

### Zakres danych niezbędnych do oceny aktywności kandydatów do pełnienia funkcji Dealera Rynku Pieniężnego

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. Ocena dokonywana jest przez NBP na podstawie kryteriów Indeksu Aktywności Dealerskiej (IAD) zawartych w załączniku do uchwały nr 56/2010 Zarządu NBP z dnia 21 października 2010 r. w sprawie kryteriów uczestnictwa banków krajowych, oddziałów banków zagranicznych oraz oddziałów instytucji kredytowych w operacjach otwartego rynku prowadzonych przez Narodowy Bank Polski (Dz. Urz. NBP z 2015 r. poz. 12). Dane za okres październik 2016 r. – wrzesień 2017 r. podmioty kandydujące przekazują, z zastrzeżeniem danych o zawartych z bankami spółdzielczymi depozytach niezabezpieczonych, zgodnie z załącznikiem nr 2 uchwały nr 53/2011 Zarządu NBP z dnia 22 września 2011 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 Nr 14, poz. 15 z późn. zm.). Są one określone w następujących wzorach: M0008, M0010, M0011, M0012, M0014, M0015, M0016, M0018.

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 zrzeczający z bankiem raportującym). Dodatkowo w ramach depozytów zawieranych w obrębie danego zrzeczenia 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 53/2011 Zarządu NBP z dnia 22 września 2011 r. zobowiązane zostały do przekazywania ww. danych, przesyłają je tak jak dotychczas drogą elektroniczną do Departamentu Statystyki NBP (lista podmiotów w Załączniku 4).

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 M008, M0010-M0012, M0014-M0016, M0018 i przesyłania ich do NBP, tj.:

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

według wzoru M0008 *Stan portfela własnego obligacji skarbowych wyemitowanych przez rezydenta, nominowanych w PLN i walutach obcych wg 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**

według wzoru M0010 *Obroty na rynku operacji warunkowych repo, reverse repo zabezpieczonych instrumentami dłużnymi:*

- wiersz A1 *Instytucje krajowe z wyłączeniem kolumny D1 Pozostałe instrumenty dłużne i kolumny H1 Pozostałe instrumenty dłużne*
- wiersz C1 *w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych z wyłączeniem kolumny D1 Pozostałe instrumenty dłużne i kolumny H1 Pozostałe instrumenty dłużne*
- wiersz K1 *Instytucje krajów UGiW i reszty świata z wyłączeniem kolumny D1 Pozostałe instrumenty dłużne i kolumny H1 Pozostałe instrumenty dłużne,*
- wiersze od L1 *Terminy pierwotne transakcji REPO, REVERSE REPO – łącznie dla pkt 1 i 2 do T3 w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych z wyłączeniem kolumny D1 Pozostałe instrumenty dłużne i kolumny H1 Pozostałe instrumenty dłużne*

oraz

według wzoru M0011 *Obroty na rynku operacji warunkowych sell-buy-back,-buy-sell-back, zabezpieczonych instrumentami dłużnymi:*

- wiersz A1 *Instytucje krajowe z wyłączeniem kolumny D1 Pozostałe instrumenty dłużne i kolumny H1 Pozostałe instrumenty dłużne,*
- wiersz C1 *- w tym banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych z wyłączeniem kolumny D1 Pozostałe instrumenty dłużne i kolumny H1 Pozostałe instrumenty dłużne*
- wiersz K1 *Instytucje krajów UGiW i reszty świata z wyłączeniem kolumny D1 Pozostałe instrumenty dłużne i kolumny H1 Pozostałe instrumenty dłużne,*
- wiersze od L1 *Terminy pierwotne transakcji SELL-BUY-BACK,BUY-SELL-BACK – łącznie dla pkt 1 i 2 do T3 w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych z wyłączeniem kolumny D1 Pozostałe instrumenty dłużne i kolumny H1 Pozostałe instrumenty dłużne,*

**3. Obroty na rynku fx swap z udziałem złotego, z terminem pierwotnym do 1 roku łącznie**

według wzoru M0018 *Obroty na rynku walutowym – wartość transakcji zawartych przez podmiot sprawozdający w obszarze walut obca - PLN:*

- kolumna A1 ogółem wiersze od G1 *Fx swap* do I7 z pozostałymi instytucjami sektora finansowego.
- kolumna A1 ogółem wiersze od P1 *Terminy pierwotne transakcji fx swap* do U3 w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych).

#### 4. **Obroty na rynku instrumentów pochodnych krajowej stopy procentowej FRA i IRS nominowanych w złotych z pierwotnym terminem do 1 roku włącznie**

według wzoru M0012 *Obroty na krajowym rynku pozagiełdowych instrumentów pochodnych Cz. I wg wartości nominalnej*

- kolumna A1 *Kontrakty/opcje zakupione* wiersze od A1 *Kontrakty IRS* do C5 w tym – z monetarnymi instytucjami finansowymi/banki.
- kolumna B1 *Kontrakty/opcje sprzedane* wiersze od A1 *Kontrakty IRS* do C5 w tym – z monetarnymi instytucjami finansowymi/banki.
- kolumna A1 *Kontrakty/opcje zakupione* wiersze od G1 *Kontrakty FRA* do I5 w tym – z monetarnymi instytucjami finansowymi/banki.
- kolumna B1 *Kontrakty/opcje sprzedane* wiersze od G1 *Kontrakty FRA* do I5 w tym – z monetarnymi instytucjami finansowymi/banki.

oraz

według wzoru M0014 *Struktura terminowa obrotów na rynku pozagiełdowych instrumentów pochodnych – kontrakty IRS wg wartości nominalnej instrumentów*

oraz

według wzoru M0016 *Struktura terminowa obrotów na rynku pozagiełdowych instrumentów pochodnych – kontrakty FRA wg wartości nominalnej instrumentów,*

#### 5. **Obroty na rynku instrumentów pochodnych krajowej stopy procentowej OIS z terminem pierwotnym do 1 roku włącznie, dla których stawką referencyjną jest stopa POLONIA**

według wzoru M0012 *Obroty na krajowym rynku pozagiełdowych instrumentów pochodnych Cz. I wg wartości nominalnej*

- kolumna A1 *Kontrakty/opcje zakupione* wiersze od D1 *Kontrakty OIS* do F5 w tym – z monetarnymi instytucjami finansowymi/banki.
- kolumna B1 *Kontrakty/opcje sprzedane* wiersze od D1 *Kontrakty OIS* do F5 w tym – z monetarnymi instytucjami finansowymi/banki.

oraz

według wzoru M0015 *Struktura terminowa obrotów na rynku pozagiełdowych instrumentów pochodnych – kontrakty OIS, opcje walutowe (EUR/PLN, USD/PLN) i opcje na stopę procentową wg wartości nominalnej instrumentów*

- kolumna A1 *Kontrakty OIS WIBOR* wszystkie wiersze od A1 z *terminem pierwotnym do 1 miesiąca włącznie do H1 Razem*.
- kolumna B1 *Kontrakty OIS POLONIA* wszystkie wiersze od A1 z *terminem pierwotnym do 1 miesiąca włącznie do H1 Razem*.

Wzory formularzy MXXXX 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>		