национален клиентски идентификационен код, определен съгласно Приложение II на Делегиран Регламент (ЕС) 2017/590 за клиента на борсовия член, в случай че този клиент е физическо лице;
- Национален идентификационен код на лицето, което взема инвестиционно решение във връзка с въведената поръчка в рамките на борсовия член;

От **3 януари 2018г.** борсовите членове ще трябва да изпращат в БФБ-София информация за всеки **нов** клиент (физическо или юридическо лице) и всяко **ново** лице, вземащо инвестиционно решение за съответната поръчка **до края на деня T**, на който е въведена тази поръчка. В случай на възникнали грешки или липса на информация, необходимите корекции следва да се извършват най-късно до деня T+1.

#### **4. Описание и технически характеристики на предлаганата услуга за обмен на файлове**

Предлаганата услуга за обмен на файлове на БФБ-София има за цел да улесни изпълнението на регулаторните изисквания, като даде възможност на борсовите членове да изпращат посочените по-горе данни към БФБ-София по максимално облекчен начин. Чрез получената информация БФБ-София ще извършва релация (mapping) между въведените параметри в съответната поръчка (кратките кодове за клиентите и лицата, взимащи инвестиционни решения) и необходимата информация за целите на регулаторните изисквания по Делегиран Регламент (ЕС) 2017/580.

Услугата за обмен на файлове използва FTP (21 порт), Implicit FTPS (990 порт) и Explicit FTPS (21) протоколи. Като FTP клиент може да се използва всеки клиент, който поддържа тези протоколи - примерно [FileZilla](#), [WinSCP](#), др. Изпращаният от потребителите файл следва да е в CSV (comma-separated values) формат, като използвания разделител е ';' (запетая). Използваният разделител може да бъде проверен от регионалните настройки в контролния панел на компютъра.

---

Изпращаният файл съдържа 9 полета съгласно описанието в Таблица 2. По-долу е представен примерен вариант на правилен /горе/ и грешен /долу/ формат на данните. Следва да обърнете внимание на разделителят, както и на изписването на датата. Правилният разделител е ';' (запетая), а правилно изписаната дата е 2017-09-13



Пример за правилно съдържание:

MIC;Status;Validfrom;Shortcode;Classification;Nationalidcode;Nationalidpriority;Clientlong;CobosClient  
XBUL;N;2017-09-13;43657435;N;BG;1;7908346576;TR12345678

Подробни разяснения за всяко от полетата във файла са налични след таблицата.

**Таблица 2**

Поле	Задължително	Значение на полето	Формат на полето	Пример
MIC	Да	MIC код на пазара	4 буквени символа във формат [A-Z]	XBUL
Status	Да	Добавяне или промяна на клиент на борсовия член или лице, вземащо инвестиционно решение за въведената поръчка	Буквен символ N или M, където: N – нов клиент/лице, вземащо инв. решение; M – промяна на клиент/лице, вземащо инв. решение	N
Validfrom	Да	Дата на добавяне или промяна на клиента или лицето, вземащо инв. решение	Дата във формат YYYY-MM-DD	2017-09-13

Shortcode	Да	Кратък код на клиента или лицето, взимащо инв. решение	Цяло положително число, по-голямо от 2 (от 1 до 19 цифри)	34578
Classification	Да	Класификация на клиента/лицето, взимащо инв. решение	Буквен символ N или L, където: N обозначава физическо лице; L обозначава юридическо лице	N
Nationalidcode	Да, ако Classification = N; полето следва да е празно ако Classification = L	Код на държавата, чийто гражданин е лицето, съгласно ISO 3166-1	2 буквени символа във формат [A-Z]	CZ
Nationalidpriority	Да, ако Classification = N; полето следва да е празно ако Classification = L	Приоритетен идентификационен код за националния клиентски идентификационен код за физически лица	Възможните стойности са 1, 2 или 3 съгласно Приложение II на Делегиран Регламент (ЕС) 2017/590	1
Clientlong	Да	Национален клиентски идентификационен код за физическите лица или LEI код за юридическите лица	Буквено-цифрови символи с максимална дължина от 35 символа във формат [A-Za-z0-9#]	19900415E MMA#WATS O
CobosClient	Да, ако клиента е абонат на COBOS	Клиентски номер в COBOS	10 буквено-цифрови символи във формат [A-Z0-9]	KL1234567 8

Попълването на всички полета (с изключение на Nationalidcode, Nationalidpriority и CobosClient, които зависят от определени условия) е абсолютно задължително, за да бъде успешно изпратен файла към БФБ-София.

---

В **полето MIC** се обозначава MIC кода на регулирания пазар, на който е въведена поръчката, като кодът на БФБ-София е XBUL.

**Полето Status** дава възможност за следните две действия: добавяне на нов клиент или лице, вземащо инвестиционно решение за въведената поръчка и промяна на клиент или лице. В случай, че за първи път борсовият член изпраща информация за съответния клиент или лице, то следва да се използва действието добавяне (N). Ако по някаква причина е необходимо да бъде променена вече изпратена към БФБ-София информация за клиент или лице (напр. техническа грешка), то следва да се използва действието промяна (M). В случай, че за един и същ клиент или лице след добавянето му има няколко изпратени записа или файла за промяна, то всеки следващ запис или файл замества предишния, т.е. актуална ще е информацията от последно изпратения запис или файл.

**Полето Validfrom** указва датата на добавяне или промяна на клиент или лице, вземащо инв. решение. Форматът на датата е YYYY-MM-DD, съответно означаващи годината, месеца и датата.

**Полето Shortcode** е кодът, с който борсовият член е обозначил своя клиент или лице, вземащо инвестиционно решение при въвеждане на поръчката. Както беше указано по-горе, всеки клиент/лице, вземащо инвестиционно решение, следва да има уникален код в рамките на съответния инвестиционен посредник. Краткият код може да е цяло положително число, по-голямо от 2, като следва да е от 1 до 19 символа.

**Полето Classification** указва типа на клиента или лицето, вземащо инвестиционно решение, като възможните формати са N за физическо лице (приложимо е и за клиенти, и за лица, вземащи инв. решения) и L за юридическо лице (приложимо е само клиенти).

**Полето Nationalidcode** се попълва, само ако поле Classification е N, т.е. ако се въвеждат данни за физическо лице. В този случай в полето се указва двубуквения код държавата на лицето, чийто гражданин е, съгласно стандарта ISO 3166-1 (напр. кодът на България е BG). Ако Classification е L (юридическо лице), то полето следва да остане празно.

**Поле Nationalidpriority** отново се попълва само в случай че поле Classification е N, като се указва приоритетния код (1, 2 или 3), който следва да се използва за идентификация на физическите лица съгласно чл. 6 на Делегиран Регламент (ЕС) 2017/590. Например в случай на физическо лице от България е указано, че единният граждански номер (ЕГН) е с най-висок приоритетен код 1 и следва да се използва за идентификация, т.е. в конкретния случай в полето ще се попълни цифрата 1.

В **полето Clientlong** се попълва информация за националния клиентски идентификационен код, определен съгласно Приложение II на Делегиран Регламент (ЕС) 2017/590) или LEI код за юридическите лица, като е възможно да се въведе буквено-цифрова комбинация от символи с максимална дължина от 35 символа. В горния случай на произволно физическо лице от България в полето Clientlong следва да се въведе ЕГН на лицето.

**Полето CobosClient** е задължително само в случай че клиентът на борсовия член е клиент и на COBOS, като в този случай в полето се записва клиентския номер в COBOS, който е с фиксирана дължина от 10 буквено-цифрови символи.

---

Ако при въвеждането на една поръчка борсовият член има едновременно нов клиент и ново лице, вземащо инвестиционно решение, то ще са необходими два отделни записа (реда) за всяко едно от лицата. Един файл може да съдържа много на брой записи, като единственото ограничение е максималния размер на файла да е 1МВ.

Конвенцията за именуване на файла, която потребителите на услугата следва да използват е: RTS24MAP\_XXXXXX.csv, където на мястото на символа X стои цифра в интервала от 0 до 9 включително. Примери за правилни имена на файлове са RTS24MAP\_123456.csv или RTS24MAP\_000001.csv, а примери за неправилни имена са RTS24MAP.csv или RTS24MAP\_1.csv. Имената на файловете следва да са уникални, т.е. потребителите да не изпращат повече от веднъж файл с едно и също име към БФБ-София.

След влизане в съответния FTP клиент с потребителско име и парола потребителите имат достъп до 2 папки – outgoing и incoming. В папка outgoing потребителите качват съответния файл, като файлове, които не отговарят на конвенцията за именуване, посочена по-горе, няма да бъдат обработени.

След обработка от системата полученият файл се изтрива, а резултатът от обработката се получава в папка incoming във файл с наименование RESP\_[име на получения файл] в json (JavaScript Object Notation) формат. Обработеният от системата файл съдържа информация за успешно обработените записи във файла (successfullyProcessedRows), както и за допуснатите грешки в него (countErrors и errors). В случай, че има една или повече грешки в един запис, то целият запис не е обработен успешно и следва да бъде повторно подаден към БФБ-София, като бъде именуван съгласно описаната по-горе конвенция. Желателно е потребителите да изтриват прочетените файлове в папка incoming, тъй като всеки потребител има квота от 20МВ.

Услугата за обмен на файлове на БФБ-София във връзка с Делегиран Регламент (ЕС) 2017/580 ще работи в тестов режим до 19:00 часа на 15.12.2017 г. След този момент, акумулираната от БФБ информация ще бъде изтрита, съответно системата ще премине към работа в реална среда. Борсовите членове следва да въведат информацията за всички свои съществуващи клиенти и лица, вземащи инвестиционни решения, съобразно спецификацията на услугата най-късно до 31.12.2017 г., както и при всяко последващо допълнение в нея. Услугата е налична и в неработни дни.

Потребителите могат да качват файлове в удобно за тях време без никакви ограничения. Обработката на файловете от системата се осъществява всеки ден от седмицата между 17:00 и 19:00 часа, като процедурата се стартира на всеки 5 минути. Приоритет при обработването на качените файлове от един потребител към определен момент има наименованието на файла, т.е. файл с наименование RTS24MAP\_000001.csv се обработва преди файл RTS24MAP\_000002.csv

За повече информация във връзка с предлаганата от БФБ-София услуга, вкл. за получаване на потребителско име, парола и адрес на FTP сървъра, можете да се обръщате към Дирекция „Търговия, емитенти и членство“ на телефони 02/937 09 30 и 02/937 09 33. За технически въпроси можете да се обръщате към Дирекция „Информационни технологии“ на телефони 02/4001 452 и 02/937 09 58.

---