

**Zakres danych niezbędnych do oceny aktywności kandydatów do pełnienia funkcji Dealera Rynku Pieniężnego w 2018 r. (dane za wrzesień 2017 r.).**

Kandydaci, którzy zgłosili deklarację zamiaru pełnienia funkcji Dealera Rynku Pieniężnego (DRP) w 2018 r., zobowiązani są do przekazywania do Narodowego Banku Polskiego miesięcznych danych umożliwiających przeprowadzenie oceny ich aktywności na rynku pieniężnym i walutowym.

Dane za wrzesień 2017 r. podmioty kandydujące przekazują, z zastrzeżeniem danych o zawartych z bankami spółdzielczymi depozytach niezabezpieczonych, zgodnie z załącznikiem nr 8 uchwały nr 71/2016 Zarządu NBP z dnia 22 grudnia 2016 r. w sprawie trybu i szczegółowych zasad przekazywania przez banki do Narodowego Banku Polskiego danych niezbędnych do ustalania polityki pieniężnej i okresowych ocen sytuacji pieniężnej państwa oraz oceny sytuacji finansowej banków i ryzyka sektora bankowego (Dz. Urz. NBP z 2017 r. poz. 1). Są one określone w następujących wzorach: DE080, DE110, DE120, DE130, DE140, DE150, DE170, DE180, DE190, DE230, DE240.

W przypadku depozytów niezabezpieczonych zawieranych z bankami spółdzielczymi, dane raportowane są zgodnie z dołączonym na końcu załącznika wzorem formularza (o ile nie są to transakcje wykazane w systemie SORBNET2 jako depozyty zawarte przez rozliczający taką transakcję bank zrzeszający z bankiem raportującym). Dodatkowo w ramach depozytów zawieranych w obrębie danego zrzeszenia banków spółdzielczych raportowaniu podlegają wyłącznie transakcje nieobligatoryjne, o ile są one negocjowane i zawierane na warunkach rynkowych.

Kandydaci do pełnienia funkcji DRP zobowiązani są do przekazywania danych do końca dziesiątego dnia roboczego po upływie miesiąca, którego dane dotyczą.

Podmioty, które zgodnie z treścią uchwały nr 71/2016 Zarządu NBP z dnia 22 grudnia 2016 r. zobowiązane zostały do przekazywania ww. danych, przesyłają je drogą elektroniczną za pośrednictwem Portalu internetowego Systemu Informacji Sprawozdawczej do Departamentu Statystyki NBP.

Podmioty nieobjęte wymienioną uchwałą przekazują wybrane dane z ww. formularzy do NBP za pośrednictwem faksu na nr 22-185-22-35 lub na adres:

Narodowy Bank Polski  
Departament Operacji Krajowych  
ul. Świętokrzyska 11/21  
00-919 Warszawa

Kandydaci nieobjęci ww. uchwałą zobowiązani są do wypełniania wybranych pozycji z formularzy: DE080, DE110, DE120, DE130, DE140, DE150, DE170, DE180, DE190, DE230, DE240 i przesyłania ich do NBP, tj.:

**1. Stan obligacji skarbowych w portfelu własnym**

zgodnie z wzorem DE080 *Stan portfela własnego obligacji skarbowych wyemitowanych przez rezydenta według wartości nominalnej.*

**2. Obroty na rynku operacji warunkowych repo, reverse repo, buy-sell-back i sell-buy-back w złotych, których zabezpieczenie stanowią bony skarbowe i obligacje skarbowe oraz bony pieniężne NBP**

2.1. zgodnie z wzorem DE110 *Obroty na rynku operacji warunkowych repo, reverse repo zabezpieczonych instrumentami dłużnymi:*

- wiersz 1. Razem z wyłączeniem kolumn *Pozostałe instrumenty dłużne* (dla REPO i REVERSE REPO),
- wiersz 1.1. *Instytucje krajowe* z wyłączeniem kolumn *Pozostałe instrumenty dłużne* (dla REPO i REVERSE REPO),
- wiersz *w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych* z wyłączeniem kolumn *Pozostałe instrumenty dłużne* (dla REPO i REVERSE REPO),
- wiersz 1.2. *Instytucje krajów strefy euro i reszty świata* z wyłączeniem kolumn *Pozostałe instrumenty dłużne* (dla REPO i REVERSE REPO).

2.2. zgodnie z wzorem DE120 *Struktura terminowa obrotów na rynku operacji warunkowych repo, reverse repo zabezpieczonych instrumentami dłużnymi:*

- wszystkie wiersze z wyłączeniem kolumn *Pozostałe instrumenty dłużne* (dla REPO i REVERSE REPO).

2.3. zgodnie z wzorem DE130 *Obroty na rynku operacji warunkowych sell-buy-back, buy-sell-back zabezpieczonych instrumentami dłużnymi:*

- wiersz 1. Razem z wyłączeniem kolumn *Pozostałe instrumenty dłużne* (dla SELL-BUY-BACK i BUY-SELL-BACK),
- wiersz 1.1. *Instytucje krajowe* z wyłączeniem kolumn *Pozostałe instrumenty dłużne* (dla SELL-BUY-BACK i BUY-SELL-BACK)
- wiersz - *w tym banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych* z wyłączeniem kolumn *Pozostałe instrumenty dłużne* (dla SELL-BUY-BACK i BUY-SELL-BACK),
- wiersz 1.2. *Instytucje krajów strefy euro i reszty świata* z wyłączeniem kolumn *Pozostałe instrumenty dłużne* (dla SELL-BUY-BACK i BUY-SELL-BACK).

2.4. zgodnie z wzorem DE140 *Struktura terminowa obrotów na rynku operacji warunkowych sell-buy-back, buy-sell-back zabezpieczonych instrumentami dłużnymi:*

- wszystkie wiersze z wyłączeniem kolumn *Pozostałe instrumenty dłużne* (dla *SELL-BUY-BACK* i *BUY-SELL-BACK*),
3. **Obroty na rynku FX swap z udziałem złotego, z terminem pierwotnym do 1 roku włącznie**
- 3.1. zgodnie z wzorem DE230 *Obroty na rynku walutowym – wartość transakcji zawartych w segmencie walut obca - PLN*:
- kolumna *WALUTA OBCA-PLN* (ogółem) w zakresie wszystkich wierszy dotyczących transakcji FX swap.
- 3.2. zgodnie z wzorem DE240 *Struktura terminowa obrotów na rynku walutowym – wartość transakcji outright forward i FX swap zawartych w segmencie walut obca - PLN*:
- kolumna *WALUTA OBCA-PLN* (ogółem) w zakresie wszystkich wierszy dotyczących transakcji FX swap.
4. **Obroty na rynku instrumentów pochodnych krajowej stopy procentowej FRA i IRS nominowanych w złotych z terminem pierwotnym do 1 roku włącznie**
- 4.1. zgodnie z wzorem DE150 *Obroty na krajowym rynku pozagiełdowych instrumentów pochodnych według wartości nominalnej część I*:
- kolumna *Ogółem* w zakresie wszystkich wierszy dotyczących transakcji IRS,
  - kolumna *Ogółem* w zakresie wszystkich wierszy dotyczących transakcji FRA.
- 4.2. zgodnie z wzorem DE170 *Struktura terminowa obrotów na krajowym rynku pozagiełdowych instrumentów pochodnych – transakcje IRS według wartości nominalnej*.
- 4.3. zgodnie z wzorem DE190 *Struktura terminowa obrotów na krajowym rynku pozagiełdowych instrumentów pochodnych – transakcje FRA według wartości nominalnej*.
5. **Obroty na rynku instrumentów pochodnych krajowej stopy procentowej OIS z terminem pierwotnym do 1 roku włącznie, dla których stawką referencyjną jest stopa POLONIA**
- 5.1. zgodnie z wzorem DE150 *Obroty na krajowym rynku pozagiełdowych instrumentów pochodnych według wartości nominalnej część I*:
- kolumna *Ogółem* w zakresie wszystkich wierszy dotyczących transakcji OIS.
- 5.2. zgodnie z wzorem DE180 *Struktura terminowa obrotów na krajowym rynku pozagiełdowych instrumentów pochodnych – transakcje OIS, opcje walutowe i opcje na stopę procentową według wartości nominalnej*:
- kolumna *Transakcje OIS* (ogółem) w zakresie wszystkich wierszy dotyczących transakcji OIS,
  - kolumna *Transakcje OIS WIBOR* w zakresie wszystkich wierszy dotyczących transakcji OIS WIBOR,
  - kolumna *Transakcje OIS POLONIA* w zakresie wszystkich wierszy dotyczących transakcji OIS POLONIA.

Wzory formularzy DEXXX oraz instrukcja ich wypełniania znajdują się na stronie internetowej NBP:

[http://www.nbp.pl/home.aspx?f=/banki\\_w\\_polsce/drp/sprawozdania\\_kandydaci.html](http://www.nbp.pl/home.aspx?f=/banki_w_polsce/drp/sprawozdania_kandydaci.html)

**Wzór formularza do raportowania danych o depozytach niezabezpieczonych zawartych z bankami spółdzielczymi:**

Terminy depozytów	Niezabezpieczone depozyty międzybankowe złożone	Niezabezpieczone depozyty międzybankowe przyjęte
z terminem pierwotnym 1 dniowym (O/N, T/N, S/N)		
z terminem pierwotnym SW		
z terminem pierwotnym 2W		
z terminem pierwotnym 3W		
z terminem pierwotnym 1M		
z terminem pierwotnym 2M		
z terminem pierwotnym 3M		
z terminem pierwotnym 6M		
z terminem pierwotnym 9M		
z terminem pierwotnym 1Y		
pozostałe z terminem pierwotnym do 1 tygodnia		
pozostałe z terminem pierwotnym powyżej 1 tygodnia do 1M		
pozostałe z terminem pierwotnym powyżej 1M do 3M		
pozostałe z terminem pierwotnym powyżej 3M do 6M		
pozostałe z terminem pierwotnym powyżej 6M do 1Y		
<b>Razem</b>		