

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

Wybór przez NBP kontrahentów pełniących w danym roku kalendarzowym funkcję Dealera Rynku Pieniężnego (DRP) następuje spośród kandydatów, którzy zadeklarowali w poprzednim roku chęć wykonywania takiej funkcji i zostali poddani ocenie wg następujących kryteriów kwalifikacyjnych Indeksu Aktywności Dealerskiej (IAD):

I kryterium IAD - potencjał rozliczeniowy kandydata, mierzony wielkością obrotów na rachunku bieżącym w złotych prowadzonym w Departamencie Systemu Płatniczego NBP, z wyłączeniem rozliczeń przeprowadzanych przez Krajową Izbę Rozliczeniową S.A.

II kryterium IAD - potencjał ofertowy kandydata, mierzony stanem bonów skarbowych i obligacji skarbowych oraz bonów pieniężnych NBP w portfelu własnym.

III kryterium IAD - aktywność kandydata na rynku niezabezpieczonych depozytów międzybankowych, mierzona wielkością depozytów złotych z terminem pierwotnym do jednego roku włącznie, złożonych i przyjętych od innych banków działających w Polsce.

IV kryterium IAD - aktywność kandydata na rynku operacji warunkowych, mierzona wartością transakcji repo, reverse repo, buy/sell/back i sell/buy/back w złotych, których zabezpieczenie stanowią bony skarbowe i obligacje skarbowe oraz bony pieniężne NBP.

V kryterium IAD - aktywność kandydata na rynku fx swap, mierzona wartością transakcji zawartych z udziałem złotego, z terminem pierwotnym do jednego roku włącznie.

VI kryterium IAD - aktywność kandydata na rynku instrumentów pochodnych krajowej stopy procentowej FRA i IRS, mierzona wartością transakcji nominowanych w złotych, z terminem pierwotnym do jednego roku włącznie.

VII kryterium IAD- aktywność kandydata na rynku instrumentów pochodnych krajowej stopy procentowej OIS, mierzona wartością transakcji z terminem pierwotnym do jednego roku włącznie, dla których stawką referencyjną jest stopa POLONIA.

Kandydaci do pełnienia funkcji DRP otrzymują punkty w ramach każdego z wyżej wymienionych kryteriów. Przyznawane punkty odzwierciedlają procentowy udział obrotów/stanów wykazywanych przez kandydata w łącznej wartości obrotów/stanów wszystkich kandydatów do pełnienia funkcji DRP. Udziałowi procentowemu w każdym z kryteriów IAD odpowiada liczba przyznanych punktów. Maksymalna liczba możliwych do zdobycia punktów w ramach każdego z kryteriów ograniczona została do 10,00. Oznacza to, że w przypadku udziału przekraczającego 10% łącznej wartości obrotów/stanów wszystkich kandydatów do pełnienia funkcji DRP (w danym kryterium), kandydat uzyskuje 10,00 pkt. Ustalanie udziałów i przyznawanie punktów odbywa się z dokładnością do dwóch miejsc po przecinku.

Przykłady:

- 1. W przypadku, kiedy w kryterium II udział stanów wykazywanych przez kandydata w łącznej wartości stanów wszystkich kandydatów do pełnienia funkcji DRP wynosi 4,73%, kandydat otrzymuje w ramach tego kryterium 4,73 pkt.*
- 2. W przypadku, kiedy w kryterium III udział obrotów wykazywanych przez kandydata w łącznej wartości obrotów wszystkich kandydatów do pełnienia funkcji DRP wynosi 16,42%, kandydat otrzymuje w ramach tego kryterium 10,00 pkt.*

Maksymalna liczba punktów możliwa do uzyskania przez kandydata w ramach kryteriów I-VII wynosi 70 pkt.