

Kryteria wyboru przez Narodowy Bank Polski banków krajowych, oddziałów banków zagranicznych i oddziałów instytucji kredytowych do pełnienia funkcji Dealera Rynku Pieniężnego

Wybór przez NBP kontrahentów pełniących w danym roku kalendarzowym funkcję Dealera Rynku Pieniężnego (DRP) następuje spośród kandydatów, którzy zadeklarowali w poprzednim roku chęć wykonywania takiej funkcji i zostali poddani ocenie wg następujących kryteriów kwalifikacyjnych Indeksu Aktywności Dealerskiej (IAD):

I kryterium IAD - potencjał rozliczeniowy kandydata, mierzony wielkością obrotów na rachunku bieżącym w złotych prowadzonym w Departamencie Systemu Płatniczego NBP, z wyłączeniem rozliczeń przeprowadzanych przez Krajową Izbę Rozliczeniową SA,

II kryterium IAD - potencjał ofertowy kandydata, mierzony stanem bonów skarbowych i obligacji skarbowych oraz bonów pieniężnych NBP w portfelu własnym,

III kryterium IAD - aktywność kandydata na rynku niezabezpieczonych depozytów międzybankowych, mierzona wielkością depozytów złotych z terminem pierwotnym do jednego roku włącznie, złożonych i przyjętych od innych banków działających w Polsce,

IV kryterium IAD - aktywność kandydata na rynku operacji warunkowych, mierzona wartością transakcji repo, reverse repo, buy/sell/back i sell/buy/back w złotych, których zabezpieczenie stanowią bony skarbowe i obligacje skarbowe oraz bony pieniężne NBP,

V kryterium IAD - aktywność kandydata na rynku fx swap, mierzona wartością transakcji z udziałem złotego, z terminem pierwotnym do jednego roku włącznie,

VI kryterium IAD - aktywność kandydata na rynku instrumentów pochodnych krajowej stopy procentowej FRA i IRS, mierzona wartością transakcji nominowanych w złotych, z terminem pierwotnym do jednego roku włącznie,

VII kryterium IAD- aktywność kandydata na rynku instrumentów pochodnych krajowej stopy procentowej OIS, mierzona wartością transakcji z terminem pierwotnym do jednego roku włącznie, dla których stawką referencyjną jest stopa POLONIA.

Kandydaci do pełnienia funkcji DRP otrzymują punkty w ramach każdego z wyżej wymienionych kryteriów. Przyznawane punkty uzależnione są od udziału obrotów/stanów wykazywanych przez kandydata w łącznej wartości obrotów/stanów wszystkich kandydatów do pełnienia funkcji DRP.

W ocenie banków kandydujących do pełnienia funkcji DRP w 2014 r. NBP zwiększa – w porównaniu do wyboru DRP na rok 2013 – wagę kryteriów dotyczących aktywności banków w segmentach rynku finansowego wykorzystywanych do pozyskiwania finansowania. Dotyczy to następujących rynków: niezabezpieczonych lokat (pożyczek) międzybankowych (III kryterium IAD), transakcji zabezpieczonych repo oraz BSB/SBB (IV kryterium IAD) oraz swapów walutowych (V kryterium IAD.)

Ze względu na powyższe, maksymalna liczba możliwych do zdobycia punktów w ramach poszczególnych kryteriów ograniczona została do:

- 10,00 dla kryteriów I, II, VI i VII

W każdym z ww. kryteriów IAD liczba przyznanych punktów odpowiada udziałowi procentowemu obrotów/stanów danego banku w łącznej wartości obrotów/stanów wszystkich kandydatów do pełnienia funkcji DRP. Jednocześnie, kandydat uzyskuje maksymalnie 10,00 pkt za odpowiednie kryterium. Oznacza to, iż w przypadku udziału przekraczającego 10% łącznej wartości obrotów/stanów wszystkich kandydatów do pełnienia funkcji DRP, kandydat uzyska 10,00 pkt. W celu uzyskania punktów dla indywidualnych udziałów poniżej 10% należy je przemnożyć przez 100.

- 20,00 dla kryteriów III, IV i V

Punkty przyznawane są analogicznie jak w przypadku kryteriów I, II, VI i VII, z tym że dodatkowo są one przemnażane przez 2. Maksymalna liczba punktów możliwych do zdobycia w każdym z kryteriów III, IV i V wynosi 20,00 pkt.

Ustalanie udziałów i przyznawanie punktów odbywa się z dokładnością do dwóch miejsc po przecinku.

Dodatkowo, w ramach III kryterium IAD promowana będzie aktywność banków udzielających finansowania innym podmiotom na rynku lokat niezabezpieczonych na dłuższe okresy. W związku z tym transakcjom raportowanym przez podmioty udzielające finansowania przypisano wagi zależne od okresu zapadalności transakcji. Transakcje

raportowane przez podmioty pozyskujące finansowanie uwzględniane będą z kolei na dotychczasowych zasadach. W rezultacie, indywidualne udziały w obrotach będą obliczane jako suma indywidualnych transakcji przemnożonych przez odpowiednie wagi i podzielona przez wartość wszystkich transakcji zawartych na rynku niezabezpieczonych lokat międzybankowych, z uwzględnieniem wspomnianych wag.

Wartości wag dla lokat udzielonych i przyjętych przez podmiot o danym okresie zapadalności są następujące:

Okres zapadalności lokaty	Waga dla lokaty udzielonej	Waga dla lokaty przyjętej
Lokaty jednodniowe (O/N, T/N, S/N)	1	1
Lokaty do 1 tygodnia włącznie (z wyłączeniem O/N, T/N, S/N)	5	1
Lokaty powyżej 1 tygodnia do 1 miesiąca włącznie	13	1
Lokaty powyżej 1 miesiąca do 3 miesięcy włącznie	42	1
Lokaty powyżej 3 miesięcy do 6 miesięcy włącznie	95	1
Lokaty powyżej 6 miesięcy do 1 roku włącznie	189	1

Przykłady:

1. W przypadku, kiedy w kryterium I, II, VI, VII udział stanów/obrotów wykazywanych przez kandydata w łącznej wartości stanów wszystkich kandydatów do pełnienia funkcji DRP wynosi 4,73%, kandydat otrzymuje w ramach tego kryterium 4,73 pkt.
2. W przypadku, kiedy w kryterium I, II, VI, VII udział stanów/obrotów wykazywanych przez kandydata w łącznej wartości obrotów wszystkich kandydatów do pełnienia funkcji DRP wynosi 16,42%, kandydat otrzymuje w ramach tego kryterium 10,00 pkt.
3. W przypadku, kiedy w kryterium III (przy uwzględnieniu wag), IV lub V udział obrotów wykazywanych przez kandydata w łącznej wartości stanów wszystkich kandydatów do pełnienia funkcji DRP wynosi 4,73%, kandydat otrzymuje w ramach tego kryterium 9,46 pkt.

4. *W przypadku, kiedy w kryterium III (przy uwzględnieniu wag), IV lub V udział obrotów wykazywanych przez kandydata w łącznej wartości obrotów wszystkich kandydatów do pełnienia funkcji DRP wynosi 16,42%, kandydat otrzymuje w ramach tego kryterium 20,00 pkt.*

Maksymalna liczba punktów możliwa do uzyskania przez kandydata w ramach kryteriów

I – VII wynosi 100 pkt.