

**Zakres danych niezbędnych do oceny aktywności
kandydatów do pełnienia funkcji Dealera Rynku Pieniężnego
(dane za listopad 2011 r. – grudzień 2011 r.)**

Kandydaci, którzy zgłosili deklarację zamiaru pełnienia funkcji Dealera Rynku Pieniężnego (DRP) w 2013 r., zobowiązani są do przekazywania do Narodowego Banku Polskiego miesięcznych danych umożliwiających przeprowadzenie oceny ich aktywności na rynku pieniężnym i walutowym.

Dane za listopad i grudzień 2011 r., podmioty kandydujące przekazują je zgodnie z załącznikiem nr 2 uchwały nr 23/2003 Zarządu NBP z dnia 25 lipca 2003 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 16, poz. 26, z późn. zm.), określone w następujących wzorach: M008, M009, M0010, M0011, M0014, M0015, M0016, M0017.

Kandydaci do pełnienia funkcji DRP zobowiązani są do przekazywania wskazanych wyżej danych do końca dziesiątego dnia roboczego po upływie miesiąca, którego dane dotyczą.

Podmioty, które zgodnie z treścią uchwały nr 23/2003 Zarządu NBP z dnia 25 lipca 2003 r., zobowiązane zostały do przekazywania ww. danych, przesyłają je tak jak dotychczas drogą elektroniczną do Departamentu Statystyki NBP.

Podmioty nieobjęte wymienionymi uchwałami przekazują wybrane dane z formularzy M0008-M0011 oraz M0014-M0017 do NBP za pośrednictwem faksu na nr 22-826-67-50 lub na adres:

*Narodowy Bank Polski
Departament Operacji Krajowych
ul. Świętokrzyska 11/21
00-919 Warszawa*

Kandydaci nieobjęci ww. uchwałami zobowiązani są do wypełniania wybranych pozycji z formularzy M008-M0011 oraz M0014-M0017.

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 niezabezpieczonych depozytów złotych międzybankowych z terminem pierwotnym do 1 roku łącznie

według wzoru M0009 *Obroty na rynku niezabezpieczonych depozytów międzybankowych oraz na rynku operacji warunkowych (repo, reverse repo, BSB i SBB) zabezpieczonych instrumentami dłużnymi wg terminów pierwotnych tych transakcji:*

- kolumna A1 *Niezabezpieczone depozyty międzybankowe złożone z wyłączeniem wiersza H1 powyżej 1 roku,*
- kolumna B1 *Niezabezpieczone depozyty międzybankowe przyjęte z wyłączeniem wiersza H1 powyżej 1 roku,*

3. 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 wg kategorii kontrahenta:*

- wiersz A1 *Instytucje krajowe 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,*

oraz

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

- wiersz A1 *Instytucje krajowe 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,*

4. Obroty na rynku fx swap z udziałem złotego, z terminem pierwotnym do 1 roku włącznie

według wzoru M0017 *Obroty na rynku walutowym – wartość transakcji zawartych przez podmiot sprawozdający*:

- kolumna E1 *Waluta obca-PLN ogółem* wiersze od P1 do T1 (wiersz P1 *Terminy pierwotne transakcji fx swap*, wiersz Q1 *Do 1 tygodnia włącznie*, wiersz R1 *Powyżej 1 tygodnia do 1 miesiąca włącznie*, wiersz S1 *Powyżej 1 do 3 miesięcy włącznie*, wiersz T1 *Powyżej 3 miesięcy do 1 roku włącznie*).

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

według wzoru M0016 *Struktura terminowa obrotów na rynku pozagiełdowych instrumentów pochodnych – kontrakty FRA wg wartości nominalnej instrumentów*, z wyłączeniem wiersza O1 *pozostałe z terminem pierwotnym powyżej 1 roku*

oraz

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

- kolumna A1 *Kontrakty IRS* wiersz A1 *z terminem pierwotnym do 1 roku włącznie*.

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

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 B1 *Kontrakty OIS POLONIA* z wyłączeniem wiersza G1 *powyżej 1 roku*.

Wzory formularzy oraz instrukcja ich wypełniania znajdują się na stronie internetowej NBP

http://www.nbp.pl/home.aspx?f=/banki_w_polsce/drp/sprawozdania_kandydaci_2013.html