



Laidiens: 22.09.2004., Nr. 150

Latvijas Centrālā depozitārija noteikumi Nr.6

Par norēķiniem par biržā noslēgtajiem vai reģistrētajiem darījumiem

Apstiprināti Latvijas Centrālā depozitārija padomes sēdē 2004.gada 18.jūnijā

Stājas spēkā 2004.gada 27.septembrī

Latvijas Centrālā depozitārija (turpmāk — LCD) noteikumi Nr. 6 “Par norēķiniem par biržā noslēgtajiem vai reģistrētajiem darījumiem” (turpmāk — Noteikumi) ir izstrādāti, pamatojoties uz Finanšu instrumentu tirgus likuma (turpmāk — Likums) 94.panta otrās daļas ceturto punktu un nosaka kārtību, kādā tiek veikti norēķini par biržā noslēgtajiem vai reģistrētajiem darījumiem ar finanšu instrumentiem, kuri ir iegrāmatoti LCD.

1. Noteikumos lietotie termini

1.1. Noteikumos lietotie termini un jēdzieni, kas nav skaidroti, atbilst Likumā lietotajiem terminiem un jēdzieniem.

1.2. *Birža* — kapitālsabiedrība, kura Likumā noteiktajā kārtībā saņēmusi licenci regulētā tirgus organizēšanai.

1.3. *Biržas biedrs* — ieguldījumu brokeru sabiedrība vai kredītiestāde, kura Likumā noteiktajā kārtībā ir ieguvusi tiesības sniegt ieguldījumu pakalpojumus Latvijā un ir ieguvusi Biržas biedra statusu.

1.4. *Darījums* — darījums, kas tiek veikts ar LCD iegrāmatotiem un Biržas regulētajos tirgos iekļautiem finanšu instrumentiem un kas atbilstoši Biržas noteiktajai kārtībai ir noslēgts vai reģistrēts Biržas tirdzniecības sistēmā.

1.5. *DVP norēķini* — norēķinu veids “piegāde par samaksu” (*delivery versus payment*) finanšu instrumentu darījumiem, kurā finanšu instrumentu pārvedumi un ar tiem saistītie naudas norēķini notiek vienlaikus, tādējādi izslēdzot risku, ka darījuma puses nepiegādās finanšu instrumentus vai nesamaksās naudu.

1.6. *Korespondējošais konts LCD* — finanšu instrumentu uzskaites konts, kuru LCD atver LCD dalībniekam un kurā uzskaita LCD dalībnieka turējumā esošos finanšu instrumentus.

1.7. *LCD dalībnieks* — ieguldījumu brokeru sabiedrība vai kredītiestāde, kura Likumā noteiktajā kārtībā ir ieguvusi tiesības sniegt ieguldījumu pakalpojumus un turēt finanšu instrumentu kontus un kura LCD noteiktajā kārtībā ir ieguvusi LCD dalībnieka statusu.

1.8. *Neto pozīcija* — viena LCD dalībnieka saistību kopums naudā vai finanšu instrumentos pret citiem LCD dalībniekiem, kas aprēķināts, ņemot vērā noslēgtos Darījumus ar vienādu S dienu, no kuriem atskaitīti ieskaita rezultātā dzēstie savstarpējie prasījumi.

1.9. *Norēķinu uzdevumi* — uzdevumi, kurus Birža iesniedz LCD, lai veiktu DVP norēķinus par finanšu instrumentu pirkšanas un pārdošanas Darījumiem.

1.10. *T diena* — Darījuma noslēgšanas vai reģistrēšanas diena.

1.11. *T+0* — Darījuma noslēgšanas vai reģistrēšanas diena, kas vienlaikus ir arī diena, kurā notiek finanšu instrumentu un ar tiem saistītie naudas norēķini.

1.12. *T+1* — nākamā darba diena pēc Darījuma noslēgšanas vai reģistrēšanas dienas.

1.13. *T+3* — trešā darba dienas pēc Darījuma noslēgšanas vai reģistrēšanas dienas.

1.14. *S diena* — diena, kurā notiek finanšu instrumentu norēķini un ar tiem saistītie naudas norēķini.

1.15. *S-1 diena* — viena darba diena pirms S dienas.

2. Vispārīgie jautājumi

2.1. Noteikumi nosaka kārtību, kādā LCD organizē norēķinus par Darījumiem, ja saistītos naudas norēķinus veic latos.

2.2. LCD norēķinu sistēmā ar Darījumiem saistītie norēķini tiek veikti vienā no šādiem veidiem:

2.2.1. DVP norēķini pēc neto pozīcijām, ja Darījumam norēķinu periods ir T+1 vai garāks;

2.2.2. DVP norēķini par katru darījumu atsevišķi (pēc bruto principa), ja Darījuma norēķinu periods ir T+0.

2.3. DVP norēķinu izpildes rezultātā LCD pārskaita norēķinu uzdevumā norādītos finanšu instrumentus no tā LCD dalībnieka korespondējošā konta, pie kura finanšu instrumentu pārdevējam atvērts finanšu instrumentu konts, uz tā LCD dalībnieka korespondējošo kontu, pie kura finanšu instrumentu pircējam atvērts finanšu instrumentu konts, un līdzīgi finanšu instrumentu pārskaitīšanai, ieskaita naudu LCD dalībnieka, pie kura finanšu instrumentu pārdevējam atvērts finanšu instrumentu konts, norādītajā naudas kontā.

2.4. Naudas norēķinu banka Darījumiem, ar kuriem saistītos naudas norēķinus veic latos, ir Latvijas Banka.

2.5. LCD dalībnieks ar Darījumiem saistītos naudas norēķinus var veikt:

2.5.1. tiešā veidā, ja LCD dalībnieks tur naudas kontus un ir noslēdzis trīspusēju līgumu ar LCD un Latvijas Banku atbilstoši LCD noteikumiem Nr.1 “Par LCD dalībniekiem”;

2.5.2. netiešā veidā, ja LCD dalībnieks ir noslēdzis līgumu ar LCD dalībnieku, kurš var veikt naudas norēķinus tiešā veidā (turpmāk — pilnvarotais LCD dalībnieks), par naudas norēķinu nodrošināšanu un šis līgums ir iesniegts LCD. Maksimālā naudas summa, kuru LCD dalībnieks ir tiesīgs izmantot neto un bruto norēķiniem par katras dienas Darījumiem(u), tiek norādīta līgumā vai uz līguma pamata izsniegtajā pilnvarā, kuru LCD dalībnieks iesniedz LCD. Līgumā var paredzēt, ka pilnvarotais LCD dalībnieks katru dienu sniedz LCD paziņojumu, kurā norāda naudas summu, par kādu tas piekrīt veikt naudas norēķinus par cita LCD dalībnieka veiktajiem darījumiem.

2.6. Datu apmaiņa starp LCD un LCD dalībnieku notiek elektroniskā formā saskaņā ar LCD noteikumos Nr.11 “Par datu apmaiņu” noteikto kārtību.

2.7. Datu apmaiņa starp LCD un Biržu notiek formā, kas noteikta līgumā, kurš noslēgts starp LCD un Biržu. Līgumā tiek noteikta arī kārtība, kādā Birža nodrošina LCD ar informāciju par tiem norēķinu veicējiem, kuri izmantojami, ja:

2.7.1. Biržas tirdzniecības sistēmā informācija par norēķinu veicēju, kurš ir izmantojams norēķiniem par Darījumu, ir ievadīta kļūdaina vai nepilnīga;

2.7.2. Noteikumos minētajos gadījumos pienākums veikt norēķinus pāriet Biržas biedram, kurš darījumu ir noslēdzis vai reģistrējis Biržā.

2.8. Ja DVP norēķinu procesā par Darījumiem ir iesaistīts ārvalstu centrālais depozitārijs vai finanšu instrumentu norēķinus organizējoša organizācija (turpmāk — ārvalstu centrālais depozitārijs), ar kuru LCD ir noslēdzis sadarbības līgumu, tad šo noteikumu izpratnē tas ir uzskatāms par LCD dalībnieku. LCD valde, ievērojot šos noteikumus, ja tas ir nepieciešams, izstrādā kārtību, kurā aprakstītas specifiskas prasības, kas jāievēro LCD dalībniekiem, ja DVP norēķinu procesā par Darījumiem ir iesaistīts ārvalstu centrālais depozitārijs.

3. DVP norēķinu pēc neto pozīcijām vispārīgie jautājumi

3.1. LCD veic DVP norēķinus pēc neto pozīcijām par tiem Darījumiem, kuriem norēķinu periods ir T+1 vai garāks. Ja Birža norēķinu uzdevumā nav norādījusi citu norēķinu periodu, DVP norēķini pēc neto pozīcijām tiek veikti norēķinu periodā T+3.

3.2. LCD veic DVP norēķinus pēc neto pozīcijām, pamatojoties uz Biržas iesniegtajiem norēķinu uzdevumiem.

3.3. DVP norēķini pēc neto pozīcijām tiek pabeigti S dienā plkst.10.30 (turpmāk arī — pirmais norēķinu cikls), ja atbilstoši uz S dienas plkst.9.00 aprēķinātajām neto pozīcijām, Noteikumu 4. sadaļā noteiktajā kārtībā ir nodrošināts pietiekams finanšu instrumentu un naudas daudzums.

3.4. Ja pirmajā norēķinu ciklā kādu no neto pozīcijās iekļautajiem norēķinu uzdevumiem nevar izpildīt nepietiekama naudas daudzuma dēļ, visu attiecīgajā neto pozīcijā iekļauto norēķinu uzdevumu izpilde tiek pārcelta uz otro norēķinu ciklu un norēķini tiek veikti Noteikumu 5. sadaļā noteiktajā kārtībā.

3.5. Ja pirmajā vai otrajā norēķinu pēc neto pozīcijām ciklā kāds no norēķinu uzdevumiem netiek izpildīts, jo Noteikumu 4. un 5. nodaļā paredzētajā kārtībā un uz noteikto brīdi nav nodrošināts pietiekams finanšu instrumentu daudzums, LCD izslēdz norēķinu uzdevumu no neto pozīcijas aprēķina un veic to atsevišķi atbilstoši Noteikumu 6.12.punktā noteiktajai kārtībai.

4. DVP norēķinu pēc neto pozīcijām pirmais cikls

4.1. Birža T dienā sagatavo un nosūta LCD norēķinu uzdevumu saskaņā ar kārtību, kura noteikta starp LCD un Biržu noslēgtajā līgumā.

4.2. T dienā pēc norēķinu uzdevumu saņemšanas no Biržas LCD nekavējoties pārbauda un izvērtē, vai Darījumiem, par kuriem ir iesniegti norēķinu uzdevumi, ir nepieciešams apstiprinājums (piekrišana veikt norēķinus) no LCD dalībnieka, kurš atbilstoši norēķinu uzdevumā norādītajai informācijai nodrošina ar Darījumu saistītos norēķinus.

Ja apstiprinājums ir nepieciešams, LCD nekavējoties nosūta apstiprinājuma pieprasījumu attiecīgajam LCD dalībniekam, norādot nepieciešamo apstiprinājuma veidu.

4.3. LCD pieprasa no LCD dalībnieka apstiprinājumu (piekrišanu veikt norēķinus) šādos gadījumos:

4.3.1. ja Biržas iesniegtajā norēķinu uzdevumā ir norādīts, ka, ievadot uzdevumu Biržas tirdzniecības sistēmā, informācija par norēķinu veicēju bija ievadīta kļūdaini un līdz ar to norēķiniem nepieciešamo informāciju ir papildinājusi Birža, ņemot vērā Biržas biedra norādīto informāciju par minētajā gadījumā izmantojamo norēķinu veicēju;

4.3.2. ja Biržas iesniegtajā norēķinu uzdevumā ir norādīts, ka, ievadot uzdevumu Biržas tirdzniecības sistēmā, informācija par norēķinu veicēju bija ievadīta nepilnīgi un līdz ar to norēķiniem nepieciešamo informāciju ir

papildinājusi Birža, ņemot vērā Biržas biedra norādīto informāciju par minētajā gadījumā izmantojamo norēķinu veicēju;

4.3.3. ja Biržas iesniegtajā norēķinu uzdevumā LCD ir norādīts, ka uzdevuma izpildei ir nepieciešams saņemt apstiprinājumu no LCD dalībnieka, kurš ir norādīts kā norēķinu veicējs Darījumam;

4.3.4. ja Biržas iesniegtajā norēķinu uzdevumā ir norādīts, ka ar Darījumu saistītos norēķinus nodrošinās LCD dalībnieks, kas nav tā pati juridiskā persona (Biržas biedrs), kas šo Darījumu ir noslēgusi vai reģistrējusi Biržas tirdzniecības sistēmā.

4.4. Līdz S-1 dienas plkst.13.00 LCD dalībniekam pēc savas iniciatīvas ir tiesības noraidīt norēķinu uzdevumu izpildi šādos gadījumos:

4.4.1. ja Biržas tirdzniecības sistēmā ievadītajā uzdevumā informācija par norēķinu veicēju bija ievadīta kļūdaini un līdz ar to norēķiniem nepieciešamo informāciju ir papildinājusi Birža, ņemot vērā Biržas biedra norādīto informāciju par minētajā gadījumā izmantojamo norēķinu veicēju;

4.4.2. ja Biržas tirdzniecības sistēmā ievadītajā uzdevumā informācija par norēķinu veicēju bija ievadīta nepilnīgi un līdz ar to norēķiniem nepieciešamo informāciju ir papildinājusi Birža, ņemot vērā Biržas biedra norādīto informāciju par minētajā gadījumā izmantojamo norēķinu veicēju;

4.4.3. ja Biržas tirdzniecības sistēmā ievadītajā uzdevumā informācija par norēķinu veicēju bija ievadīta pilnā apjomā, taču tā neatbilst Darījuma puses rīkojumam (iesniegtajam uzdevumam).

4.5. LCD dalībnieks, noraidot norēķinu uzdevuma izpildi pēc savas iniciatīvas, nosūta LCD attiecīgu paziņojumu. Šajā paziņojumā LCD dalībniekam ir tiesības norādīt precizētu norēķiniem nepieciešamo informāciju, par kuru LCD pieprasa apstiprinājumu Noteikumu 4.2.punktā noteiktajā kārtībā. Ja LCD dalībnieks ir noraidījis Biržas tirdzniecības sistēmā ievadītā uzdevuma izpildi un nav norādījis precizētu norēķiniem nepieciešamo informāciju, LCD pieņem, ka pienākums veikt norēķinus ir Biržas biedram, kurš šo Darījumu noslēdzis vai reģistrējis Biržā, un LCD pieprasa apstiprinājumu Noteikumu 4.2.punktā noteiktajā kārtībā LCD dalībniekam, pie kura Biržas biedram atvērts finanšu instrumentu konts.

4.6. Līdz S-1 dienas plkst.16.00 LCD dalībnieks iesniedz LCD atbildes ziņojumu (piekrišana vai atteikums veikt norēķinus) uz apstiprinājuma pieprasījumu, kuru LCD ir nosūtījis LCD dalībniekam saskaņā ar Noteikumu 4.2.punktu. Pēc atbildes ziņojuma saņemšanas LCD nekavējoties nosūta LCD dalībniekam vienu no šādiem paziņojumiem:

4.6.1. paziņojumu par piekrišanu veikt norēķinus, ja LCD dalībnieks ir piekritis veikt norēķinus;

4.6.2. paziņojumu par Biržas biedra pienākumu veikt norēķinus, ja LCD dalībnieks ir atteicies veikt norēķinus;

4.6.3. paziņojumu par kļūdaini aizpildītu ziņojumu, ja LCD dalībnieka atbildes ziņojumā kāds no laukiem ir aizpildīts kļūdaini.

4.7. Ja līdz S-1 dienas plkst.16.00 LCD nesaņem no LCD dalībnieka atbildi uz Noteikumu 4.2. punktā minēto apstiprinājuma pieprasījumu, kā arī, ja LCD dalībnieks nepiekrīt veikt norēķinus vai LCD dalībnieka atbildes ziņojums ir kļūdainis, pienākums veikt norēķinus par Darījumu pāriet Biržas biedram, kurš šo Darījumu noslēdzis vai reģistrējis Biržā, un LCD nosūta Biržai un LCD dalībniekiem attiecīgus paziņojumus.

4.8. S-1 dienā plkst.16.30 LCD aprēķina plānotās finanšu instrumentu un naudas neto pozīcijas norēķiniem S dienā un pārbauda, vai LCD dalībnieku korespondējošos kontos ir pietiekams skaits finanšu instrumentu norēķinu