

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 2019 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 2017 r. – wrzesień 2018 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 (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: 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

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		
Razem		