

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

Wybór przez Narodowy Bank Polski kontrahentów do pełnienia funkcji Dealera Rynku Pieniężnego następuje spośród kandydatów, którzy zadeklarowali chęć pełnienia tej funkcji oraz wykazali się aktywnością na rynku pieniężnym i walutowym, ocenianą według obiektywnych, jednolitych kryteriów kwalifikacyjnych Indeksu Aktywności Dealerskiej (IAD):

I kryterium IAD – ocena potencjału rozliczeniowego kandydata, mierzonego wielkością jego obrotów na rachunku bieżącym prowadzonym w Departamencie Systemu Płatniczego, z wyłączeniem rozliczeń przeprowadzanych przez Krajową Izbę Rozliczeniową S.A.

II kryterium IAD - ocena potencjału ofertowego kandydata, mierzonego średnimi stanami posiadanych przez niego bonów i obligacji skarbowych oraz bonów pieniężnych NBP, według ich wartości nominalnej.

III kryterium IAD - aktywność kandydata na międzybankowym rynku lokat, mierzona wartością lokat udzielonych i przyjętych, zarejestrowanych na rachunku bieżącym w Departamencie Systemu Płatniczego NBP .

IV kryterium IAD – aktywność kandydata na rynku transakcji repo i sell/buy/back, mierzona wartością zawartych przez niego transakcji repo i sell/buy/back na rynku bonów i obligacji skarbowych oraz bonów pieniężnych NBP, według wartości nominalnej papierów wartościowych, będących zabezpieczeniem tych transakcji.

V kryterium IAD – aktywność kandydata na rynku fx swap z udziałem PLN z terminem zapadalności do 1 roku, mierzona wartością tych transakcji, będących sumą płatności rozumianych jako wymiana kwot nominalnych, wynikających z zawartych przez kandydata transakcji .

VI kryterium IAD – aktywność kandydata na rynku transakcji pochodnych stopy procentowej nominowanych w PLN (FRA, IRS) z terminem zapadalności do 1 roku, mierzona wartością transakcji ustalonych jako suma wartości nominalnych (kwot bazowych) kontraktów zakupionych i sprzedanych przez kandydata .

VII kryterium IAD - aktywność kandydata na rynku transakcji pochodnych stopy procentowej OIS z terminem zapadalności do 1 roku, mierzona wartością transakcji, dla których stawką referencyjną jest stopa POLONIA, ustalonych jako suma wartości nominalnych (kwot bazowych) kontraktów zakupionych i sprzedanych przez kandydata na rynku międzybankowym (z wyłączeniem transakcji zawartych z podmiotami z tej samej grupy kapitałowej).

VIII kryterium IAD – dotyczy rzetelnego wypełniania przez bank obowiązków uczestnika rynku pieniężnego, do których należą:

- spełnianie procedur przeprowadzania i rozliczania operacji otwartego rynku,
- sprawne przeprowadzanie rozliczeń międzybankowych,
- wypełnianie obowiązków wynikających z uczestnictwa w centralnych rejestrach papierów wartościowych,
- aktywne uczestnictwo w fixingu stawki referencyjnej WIBOR, WIBID i POLONIA – jeżeli kandydat uczestniczy w fixingu tych stawek,
- codzienne informowanie NBP o aktualnej i prognozowanej przez kandydata sytuacji na rynku pieniężnym i walutowym,
- rzetelne i terminowe przesyłanie do NBP danych dotyczących rynku pieniężnego i walutowego.

Liczba punktów możliwa do uzyskania w ramach kryteriów I-VII będzie uzależniona od pozycji na liście, na której banki będą uszeregowane od najbardziej do najmniej aktywnych. W ramach każdego kryterium bank może uzyskać maksymalną liczbę punktów równą liczbie banków kandydujących, a przy całkowitym braku aktywności na danym rynku – 0 punktów.

Uzyskana w ramach kryteriów I-VII ocena punktowa IAD będzie - po upływie 12 miesięcy - pomniejszana z tytułu nie wywiązywania się banku z obowiązków uczestnika rynku pieniężnego oraz w razie nie przestrzegania obowiązujących procedur operacji otwartego rynku, o których mowa w kryterium VIII – maksymalnie o 30 punktów.