

Třídící znak							
2	0	6	1	3	6	1	0

ÚŘEDNÍ SDĚLENÍ ČESKÉ NÁRODNÍ BANKY

ze dne 8. srpna 2013

o vydání čtvrté verze

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

- I. Česká národní banka sděluje, že vydává čtvrtou verzi Pravidel pro referenční banky a výpočet (fixing) referenčních úrokových sazeb (PRIBID a PRIBOR), (dále jen „Pravidla“).
- II. Pravidla tvoří přílohu tohoto úředního sdělení.
- III. Dnem 1. října 2013 se zrušuje úřední sdělení České národní banky ze dne 18. dubna 2006 o vydání třetí verze Pravidel pro referenční banky a výpočet (fixing) referenčních úrokových sazeb (PRIBID a PRIBOR), uveřejněné ve Věstníku ČNB, částka 3/2006 dne 27. dubna 2006.
- IV. Podle Pravidel vydaných tímto úředním sdělením se postupuje od 1. října 2013

Viceguvernér

Ing. Mojmír Hampl, MSc., Ph.D. v. r.

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

Sekce bankovních obchodů
Odpovědný zaměstnanec:
Ing. Jiří Zavadil, tel. 224 415 003

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

říjen 2013

Obsah

I. Vymezení pojmů.....	3
II. Udělení statutu referenční banky.....	3
III. Odebrání statutu referenční banky.....	4
IV. Práva a povinnosti referenčních bank.....	4
V. Seznam referenčních bank.....	5
VI. Výpočet (fixing) referenčních úrokových sazeb (PRIBID a PRIBOR).....	5
VII. Zveřejňování a dostupnost hodnot referenčních úrokových sazeb PRIBID a PRIBOR....	5
VIII. Zveřejňování a změny Pravidel.....	6
IX. Účinnost.....	6

I. 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 části II. Pravidel a která dodává data pro výpočet hodnot referenčních sazeb PRIBID a PRIBOR,
- b) „kotace“ je úroveň ceny, za kterou jsou podle informací získaných referenční bankou při použití odborné péče referenční banky ochotny koupit (strana kotace bid) od jiné referenční banky mezibankovní depozitum nebo prodat (strana kotace offer) jiné referenční bance mezibankovní depozitum. Tyto informace zahrnují především ceny vlastních depozitních obchodů provedených referenční bankou, a pokud tyto nebyly uskutečněny, jedná se o odborný odhad těchto cen při použití odborné péče a znalosti trhu,
- c) „kalkulační agent“ je organizace pověřená 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 Czech Forex Club z kotací referenčních bank pro nákup depozit (bid) podle algoritmu uvedeného v části VI. Pravidel,
- e) „PRIBOR“ (Prague Interbank Offered Rate) je referenční hodnota úrokových sazeb na trhu mezibankovních depozit, kterou počítá (fixuje) kalkulační agent pro Czech Forex Club z kotací referenčních bank pro prodej depozit (offer) podle algoritmu uvedeného v části VI. Pravidel.

II. Udělení statutu referenční banky

1. Písemnou žádost o udělení statutu referenční banky zasílá banka Czech Forex Clubu. Součástí žádosti musí být prohlášení, že uchazeč je schopen a ochoten plnit povinnosti zakotvené v těchto Pravidlech a přistupuje k nim.

2. O udělení statutu referenční banky rozhoduje Czech Forex Club po konzultaci s Českou národní bankou a stávajícími referenčními bankami do 60 dnů po obdržení žádosti. Na udělení statutu referenční banky není nárok a Czech Forex Club není povinen zamítnutí žádosti žadateli zdůvodňovat.

3. Rozhodnutí o udělení statutu referenční banky oznámí Czech Forex Club do 3 dnů po přijetí rozhodnutí žadateli písemně, včetně data, od kdy má dodávat data pro výpočet hodnot referenčních sazeb PRIBID a PRIBOR.

4. O udělení statutu referenční banky s uvedením data, od kdy začíná nově přijatá banka dodávat data pro výpočet hodnot referenčních sazeb PRIBID a PRIBOR, informuje Czech Forex Club písemně všechny ostatní referenční banky, kalkulačního agenta a ČNB, a to do 3 dnů po přijetí rozhodnutí.

III. 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 (The International Code of Conduct and Practice for the Financial Markets¹) v jejich aktuálním znění,
- c) v případě neschopnosti splňovat podmínky Pravidel,
- d) v případě hrubého nebo opakovaného porušení Pravidel.

2. O odebrání statutu referenční banky rozhoduje Czech Forex Club a je povinen ho zdůvodnit. Pokud rozhoduje Czech Forex Club o odebrání statutu referenční banky na základě žádosti referenční banky, je povinen rozhodnout do 30 dnů od obdržení žádosti.

3. Rozhodnutí o odebrání statutu referenční banky oznámí Czech Forex Club bance písemně, do 3 dnů po přijetí rozhodnutí. Rozhodnutí je účinné od data uvedeného v oznámení a není proti němu odvolání.

4. O odebrání statutu referenční banky s uvedením data, od kdy odebrání statutu platí, informuje Czech Forex Club písemně všechny ostatní referenční banky, kalkulačního agenta a ČNB, a to do 3 dnů po přijetí rozhodnutí.

IV. Práva a povinnosti referenčních bank

1. Referenční banky se vyjadřují ke změnám algoritmu pro výpočet referenčních sazeb a mají právo tyto změny Czech Forex Clubu navrhnout.

2. Referenční banky se vyjadřují k žádostem o udělení statutu referenční banky a ke změnám ve složení referenčních bank.

3. Referenční banky se vyjadřují k výběru kalkulačního agenta.

4. Referenční banky mají povinnost proces vytváření a poskytování kotací upravit vnitřním předpisem.

5. Referenční banky mají povinnost nastavit účinný mechanismus kontroly procesu vytváření a poskytování kotací.

6. Referenční banky mají povinnost dodávat data pro výpočet (fixing) hodnot referenčních sazeb PRIBID a PRIBOR v čase a formě určených Pravidly a splňovat technické a organizační podmínky stanovené kalkulačním agentem.

7. Referenční banky jsou povinny dodržovat Pravidla.

8. Referenční banky jsou v souvislosti s těmito Pravidly povinny poskytovat řádnou součinnost kalkulačnímu agentovi, Czech Forex Clubu a České národní bance.

¹ http://www.aciforex.org/docs/misc/20130222_ACI_The_New_Model_Code_Feb_2013.pdf

V. Seznam referenčních bank

1. Seznam referenčních bank zveřejňuje vhodným způsobem Česká národní banka. Seznam referenčních bank obsahuje zejména název a sídlo referenčních bank.

2. Referenční banky souhlasí s uvedením v seznamu referenčních bank.

VI. 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. Tím není dotčena možnost, aby kalkulační agent provedl nejpozději do 12:00 hod. místního času opravu své zjevné chyby.

7. Způsob výpočtu hodnot referenčních sazeb PRIBID a PRIBOR dle odstavců 1 až 6 může měnit Czech Forex Club po konzultaci s Českou národní bankou, referenčními bankami a kalkulačním agentem.

VII. 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 Reuters, Bloomberg a dále způsobem umožňujícím dálkový přístup (prostřednictvím Internetu).

VIII. Zveřejňování a změny Pravidel

1. Tato Pravidla a veškeré jejich změny zveřejňuje Česká národní banka ve Věstníku ČNB formou úředního sdělení a dále způsobem umožňujícím dálkový přístup (prostřednictvím Internetu).

2. Česká národní banka je oprávněna po dohodě s Czech Forex Clubem Pravidla měnit a doplňovat. Změny nebo doplnění Pravidel zveřejňuje Česká národní banka ve Věstníku ČNB formou úředního sdělení a dále způsobem umožňujícím dálkový přístup (prostřednictvím Internetu).

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

IX. Účinnost

Tato Pravidla nabývají účinnosti dne 1. října 2013.