

ČESKÁ **ČNB** NÁRODNÍ BANKA

VĚSTNÍK

Částka 7

Ročník 2000

Vydáno dne 30. června 2000

O b s a h :

ČÁST OZNAMOVACÍ

5. Úřední sdělení České národní banky o vydání Pravidel pro referenční banky a výpočet (fixing) referenčních úrokových sazeb (PRIBID a PRIBOR)

ZMĚNA: (č.1) VĚSTNÍK ČNB 11/2000, ús. č. 8.

Třídící znak							
2	0	5	0	0	6	1	0

ÚŘEDNÍ SDĚLENÍ ČESKÉ NÁRODNÍ BANKY

o vydání

Pravidel pro referenční banky a výpočet (fixing) referenčních úrokových sazeb
(PRIBID a PRIBOR)

Česká národní banka vydává Pravidla pro referenční banky a výpočet (fixing) referenčních úrokových sazeb PRIBID a PRIBOR, která nabývají účinnosti 1. července 2000.

Znění Pravidel je uvedeno v příloze.

Vrchní ředitel
RNDr. Niedermayer, v.r.

Příloha: Pravidla pro referenční banky a výpočet (fixing) referenčních úrokových sazeb
(PRIBID a PRIBOR)

Odpovědný zaměstnanec:
Sekce bankovních obchodů
Mgr. Melišík, tel. 2441 5003

ČESKÁ NÁRODNÍ BANKA

PRAVIDLA
PRO REFERENČNÍ BANKY
A VÝPOČET (FIXING) REFERENČNÍCH ÚROKOVÝCH
SAZEB (PRIBID a PRIBOR)

červenec 2000

Obsah

- § 1 Vymezení pojmů
- § 2 Udělení statutu referenční banky
- § 3 Odebrání statutu referenční banky
- § 4 Práva a povinnosti referenčních bank
- § 5 Seznam referenčních bank
- § 6 Výpočet (fixing) referenčních úrokových sazeb (PRIBID a PRIBOR)
- § 7 Zveřejňování a dostupnost hodnot referenčních úrokových sazeb PRIBID a PRIBOR
- § 8 Zveřejňování a změny Pravidel
- § 9 Zrušovací ustanovení
- § 10 Účinnost

§ 1**Vymezení pojmů**

Pro účely Pravidel pro referenční banky a výpočet (fixing) referenčních úrokových sazeb (PRIBID a PRIBOR) (dále jen „Pravidla“) se pod následujícími pojmy rozumí:

- a) "Referenční banka" je banka, již byl udělen statut referenční banky podle § 2 Pravidel a která dodává data pro výpočet hodnot referenčních sazeb PRIBID a PRIBOR,
- b) "Kotace" je úroveň ceny, za kterou je banka referenční banka ochotna koupit (strana kotace bid) od jiné referenční banky mezibankovní depozitum nebo prodat (strana kotace offer) jiné referenční bance mezibankovní depozitum v souladu se standardními pravidly obchodování,
- c) "Kalkulační agent" je organizace pověřená Českou národní bankou ve spolupráci s The Financial Markets Association of the Czech Republic (A.C.I.) (dále jen „Czech Forex Club“) počítáním (fixingem) a zveřejňováním hodnot referenčních úrokových sazeb PRIBID a PRIBOR,
- d) "PRIBID" (Prague Interbank Bid Rate) je referenční hodnota úrokových sazeb na trhu mezibankovních depozit, kterou počítá (fixuje) kalkulační agent pro Českou národní banku a Czech Forex Club z kotací referenčních bank pro nákup depozit (bid) podle algoritmu uvedeného v § 6 Pravidel,
- e) "PRIBOR" (Prague Interbank Offered Rate) je referenční hodnota úrokových sazeb na trhu mezibankovních depozit, kterou počítá (fixuje) kalkulační agent pro Českou národní banku a Czech Forex Club z kotací referenčních bank pro prodej depozit (offer) podle algoritmu uvedeného v § 6 Pravidel.

§ 2**Udělení statutu referenční banky**

- (1) Písemnou žádost banky o udělení statutu referenční banky přijímá Czech Forex Club.
- (2) O udělení statutu referenční banky rozhoduje Czech Forex Club do 30 dnů po přijetí žádosti. Česká národní banka může vyslovit s jeho rozhodnutím nesouhlas.
- (3) Udělení statutu referenční banky bude oznámeno formou úředního sdělení České národní banky.

§ 3**Odebrání statutu referenční banky**

- (1) Czech Forex Club může referenční bance odebrat statut referenční banky po konzultaci s Českou národní bankou
 - a) na základě žádosti referenční banky,
 - b) v případě hrubého nebo opakovaného porušení standardních pravidel obchodování (Code of Conduct),
 - c) v případě neschopnosti splňovat podmínky podle § 4 odst. 3.
- (2) O odebrání statutu referenční banky rozhoduje Czech Forex Club. Česká národní banka může vyslovit s jeho rozhodnutím nesouhlas.
- (3) Odebrání statutu referenční banky bude oznámeno formou úředního sdělení České národní banky.

§ 4

Práva a povinnosti referenčních bank

- (1) Referenční banky se vyjadřují ke změnám algoritmu pro výpočet referenčních sazeb.
- (2) Referenční banky se vyjadřují k žádostem o udělení statutu a ke změnám ve složení referenčních bank.
- (3) Referenční banky mají povinnost dodávat data pro výpočet (fixing) hodnot referenčních sazeb PRIBID a PRIBOR v čase a formě určených kalkulačním agentem a splňovat technické a organizační podmínky kladené kalkulačním agentem.
- (4) Referenční banky musí být významnými účastníky mezibankovního trhu depozit a produktů odvozených od úrokových sazeb, a to i za rychle se měnících tržních podmínek.

§ 5

Seznam referenčních bank

Název referenční banky	Sídlo referenční banky
ABN AMRO BANK N. V., pobočka Praha	Lazarská 3, Praha 1
BNP-Dresdner Bank (ČR) a.s.	Vítězná 1, Praha 5
Citibank, a.s.	Evropská 178, Praha 6
Credit Lyonnais Bank Praha, a.s.	Ovocný trh 8, Praha 1
Bank Austria Creditanstalt Czech Republic, a.s.	Revoluční 7, Praha 1
Česká spořitelna, a.s.	Olbrachtova 1929/62, Praha 4
Československá obchodní banka, a.s.	Na Příkopě 14, Praha 1
Erste Bank Sparkassen (CR) a.s.	Václavské nám. 56, Praha 1
Deutsche bank, pobočka Praha	Jungmannova 34, Praha 1
ING Bank N.V., pobočka Praha	Pobřežní 3, Praha 8
Komerční banka, a.s.	Na Příkopě 33, Praha 1
SOCIETE GENERALE, pobočka Praha	Pobřežní 3, Praha 8
HypoVereinsbank a.s.	Italská 24, Praha 2
Commerzbank AG, pobočka Praha	Jugoslávská 1, Praha 2
Živnostenská banka, a.s.	Na Příkopě 20, Praha 1

§ 6

Výpočet (fixing) referenčních úrokových sazeb (PRIBID a PRIBOR)

- (1) Kotace pro výpočet hodnot sazeb PRIBID a PRIBOR jsou referenčními bankami dodávány kalkulačnímu agentovi každý pracovní den mezi 10:30 až 10:45 hod. místního času.
- (2) V době mezi 10:45 až 11:00 hod. místního času provádí kalkulační agent kontrolu formální správnosti dodaných kotací a případné nesrovnalosti řeší přímo s dotyčnou referenční bankou. Referenční banky mohou výjimečně své kotace v tomto čase ještě změnit, nejpozději však do 11:00 hod. místního času.
- (3) Výpočet (fixing) hodnot referenčních sazeb PRIBID a PRIBOR probíhá v 11:00 hod. místního času.

(4) Hodnoty referenčních sazeb PRIBID a PRIBOR se počítají jako matematický aritmetický průměr zaokrouhlený na dvě desetinná místa pro následující splatnosti: 1 den (O/N), 1, 2 týdny, 1, 2, 3, 6, 9 měsíců a 1 rok následujícím způsobem:

- (a) v případě, že kalkulační agent obdrží kotaci od jedenácti nebo více referenčních bank, bude sazba pro příslušnou splatnost aritmetickým průměrem sazeb po vyloučení dvou nejvyšších a dvou nejnižších sazeb,
- (b) v případě, že kalkulační agent obdrží přinejmenším šest, ale méně než jedenáct kotací, bude sazba pro příslušnou splatnost aritmetickým průměrem zbývajících sazeb po vyloučení jedné nejvyšší a jedné nejnižší sazby,
- (c) v případě, že kalkulační agent obdrží buď čtyři nebo pět kotací, bude sazba pro příslušnou splatnost aritmetickým průměrem všech těchto sazeb,
- (d) v případě, že kalkulační agent obdrží méně než čtyři kotace, sazba pro příslušnou splatnost nebude stanovena.

(5) Hodnoty referenčních sazeb PRIBID a PRIBOR (s výjimkou splatnosti O/N) jsou vypočítány (zafixovány) pro obchody, jejichž vypořádání proběhne druhý pracovní den po dni výpočtu (fixingu), s konvencí act/360.

(6) Hodnoty sazeb PRIBID a PRIBOR jsou po jejich vyhlášení konečné.

(7) Způsob výpočtu hodnot referenčních sazeb PRIBID a PRIBOR dle odstavců. 1 až 7 může měnit Czech Forex Club po konzultaci s Českou národní bankou. Česká národní banka může vyslovit s jeho rozhodnutím o změně způsobu výpočtu nesouhlas.

§ 7

Zveřejňování a dostupnost hodnot referenčních úrokových sazeb PRIBID a PRIBOR

Hodnoty sazeb PRIBID a PRIBOR společně s kotacemi jednotlivých referenčních bank budou zveřejněny bezprostředně po ukončení procedury výpočtu (fixingu) a budou dostupné např. v informačních systémech Telerate, Reuters, Bloomberg a na Internetu.

§ 8

Zveřejňování a změny Pravidel

(1) Tato Pravidla zveřejňuje Česká národní banka ve Věstníku ČNB formou úředního sdělení a prostřednictvím Internetu.

(2) Česká národní banka je oprávněna Pravidla měnit. Jejich změny zveřejňuje Česká národní banka ve Věstníku ČNB formou úředního sdělení a prostřednictvím Internetu.

(3) Při změnách Pravidel se referenčním bankám poskytne přiměřený čas k přizpůsobení jejich činností.

§ 9

Zrušovací ustanovení

Dnem 1. července 2000 pozbývají platnosti úřední sdělení České národní banky ze dne 31. října 1995 o vydání Pravidel pro udělení statutu referenční banky na trhu mezibankovních depozit uveřejněné ve Věstníku ČNB, částka 22/1995, úřední sdělení České národní banky ze dne

29. prosince 1995 o změně Pravidel pro udělení statutu referenční banky na trhu mezibankovních depozit uveřejněné ve Věstníku ČNB, částka 31/1995 a úřední sdělení České národní banky ze dne 13. září 1996 o změně Pravidel pro udělení statutu referenční banky na trhu mezibankovních depozit uveřejněné ve Věstníku ČNB, částka 13/1996.

§ 10
Účinnost

Tato Pravidla nabývají účinnosti dnem 1. července 2000.

V Praze dne 30. června 2000

RNDr. Luděk Niedermayer, v.r.
vrchní ředitel
a člen bankovní rady ČNB

Ing. Radek Urban, v.r.
ředitel sekce bankovních
obchodů ČNB