

**Regulamin  
z dnia 6 grudnia 2002 r.  
pełnienia funkcji  
Dealera Skarbowych Papierów Wartościowych**

*W celu poprawy płynności, przejrzystości oraz efektywności rynku skarbowych papierów wartościowych, realizując cel nakreślony w przyjętej przez Radę Ministrów i przedłożonej Sejmowi „Strategii zarządzania długiem sektora finansów publicznych na lata 2003-2005” Ministerstwo Finansów przy współudziale Narodowego Banku Polskiego, Krajowego Depozytu Papierów Wartościowych S.A. oraz środowiska bankowego opracowało System Dealerów Skarbowych Papierów Wartościowych. Kształtuje on, poprzez wyodrębnienie grupy banków - Dealerów Skarbowych Papierów Wartościowych, nową organizację systemu sprzedaży i obrotu skarbowymi papierami wartościowymi. Każdy z banków uczestniczących w procesie selekcji opisanym w niniejszym Regulaminie zostanie wzięty pod uwagę jako uczestnik Systemu Dealerów Skarbowych Papierów Wartościowych. Wybór banków zostanie dokonany z uwzględnieniem oceny uzyskanej w procedurze selekcyjnej opisanej w regulaminie.*

**I. Postanowienia ogólne.**

§ 1. Regulamin określa zasady pełnienia funkcji Dealerów Skarbowych Papierów Wartościowych, w szczególności:

- 1) obowiązki i uprawnienia Dealerów Skarbowych Papierów Wartościowych,
- 2) obowiązki i uprawnienia Ministra Finansów,
- 3) zasady wyboru Dealerów Skarbowych Papierów Wartościowych.

§.2 Ilekroć w Regulaminie jest mowa o :

- 1) Emitent - rozumie się przez to Ministra Finansów,
- 2) NBP – Narodowy Bank Polski,
- 3) DSPW - rozumie się przez to Dealerów Skarbowych Papierów Wartościowych,
- 4) SPW- rozumie się przez to skarbowe papiery wartościowe oferowane na rynku pierwotnym na przetargach organizowanych przez NBP w imieniu Emitenta, a także obligacje skarbowe o nazwach skróconych: CK0403, PK0704, DK0809,
- 5) Zorganizowany elektroniczny rynek wtórny - rozumie się przez to formę elektronicznego obrotu SPW wskazaną przez Emitenta,
- 6) IAD - rozumie się przez to Indeks Aktywności Dealerskiej,
- 7) Fixing SPW - rozumie się przez to działania podejmowane w celu ustalenia kursu fixingowego i informacyjnego dla ofert kupna i sprzedaży zgodnie z Regulaminem Fixingu SPW określonym przez NBP w porozumieniu z Emitentem,
- 8) Kurs fixingowy – rozumie się przez to cenę średnią ustaloną dla każdego SPW będącego przedmiotem fixingu, zgodnie z Regulaminem Fixingu SPW,
- 9) Kurs informacyjny - rozumie się przez to cenę kupna i sprzedaży ustaloną w dla każdego SPW będącego przedmiotem fixingu zgodnie z Regulaminem Fixingu SPW,
- 10) Emisje bazowe – rozumie się przez to określone przez Emitenta, po zasięgnięciu opinii Rady Uczestników Rynku SPW, emisje SPW, w szczególności dotyczące obligacji o stałym dochodzie i terminie wykupu nie krótszym niż jeden rok oraz wartości nominalnej nie mniejszej 2,5 mld zł,
- 11) Rada Uczestników Rynku SPW – rozumie się przez to zespół, w skład którego wchodzi przedstawiciele DSPW, NBP oraz KDPW S.A. Rada jest zespołem opiniotawczo-doradczym funkcjonującym przy Ministrze Finansów,

- 12) FRA (Forward Rate Agreement) – transakcje służące zabezpieczeniu stopy procentowej,
- 13) IRS (Interest Rate Swap) – transakcja polegająca na wymianie płatności odsetkowych w jednej walucie pomiędzy dwoma partnerami,
- 14) Transakcje anonimowe – rozumie się przez to transakcje zawierane w trybie automatycznego kojarzenia dyspozycji kupna i sprzedaży na zorganizowanym elektronicznym rynku wtórnym SPW.

## **II. Obowiązki i uprawnienia DSPW.**

§ 3.1. DSPW są zobowiązani do uczestniczenia we wszystkich przetargach SPW organizowanych przez NBP w imieniu Emitenta.

2. DSPW są zobowiązani nabyć w ciągu kwartału nie mniej niż:

- a) 2 % wartości nominalnej obligacji skarbowych sprzedanych w ciągu kwartału,
- b) 2% wartości nominalnej bonów skarbowych sprzedanych w ciągu kwartału.

3. Niespełnienie jednego z warunków, o których mowa ust. 2, skutkuje pomniejszeniem oceny pośredniej danego DSPW, o której mowa w § 10, o od 1 do 5 punktów. Ponowne nie spełnienie tych warunków w jednym z kolejnych okresów oceny pośredniej skutkuje ponownym pomniejszeniem oceny pośredniej o od 1 do 5 punktów oraz może skutkować wypowiedzeniem przez Emitenta umowy o pełnienie funkcji DSPW w trybie natychmiastowym.

§ 4.1 DSPW są zobowiązani do uczestniczenia w codziennych sesjach fixingowych SPW, organizowanych przez NBP, w celu wyznaczania kursów fixingowych i informacyjnych SPW, zgodnie z Regulaminem Fixingu SPW.

2. Lista SPW objętych fixingiem jest ustalana przez Emitenta.

3. Brak kwotowania SPW w sesji fixingowej może skutkować nałożeniem upomnienia przez Emitenta. Każdorazowe upomnienie powoduje pomniejszenie oceny pośredniej danego DSPW o 1-2 punkty.

§ 5.1. DSPW są zobowiązani do kwotowania SPW, od godz. 9.00 do godz. 16.00, na zorganizowanym elektronicznym rynku wtórnym, poprzez podawanie cen kupna i sprzedaży za każde 100 zł wartości nominalnej, w szczególności emisji bazowych obligacji skarbowych.

2. DSPW są zobowiązani do zawierania transakcji na rynku wtórnym zgodnie z przyjętą ceną podaną w sposób, o którym mowa w ust. 1, oraz o wartości nominalnej podanej w kwotowaniu.

3. Emitent może określić maksymalny *spread* dla emisji bazowych obligacji skarbowych. W takim przypadku DSPW będą zobowiązani kwotować emisje bazowe obligacji skarbowych nie przekraczając *spread*'u określonego przez Emitenta. *Spread* liczony jest jako punkt bazowy (z dokładnością do jednego grosza) ceny za każde 100 zł wartości nominalnej SPW.

4. Wartość nominalna kwotowania dla emisji bazowych oraz pozostałych emisji obligacji skarbowych jest wielokrotnością 5 mln zł.

5. Informacja o kwotowaniach jest dostępna w czasie rzeczywistym na zorganizowanym elektronicznym rynku wtórnym i może być zamieszczana w serwisach informacyjnych w trybie określonym przez Emitenta w uzgodnieniu z Radą Uczestników Rynku SPW.

§ 6. DSPW są obowiązani do:

- 1) przesyłania do Krajowego Depozytu Papierów Wartościowych S. A. instrukcji rozliczeniowych umożliwiających sporządzanie przez Krajowy Depozyt Papierów Wartościowych S.A. raportów, określonych w załącznikach nr 1.1.-1.4 do Regulaminu,

- 2) przesyłania do NBP raportów, określonych w załączniku nr 2 do Regulaminu, dotyczących działań banku na rynku finansowym,
- 3) rzetelnego wypełniania obowiązków wynikających z uczestnictwa w systemach depozytowo-rozliczeniowych,
- 4) współpracy z Emitentem w zakresie budowy przejrzystego i efektywnego rynku SPW, w tym rynku repo,
- 5) działania na rzecz rozszerzania udziału inwestorów krajowych nie będących bankami,
- 6) promowania rynku SPW oraz innych instrumentów dłużnych.

§ 7. DSPW są uprawnieni do:

- 1) wyłącznego składania ofert na wszystkich przetargach SPW organizowanych przez NBP w imieniu Ministra Finansów, z zastrzeżeniem § 21,
- 2) zakupów (wyłącznie ci DSPW, których oferty zostały przyjęte na przetargu), na przetargu uzupełniającym, o którym mowa w rozporządzeniu Ministra Finansów z dnia 26 kwietnia 1999 r. w sprawie warunków emitowania obligacji skarbowych oferowanych na przetargach (Dz. U. Nr 38, poz. 368 z późn. zm.) oraz rozporządzeniu Ministra Finansów z dnia 26 sierpnia 1999 r. w sprawie warunków emitowania bonów skarbowych (Dz. U. Nr 74, poz. 831 z późn. zm), na zasadach i warunkach w nich określonych.
- 3) regularnego uczestniczenia w spotkaniach z przedstawicielami Emitenta w celu:
  - a) rozwiązywania problemów merytorycznych oraz organizacyjno-technicznych związanych z organizacją i funkcjonowaniem rynku SPW,
  - b) omawiania polityki emisyjnej, planów finansowania potrzeb pożyczkowych budżetu państwa, koniunktury na rynkach finansowych,
- 4) przeprowadzania indywidualnych operacji z Emitentem, w szczególności zawierania transakcji warunkowych typu repo oraz buy-sell-back i innych,
- 5) wyłącznego uczestniczenia w codziennych sesjach fixingowych SPW.

§ 8. DSPW w okresie obowiązywania umowy o pełnienie funkcji DSPW przysługuje wyłączne prawo do używania tytułu „Dealer Skarbowych Papierów Wartościowych”.

### **III. Obowiązki i uprawnienia Emitenta.**

§ 9.1. Emitent zobowiązany jest do sporządzania wykazów emisji bazowych obligacji skarbowych, ustalania odpowiadających im maksymalnych *spread'ów* oraz sporządzania wykazu SPW objętych fixingiem i podawania, co najmniej raz w roku, tych informacji do wiadomości publicznej w sposób, o którym mowa w § 20.

2. Wykaz emisji bazowych obligacji skarbowych, maksymalne *spread'y* oraz wykaz SPW objętych fixingiem określa Emitent po uprzednim zasięgnięciu opinii Rady Uczestników Rynku SPW.

3. Emitent zobowiązany jest do podawania do wiadomości publicznej kalendarza emisji co najmniej raz w roku.

§ 10. Emitent jest uprawniony do dokonywania corocznej oraz pośredniej oceny wykonywania funkcji DSPW, według kryteriów określonych w dziale IV Regulaminu, które są podstawą do zawarcia umowy o pełnienie funkcji DSPW na jeden rok. Ocena pośrednia jest przeprowadzana co kwartał.

§ 11. Emitent oraz NBP, na podstawie udzielonego mu w umowie o pełnienie funkcji DSPW upoważnienia, ma prawo do dokonania, w siedzibie Banku, weryfikacji informacji i danych przekazywanych Emitentowi w związku z pełnieniem funkcji DSPW. Niezależnie od tego,

DSPW upoważnia Emitenta do podejmowania innych, uznanych przez Emitenta za niezbędne, czynności weryfikacyjno-kontrolnych, dotyczących działań DSPW związanych z wykonywaniem funkcji DSPW.

§ 12.1. W przypadku uchybień w wykonywaniu postanowień Regulaminu w sprawie pełnienia funkcji DSPW, Emitent może nakładać na DSPW upomnienia. Każdorazowe nałożenie upomnienia oznacza pomniejszenie pośredniej oceny DSPW o 1-2 punkty.

2. W razie rażących uchybień w wypełnianiu funkcji DSPW, Emitent może pozbawić funkcji DSPW, poprzez wypowiedzenie umowy w trybie natychmiastowym. Informacje o wykluczeniu poszczególnych podmiotów z systemu DSPW będą podawane przez Emitenta do wiadomości publicznej w sposób, o którym mowa w § 20.

3. W przypadku wypowiedzenia umowy w trybie natychmiastowym Emitent może podpisać umowę o pełnienie funkcji DSPW z bankiem, który osiągnął największą liczbę punktów w ostatnim konkursie na DSPW spośród banków, które nie uzyskały statusu DSPW. Umowa z tym bankiem zostanie zawarta jest na okres do końca roku kalendarzowego.

#### **IV. Zasady wyboru DSPW.**

§ 13.1. Emitent organizuje konkurs, w którym uczestniczą banki ubiegające się o funkcję DSPW.

2. Funkcję DSPW mogą pełnić jedynie banki spełniające łącznie następujące warunki:

- 1) uczestniczą w systemie rezerwy obowiązkowej, stabilne i bezpieczne finansowo, podległe krajowemu nadzorowi Komisji Nadzoru Bankowego, posiadające odpowiedni potencjał rozliczeniowy i ofertowy, działające w Polsce, dla których NBP, na mocy zawartych umów prowadzi bieżące rachunki bankowe,
- 2) są posiadaczami rachunków i kont depozytowych bonów skarbowych prowadzonych w NBP oraz rachunków i kont depozytowych prowadzonych w KDPW S.A..

§ 14.1. Bank, który zamierza ubiegać się o uzyskanie statusu DSPW, powinien przedłożyć pisemną deklarację Emitentowi, według wzoru stanowiącego załącznik nr 3 do Regulaminu, w terminie wskazanym przez Emitenta.

2. Deklaracja, o której mowa w ust. 1, jest podstawą rozpoczęcia oceny banków, ubiegających się o status DSPW i oznacza przyjęcie zobowiązań, o których mowa w § 5 - § 6 oraz akceptację postanowień § 10 - § 12 ust. 1 Regulaminu.

§ 15. Każdy z banków, który złożył deklarację uczestnictwa w systemie DSPW oraz DSPW podlega ocenie według kryteriów kwalifikacyjnych IAD, określonych w § 16 - § 18 Regulaminu.

§ 16. Podstawą punktowej oceny IAD jest udział:

1) obrotów na rachunku bieżącym każdego DSPW oraz kandydata na DSPW w obrotach ogółem na rachunkach bieżących wszystkich banków prowadzonych w Departamencie Systemu Płatniczego NBP, z wyłączeniem rozliczeń przeprowadzanych przez Krajową Izbę Rozliczeniową S.A.; 5 banków z najwyższym udziałem w rozliczeniach otrzyma po 5 punktów, następne 5 banków – po 3 punkty oraz kolejne 5 banków – po 1 punkcie;

2) wartości nominalnej obrotów zrealizowanych przez bank na rynku wtórnym bonów skarbowych w stosunku do łącznej wartości nominalnej obrotów brutto bonów zrealizowanej przez DSPW oraz kandydatów na DSPW. Ocena punktowa będzie dokonywana według następującej skali:

- a) powyżej 0% do 2% włącznie – 1 punkt,
- b) powyżej 2% do 4% włącznie – 2 punkty,
- c) powyżej 4% do 6% włącznie – 3 punkty,
- d) powyżej 6% do 8% włącznie – 4 punkty,

- e) powyżej 8% do 10% włącznie – 5 punkty,
  - f) powyżej 10% – 6 punktów;
- 3) wartości nominalnej obrotów bonami skarbowymi zrealizowanych przez bank w ramach transakcji anonimowych na zorganizowanym elektronicznym rynku wtórnym w stosunku do łącznej wartości nominalnej obrotów brutto bonów zrealizowanych przez DSPW oraz kandydatów na DSPW na zorganizowanym elektronicznym rynku wtórnym. Ocena punktowa będzie dokonywana według następującej skali:
- g) powyżej 0% do 2% włącznie – 2 punkty,
  - h) powyżej 2% do 4% włącznie – 4 punkty,
  - i) powyżej 4% do 6% włącznie – 6 punktów,
  - j) powyżej 6% do 8% włącznie – 8 punktów,
  - k) powyżej 8% do 10% włącznie – 10 punktów,
  - l) powyżej 10% – 12 punktów;
- 4) wartości nominalnej obrotów obligacjami skarbowymi zrealizowanych przez bank na rynku wtórnym obligacji w stosunku do łącznej wartości nominalnej obrotów brutto obligacji skarbowych zrealizowanych przez DSPW oraz kandydatów na DSPW. Ocena punktowa jest dokonywana według następującej skali:
- a) powyżej 0% do 2% włącznie - 3 punkty,
  - b) powyżej 2% do 4% włącznie – 5 punktów,
  - c) powyżej 4% do 6% włącznie – 7 punktów,
  - d) powyżej 6% do 8% włącznie – 9 punktów,
  - e) powyżej 8% do 10% włącznie – 11 punktów,
  - f) powyżej 10%– 13 punktów;
- 5) wartości nominalnej obrotów obligacjami skarbowymi zrealizowanych przez bank w ramach transakcji anonimowych na zorganizowanym elektronicznym rynku wtórnym w stosunku do łącznej wartości nominalnej obrotów brutto obligacji skarbowych zrealizowanych przez DSPW oraz kandydatów na DSPW na zorganizowanym elektronicznym rynku wtórnym. Ocena punktowa jest dokonywana według następującej skali:
- a) powyżej 0% do 2% włącznie - 6 punktów
  - b) powyżej 2% do 4% włącznie – 10 punktów
  - c) powyżej 4% do 6% włącznie – 14 punktów
  - d) powyżej 6% do 8% włącznie – 18 punktów
  - e) powyżej 8% do 10% włącznie – 22 punkty
  - f) powyżej 10% – 26 punktów;
- 6) wartości nominalnej bonów skarbowych sprzedanych i zakupionych w transakcjach banku z rezydentami nie będącymi bankami w stosunku do łącznej wartości nominalnej takich transakcji zrealizowanych przez DSPW oraz kandydatów na DSPW. Ocena punktowa jest dokonywana według następującej skali:
- a) powyżej 0% do 1% włącznie - 1 punkt,
  - b) powyżej 1% do 2% włącznie – 2 punkty,
  - c) powyżej 2% do 3% włącznie – 3 punkty,
  - d) powyżej 3% do 4% włącznie – 4 punkty,
  - e) powyżej 4% do 5% włącznie – 5 punktów,
  - f) powyżej 5% do 6% włącznie – 6 punktów,
  - g) powyżej 6% do 7% włącznie – 7 punktów,
  - h) powyżej 7% – 8 punktów;
- 7) wartości nominalnej obligacji skarbowych sprzedanych i zakupionych w transakcjach banku z rezydentami nie będącymi bankami w stosunku do łącznej wartości nominalnej takich transakcji zrealizowanych przez DSPW oraz kandydatów na DSPW. Ocena punktowa jest dokonywana według następującej skali:

- a) powyżej 0% do 1% włącznie - 2 punkty,
  - b) powyżej 1% do 2% włącznie – 4 punkty,
  - c) powyżej 2% do 3% włącznie – 6 punktów,
  - d) powyżej 3% do 4% włącznie – 8 punktów,
  - e) powyżej 4% do 5% włącznie – 10 punktów,
  - f) powyżej 5% – 12 punktów;
- 8) wartości nominalnej obrotów zrealizowanych przez bank na rynku instrumentów pochodnych stopy procentowej FRA w stosunku do łącznej wartości nominalnej obrotów zrealizowanych na tym rynku przez DSPW oraz kandydatów na DSPW. Ocena punktowa będzie dokonywana według następującej skali:
- a) powyżej 0% do 2% włącznie – 0,5 punktu,
  - b) powyżej 2% do 4% włącznie – 1 punkt,
  - c) powyżej 4% do 6% włącznie – 1,5 punktu,
  - d) powyżej 6% do 8% włącznie – 2 punkty,
  - e) powyżej 8% do 10% włącznie – 2,5 punktu,
  - f) powyżej 10% – 3 punkty;
- 9) wartości nominalnej obrotów zrealizowanych przez bank na rynku instrumentów pochodnych stopy procentowej IRS w stosunku do łącznej wartości nominalnej obrotów zrealizowanych na tym rynku przez DSPW oraz kandydatów na DSPW. Ocena punktowa będzie dokonywana według następującej skali:
- a) powyżej 0% do 2% włącznie – 0,5 punktu,
  - b) powyżej 2% do 4% włącznie – 1 punkt,
  - c) powyżej 4% do 6% włącznie – 1,5 punktu,
  - d) powyżej 6% do 8% włącznie – 2 punkty,
  - e) powyżej 8% do 10% włącznie – 2,5 punktu,
  - f) powyżej 10% – 3 punkty.

§ 17. Za rzetelne wypełnianie obowiązków w zakresie współpracy z Emitentem, NBP oraz KDPW S.A., DSPW oraz kandydat na DSPW może uzyskać maksymalną ocenę 12 punktów. Podstawą oceny punktowej w ramach tego kryterium jest:

- 1) aktywne kwotowanie na zorganizowanym elektronicznym rynku wtórnym poprzez podawanie cen kupna lub sprzedaży innych emisji niż bazowe – max. 3 pkt,
- 2) rzetelne wypełnianie obowiązków wynikających z uczestnictwa w systemach depozytowo-rozliczeniowych - max. 3 punktów,
- 3) doradzanie Emitentowi w dziedzinie polityki emisyjnej SPW - max. 3 punkty,
- 4) inne elementy, a w szczególności: wypełnianie obowiązków stałego dwustronnego kwotowania emisji bazowych, działania na rzecz rozwoju przejrzystego i efektywnego rynku SPW – max. 3 pkt.

§ 18. 1. Kryterium, określone w §16 pkt 1, jest obliczane w oparciu o dane Departamentu Systemu Płatniczego NBP.

2. Kryteria, określone w §16 pkt 2, 3 i 6, są obliczane w oparciu o transakcje rozliczone w Centralnym Rejestrze Bonów Skarbowych NBP.

3. Kryteria, określone w §16 pkt 4, 5 i 7, są obliczane w oparciu o transakcje rozliczone przez Krajowy Depozyt Papierów Wartościowych S.A.

4. Kryteria, określone w §16 pkt 8 i 9, są obliczane w oparciu o dane przesłane przez DSPW i kandydatów na DSPW zgodnie z § 6 pkt 2.

5. Wartość bonów lub obligacji skarbowych zakupionych przez poszczególnych DSPW, o których mowa w § 3 ust.2, wyliczana jest z uwzględnieniem sumy bonów lub obligacji

skarbowych zakupionych przez DSPW. Wyliczenia są dokonywane na podstawie danych NBP i KDPW SA. W wyliczeniach nie uwzględnia się transakcji nierozliczonych.

6. W kryteriach, określonych w §16, nie uwzględnia się transakcji zawartych z Ministrem Finansów lub NBP.

7. Wyliczenie wartości poszczególnych udziałów dokonywane jest z dokładnością do 2 miejsc po przecinku, przy zastosowaniu następującej zasady zaokrąglenia:

- 1) w dół – dla wartości mniejszych od 5,
- 2) w górę - dla wartości większych lub równych 5.

§ 19.1. Emitent ma prawo podpisania umowy o pełnienie funkcji DSPW na okres jednego roku z kandydatami na DSPW, którzy osiągnęli najwyższy poziom IAD, ustalony jako średni kwartalny IAD w okresie od stycznia do września (okres konkursu).

2. Średni kwartalny IAD może być obniżony zgodnie z § 3 ust.3, § 4 ust. 3 oraz § 12 ust. 1, także po zakończeniu konkursu do czasu ogłoszenia jego wyników. Ocena kandydatów na DSPW w okresie konkursu może być obniżona zgodnie z §12 ust. 1, także po zakończeniu konkursu do czasu ogłoszenia jego wyników..

3. Lista banków, z którymi Emitent zawarł umowę o pełnienie funkcji DSPW, jest podawana do publicznej wiadomości.

§ 20. Emitent będzie ogłaszał w serwisach informacyjnych oraz w serwisie internetowym Ministerstwa Finansów, po kolejnych kwartałach listę DSPW. Emitent będzie przysyłał informację umożliwiającą każdemu DSPW lub kandydatowi na DSPW ocenę swojej pozycji w systemie DSPW, informacja ta będzie zawierać w szczególności miejsce i liczbę zdobytych punktów w danym kwartale, w okresie konkursu.

## **V. Przepisy przejściowe i końcowe.**

§ 21. 1. W pierwszym kwartale 2003 r. w przetargach bonów skarbowych mogą uczestniczyć podmioty, które posiadają status uczestnika przetargu na podstawie §10 rozporządzenia Ministra Finansów z dnia 26 sierpnia 1999 r. w sprawie warunków emitowania bonów skarbowych (Dz. U. Nr 74, poz. 831 z późn. zm.).

2. Prawo do uczestniczenia w przetargach bonów skarbowych lub obligacji skarbowych może posiadać również bank państwowy, z którym Emitent podpisze umowę przyznającą prawo uczestniczenia w przetargach.

§ 22. W przypadku zmian w Regulaminie Emitent zobowiązany jest do poinformowania DSPW, co najmniej na tydzień przed ich wejściem w życie.

§ 23. Regulamin wchodzi w życie z dniem 1 stycznia 2003 r.

MINISTER FINANSÓW

## Załącznik nr 1 do Regulaminu

Załącznik nr 1.1

Obroty na rynku wtórnym obligacji skarbowych rozliczone przez ..... (nazwa DSPW) w okresie miesiąca .....

w tys. zł, wg wartości nominalnej

Wyszczególnienie	ogółem (3+4+5)	transakcje repo, sell-buy back	kupno i sprzedaż	inne transakcje
1	2	3	4	5
I. Obligacje skarbowe według kodu ISIN nadanego przez KDPW:				
I.1 PL00001xxxxx				
I.2 ...				
I.3 ...				
I.4 ...				
I.5 ...				
I.n ...				
Razem:				

\*) transakcje, w których DSPW występuje jako strona rozliczenia (transakcje rozliczone na rachunek własny i transakcje rozliczone na rachunek klientów)

Załącznik nr 1.2

Obroty na rynku wtórnym obligacji skarbowych rozliczone przez ..... (nazwa DSPW) w okresie tygodnia ..... osobno dla poszczególnych typów obligacji\*)

w tys. zł wg wartości nominalnej

Rodzaj portfela	Liczba transakcji	Zbycie	Nabycie
banki rezydenci-banki rezydenci			
banki rezydenci-rezydenci spoza sektora bankowego			
banki rezydenci-nierezydenci			
rezydenci spoza sektora bank.-rezydenci spoza sektora bank.			
rezydenci spoza sektora bank.-nierezydenci			
Nierezydenci-nierezydenci			
Razem			

\*) - w podziale na 2-letnie zerokuponowe, 5-letnie stałokuponowe, 10-letnie stałokuponowe, 10-letnie zmiennokuponowe, 20-letnie stałokuponowe  
- transakcje, w których DSPW występuje jako strona rozliczenia (transakcje rozliczone na rachunek własny i transakcje rozliczone na rachunek klientów)



Obroty na rynku wtórnym obligacji skarbowych rozliczone przez ..... (nazwa DSPW) w okresie miesiąca .....\*) w podziale na grupy inwestorów.

w tys. zł wg wartości nominalnej

Lp.	Wyszczególnienie	obrót ogółem (4+6+7)	obrót z bankami	obrót z rezydentami spoza sektora bankowego		
				w tym: z DSPW	obrót z rezydentami spoza sektora bankowego	obrót z nierezydentami
1	2	3	4	5	6	7
1	obrót na rynku wtórnym ogółem (2+3+4)					
2	w tym: repo, sell-buy back					
3	kupno i sprzedaż					
4	inne transakcje					

\*) transakcje, w których DSPW występuje jako strona rozliczenia (transakcje rozliczone na rachunek własny i transakcje rozliczone na rachunek klientów)

Obroty na rynku wtórnym obligacji skarbowych rozliczone przez ..... (nazwa DSPW) w dniu .....

w tys. zł,

Wyszczególnienie	Transakcje rozliczane pieniężnie w KDPW		Transakcje rozliczane pieniężnie poza KDPW	Suma transakcji wg wartości nominalnej
	wg cen transakcyjnych	wg wartości nominalnej	wg wartości nominalnej	ogółem (3+4)
1	2	3	4	5
I. Obligacje skarbowe według kodu ISIN nadanego przez KDPW:				
I.1 PL00001xxxxx				
I.2 ...				
I.3 ...				
I.4 ...				
I.5 ...				
I.n ...				
Razem:				

Uwaga: Tabelę sporządza KDPW, na podstawie przesłanych instrukcji rozliczeniowych.

**INFORMACJA\***  
**O DZIAŁANIACH BANKU NA RYNKU FINANSOWYM**  
**W.....(miesiąc, rok)**

**I. Informacja o nieskarbowych papierach dłużnych.**

**1. Informacja o emisjach i emitentach.**

Dane o każdej emisji przesyłają banki pełniące funkcję Agenta Emisji.

	<b>EMISJA</b>	
1.	Pełna nazwa emitenta	
2.	Rodzaj instrumentu dłużnego	
3.	Emisja publiczna/niepubliczna	
4.	Podstawa prawna emisji	
5.	Data emisji	
6.	Pierwotny okres zapadalności	
7.	Data zapadalności	
8.	Czas trwania programu emisji	
9.	Data zakończenia programu emisji	
10.	Wartość programu (limit zadłużenia) w mln jednostek waluty określonej w programie	
11.	Wartość emisji (w mln jednostek waluty emisji) uplasowanej na rynku w miesiącu sprawozdawczym	
12.	Gwarant objęcia emisji – nazwa	
13..	Gwarant wykupu emisji – nazwa	
14.	Rating emitenta	
15.	Rating emisji	
16.	Rating gwaranta wykupu emisji	
17.	Nominał (w tys jednostek waluty emisji)	
18..	Cena emisyjna	
19.	Waluta emisji (np. PLN, USD, EUR)	
20a.	Rodzaj oprocentowania	
20b.	Wysokość (formuła) oprocentowania	
20c.	Daty płatności kuponów	
21.	Wbudowane instrumenty pochodne, inne właściwości	
22.	Inne funkcje pełnione przez Bank	

\*Informację składają DSPW oraz kandydaci na DSPW w terminie do 8 dnia miesiąca kalendarzowego następującego po miesiącu sprawozdawczym, z wyjątkiem informacji za styczeń, dla której termin złożenia informacji upływa 15 lutego 2003 r.

**Uwagi:**

Przekazuje się informacje o papierach wyemitowanych tylko na podstawie prawa polskiego.

Dane są wykazywane z uwzględnieniem DATY PŁATNOŚCI (daty rozliczenia).

„Rolowanie” kolejnych transz należy traktować jako nową emisję.

Daty zapisujemy w formacie DD-MM-RRRR.

Dla ratingu podajemy nazwy agencji ratingowych.

Ad. 6 Do jednego roku w miesiącach,  $\geq$  1 rok w latach.

Ad. 8 Do jednego roku w miesiącach,  $\geq$  1 rok w latach.

Ad. 10 Maksymalna kwota zadłużenia emitenta wobec inwestorów z tytułu papierów dłużnych określona w umowie między emitentem a Agentem Emisji.

Ad. 12 Podmiot / podmioty zobowiązane na podstawie umowy z emitentem do nabycia na własny rachunek papierów dłużnych na warunkach określonych w tej umowie.

Ad. 13 Podmiot / podmioty zobowiązane do spełnienia zobowiązań wynikających z wyemitowanych papierów dłużnych, w przypadku nie spełnienia ich przez emitenta.

Ad. 17 Nominał jednostkowy.

Ad. 18 Kwota, po której inwestor nabył instrument od emitenta (wyrażona w jednostkach za każde 100 jednostek waluty emisji).

Ad. 20a. Dyskonto; zerokuponowe, o stałym; o zmiennym oprocentowaniu.

Ad.20b. Stopa referencyjna i wysokość marży (w punktach procentowych), płatne z góry / z dołu. Dla stopy referencyjnej podajemy tylko np. 3M WIBOR, 6M LIBOR, BS52 (nie podajemy okresu, na podstawie którego wyliczana jest średnia stanowiąca stopę referencyjną ani wartości tej stopy).

Ad. 21 Np. opcja call, opcja put, obligacja zamienna na (nazwa akcji).

Ad. 22 Np. Agent ds. Płatności, Depozytariusz, Dealer

## 2. Nabywcy nieskarbowych papierów wartościowych.

Przekazuje się informacje o papierach wyemitowanych tylko na podstawie prawa polskiego.

Stan kont depozytowych w ostatnim dniu okresu sprawozdawczego wg wartości nominalnej papierów wyrażony w mln PLN (wartość papierów denominowanych w walutach obcych przeliczana jest po średnim kursie NBP z ostatniego dnia okresu sprawozdawczego).

### 2.1. Nabywcy bankowych papierów wartościowych emitowanych na podstawie Ustawy Prawo bankowe z pierwotnym terminem zapadalności do 1 roku włącznie.

TYP INWESTORA	REZYDENT	NIEREZYDENT
Monetarne instytucje finansowe 1)		
Instytucje ubezpieczeniowe		
Fundusze emerytalne		
Pozostałe instytucje pośrednictwa finansowego 2)		
w tym fundusze inwestycyjne		
Pomocnicze instytucje finansowe 3)		
Przedsiębiorstwa 4)		
Gospodarstwa domowe 5)		
Instytucje niekomercyjne działające na rzecz gospodarstw domowych 6)		
Instytucje rządowe szczebla centralnego 7)		
Fundusze ubezpieczeń społecznych 8)		
Instytucje samorządowe 9)		
<b>Razem</b>		

### 2.2. Nabywcy bankowych papierów wartościowych emitowanych na podstawie Ustawy Prawo bankowe z pierwotnym terminem zapadalności powyżej 1 roku.

TYP INWESTORA	REZYDENT	NIEREZYDENT
Monetarne instytucje finansowe 1)		
Instytucje ubezpieczeniowe		
Fundusze emerytalne		
Pozostałe instytucje pośrednictwa finansowego 2)		
w tym fundusze inwestycyjne		
Pomocnicze instytucje finansowe 3)		
Przedsiębiorstwa 4)		
Gospodarstwa domowe 5)		
Instytucje niekomercyjne działające na rzecz gospodarstw domowych 6)		
Instytucje rządowe szczebla centralnego 7)		
Fundusze ubezpieczeń społecznych 8)		
Instytucje samorządowe 9)		
<b>Razem</b>		

**2.3. Nabywcy listów zastawnych emitowanych na podstawie Ustawy o bankach hipotecznych i listach zastawnych.**

<b>TYP INWESTORA</b>	<b>REZYDENT</b>	<b>NIEREZYDENT</b>
Monetarne instytucje finansowe 1)		
Instytucje ubezpieczeniowe		
Fundusze emerytalne		
Pozostałe instytucje pośrednictwa finansowego 2)		
w tym fundusze inwestycyjne		
Pomocnicze instytucje finansowe 3)		
Przedsiębiorstwa 4)		
Gospodarstwa domowe 5)		
Instytucje niekomercyjne działające na rzecz gospodarstw domowych 6)		
Instytucje rządowe szczebla centralnego 7)		
Fundusze ubezpieczeń społecznych 8)		
Instytucje samorządowe 9)		
<b>Razem</b>		

**2.4. Nabywcy obligacji nieskarbowych emitowanych na podstawie Ustawy o obligacjach (przez podmioty inne niż jednostki samorządu terytorialnego) o pierwotnym terminie zapadalności powyżej 1 roku.**

<b>TYP INWESTORA</b>	<b>REZYDENT</b>	<b>NIEREZYDENT</b>
Monetarne instytucje finansowe 1)		
Instytucje ubezpieczeniowe		
Fundusze emerytalne		
Pozostałe instytucje pośrednictwa finansowego 2)		
w tym fundusze inwestycyjne		
Pomocnicze instytucje finansowe 3)		
Przedsiębiorstwa 4)		
Gospodarstwa domowe 5)		
Instytucje niekomercyjne działające na rzecz gospodarstw domowych 6)		
Instytucje rządowe szczebla centralnego 7)		
Fundusze ubezpieczeń społecznych 8)		
Instytucje samorządowe 9)		
<b>Razem</b>		

**2.5. Nabywcy obligacji komunalnych (emitowanych przez jednostki samorządu terytorialnego: miasta, gminy, powiaty, województwa)**

TYP INWESTORA	REZYDENT	NIEREZYDENT
Monetarne instytucje finansowe 1)		
Instytucje ubezpieczeniowe		
Fundusze emerytalne		
Pozostałe instytucje pośrednictwa finansowego 2)		
w tym fundusze inwestycyjne		
Pomocnicze instytucje finansowe 3)		
Przedsiębiorstwa 4)		
Gospodarstwa domowe 5)		
Instytucje niekomercyjne działające na rzecz gospodarstw domowych 6)		
Instytucje rządowe szczebla centralnego 7)		
Fundusze ubezpieczeń społecznych 8)		
Instytucje samorządowe 9)		
<b>Razem</b>		

**2.6. Nabywcy krótkoterminowych instrumentów dłużnych emitowanych na podstawie Ustawy o obligacjach, Kodeksu cywilnego, Prawa wekslowego o pierwotnym terminie zapadalności do 1 roku włącznie.**

TYP INWESTORA	REZYDENT	NIEREZYDENT
Monetarne instytucje finansowe 1)		
Instytucje ubezpieczeniowe		
Fundusze emerytalne		
Pozostałe instytucje pośrednictwa finansowego 2)		
w tym fundusze inwestycyjne		
Pomocnicze instytucje finansowe 3)		
Przedsiębiorstwa 4)		
Gospodarstwa domowe 5)		
Instytucje niekomercyjne działające na rzecz gospodarstw domowych 6)		
Instytucje rządowe szczebla centralnego 7)		
Fundusze ubezpieczeń społecznych 8)		
Instytucje samorządowe 9)		
<b>Razem</b>		

**Uwagi:**

Podział inwestorów wg klasyfikacji sektorowej zgodnej ze standardem europejskim ESA 95.

1) dotyczy banków komercyjnych, lista MIF na stronie internetowej EBC

- 2) m.in. fundusze inwestycyjne, firmy leasingowe, factoringowe, biura maklerskie, kantory
- 3) m.in. fundusze, fundacje finansowe, izby i centra rozliczeniowe, BFG
- 4) obejmuje: przedsiębiorstwa i spółki państwowe oraz przedsiębiorstwa, spółki prywatne i spółdzielnie
- 5) obejmuje: przedsiębiorców indywidualnych (zatrudniających do 9 osób włącznie), osoby prywatne i rolników indywidualnych
- 6) instytucje niekomercyjne działające na rzecz gospodarstw domowych, których podstawowe przychody stanowią dobrowolne wpłaty lub wkłady w naturze od gospodarstw domowych, dotacje instytucji rządowych i samorządowych oraz dochody z tytułu własności; zaliczamy tu m.in. związki zawodowe, towarzystwa i stowarzyszenia zawodowe i naukowe, partie polityczne, kościoły i związki wyznaniowe, kluby kultury, rekreacyjne i sportowe, wspólnoty mieszkaniowe, organizacje pomocy humanitarnej finansowane z transferów pieniężnych od innych jednostek instytucjonalnych
- 7) budżet państwa i fundusze celowe budżetu państwa z wyłączeniem funduszy zaliczonych do funduszy ubezpieczeń społecznych
- 8) kasy chorych (po zmianach Narodowy Fundusz Zdrowia), ZUS, KRUS
- 9) jednostki samorządu terytorialnego (gminne i wojewódzkie): urzędy powiatowe i gminne, sejmiki samorządowe, samodzielne publiczne zakłady opieki zdrowotnej utworzone przez JST, publiczne szkoły podstawowe, ponadpodstawowe z wyłączeniem specjalistycznych finansowanych z budżetu państwa), samorządowe instytucje kultury, zakłady budżetowe i gospodarstwa pomocnicze jednostek budżetowych tworzone przez JST, samorządowe fundusze celowe

**Szczegółowe objaśnienie kategorii na stronie internetowej NBP, w części Statystyka (Sprawozdawczość statystyczna banków, plik Instrukcja).**

Powyższe tabele **wypełniają banki** pełniące funkcję **Depozytariusza lub Sub-Depozytariusza**, w rozumieniu „Rekomendacji w sprawie standardowej dokumentacji niepublicznych emisji krótko- i średnioterminowych obligacji nieskarbowych przeprowadzanych za pośrednictwem kilku dealerów”. Depozytariusze wykazują stan rachunków papierów wartościowych inwestorów **z wyłączeniem stanu kont Sub-Depozytariuszy (banków sprawozdających).**

#### **Lista banków sprawozdających**

**„Informacje o działaniach banku na rynku finansowym” przekazują:**

1. ABN AMRO Bank (Polska) SA
2. AmerBank SA Bank Amerykański w Polsce
3. Bank Gospodarstwa Krajowego
4. Bank Gospodarki Żywnościowej SA
5. Bank Handlowy w Warszawie S.A.
6. Bank Pekao SA
7. Bank Przemysłowo-Handlowy PBK SA
8. Bank Zachodni WBK SA
9. BIG Bank Gdański SA
10. BNP Paribas Bank Polska SA
11. BRE Bank SA
12. Deutsche Bank Polska SA
13. ING Bank Śląski SA
14. Invest-Bank SA
15. Kredyt Bank SA
16. PKO Bank Polski SA
17. Raiffeisen Bank Polska SA
18. Société Générale Oddział w Warszawie
19. Westdeutsche Landesbank Polska S.A.

### 3. Obroty na RYNKU WTÓRNYM nieskarbowych papierów dłużnych.

Przekazuje się informacje o papierach wyemitowanych tylko na podstawie prawa polskiego. Dane wykazuje się według wartości nominalnej papierów i wyraża się w mln PLN (dla papierów denominowanych w walutach obcych wartość przelicza się po kursie średnim NBP z dnia rozliczenia transakcji).

#### **RYNEK WTÓRNY**

Poprzez rynek wtórny nieskarbowych papierów dłużnych rozumiemy rynek, na którym dokonywane są transakcje kupna (sprzedaży) tych papierów z wyłączeniem pierwotnej sprzedaży papierów przez emitenta za pośrednictwem dealera oraz nabywania przez emitenta papierów w celu ich wykupu (zarówno bez pośrednictwa jak i za pośrednictwem dealera).

**Prosimy o wykazywanie tylko tych transakcji, które zachodzą na tak zdefiniowanym rynku wtórnym.**

**Przekazywana jest informacja o transakcjach ROZLICZONYCH w okresie sprawozdawczym (razem transakcje kupna i sprzedaży). Nie wykazuje się transakcji warunkowych.**

Obroty w mln PLN	z bankami	z niebankami	razem
<i>Instrumenty dłużne emitowane przez podmioty inne niż banki</i>			
Komercyjne instrumenty rynku pieniężnego o pierwotnym terminie zapadalności do 1 roku włącznie <b>1)</b>			
Komercyjne instrumenty rynku finansowego o pierwotnym terminie zapadalności powyżej 1 roku			
- w tym obligacje komunalne			
<i>Papiery dłużne emitowane przez banki</i>			
Bankowe papiery wartościowe o pierwotnym terminie zapadalności do 1 roku włącznie <b>2)</b>			
Bankowe papiery wartościowe o pierwotnym terminie zapadalności powyżej 1 roku <b>2)</b>			
Obligacje bankowe o pierwotnym terminie zapadalności do 1 roku włącznie			
Obligacje bankowe o pierwotnym terminie zapadalności powyżej 1 roku			
Listy zastawne			
Obligacje NBP			

1) emitowane na podstawie Ustawy o obligacjach, Kodeksu cywilnego, Prawa wekslowego

2) papiery wartościowe emitowane na podstawie Ustawy Prawo bankowe

Osoba odpowiedzialna za sporządzanie i terminowe dostarczanie informacji miesięcznej do Departamentu Operacji Krajowych Narodowego Banku Polskiego.

Imię i nazwisko:

Funkcja:

Departament:

tel. fax.:

Pieczętka i podpis



## II. Informacja o rynku wtórnym instrumentów finansowych

Przekazuje się informacje tylko o papierach wyemitowanych na podstawie prawa polskiego.

### 1.1 Stan portfela własnego instrumentów dłużnych (nominowanych w PLN i walutach obcych) posiadanych przez bank w ostatnim dniu okresu sprawozdawczego wg wartości nominalnej wyrażonej w mln PLN.

Wartość papierów denominowanych walutach obcych jest przeliczana po kursie średnim NBP z ostatniego dnia okresu sprawozdawczego.

Rodzaj papieru wartościowego	Stan wg wartości nominalnej w mln PLN
Obligacje skarbowe	
<i>Instrumenty dłużne emitowane przez podmioty inne niż banki</i>	
Komercyjne instrumenty rynku pieniężnego o pierwotnym terminie zapadalności do 1 roku włącznie 1)	
Komercyjne instrumenty rynku finansowego o pierwotnym terminie zapadalności powyżej 1 roku	
w tym: obligacje komunalne	
<i>Papiery dłużne emitowane przez banki</i>	
Bankowe papiery wartościowe o pierwotnym terminie zapadalności do 1 roku włącznie 2)	
Bankowe papiery wartościowe o pierwotnym terminie zapadalności powyżej 1 roku 2)	
Obligacje bankowe o pierwotnym terminie zapadalności do 1 roku włącznie	
Obligacje bankowe o pierwotnym terminie zapadalności powyżej 1 roku	
Listy zastawne	

1) emitowane na podstawie Ustawy o obligacjach, Kodeksu cywilnego, Prawa wekslowego

2) papiery wartościowe emitowane na podstawie Ustawy Prawo bankowe

### 1.2. Stan portfela własnego instrumentów dłużnych nominowanych w walutach obcych posiadanych przez bank w ostatnim dniu okresu sprawozdawczego wg wartości nominalnej wyrażonej w mln PLN.

Papiery wartościowe nominowane w walucie obcej	Stan wg wartości nominalnej w mln PLN
- emitowane przez rezydenta	
- emitowane przez nierezydenta	

Przykład:

Jeśli bank posiada w portfelu listy zastawne nominowane w euro, których emitentem jest rezydent wykazuje je w obu tabelach 1.1. i 1.2. (odpowiednio w wierszach: listy zastawne i emitowane przez rezydenta).

## 2. Transakcje warunkowe

Przekazuje się informacje o transakcjach zabezpieczonych na papierach wyemitowanych tylko na podstawie prawa polskiego.

Wartość papierów denominowanych w walutach obcych jest przeliczana po średnim kursie NBP z dnia rozliczenia transakcji.

**Bank X** – należy podać nazwę banku, kontrahenta

**Kategoria X** – w miarę możliwości posiadanego przez Państwa Bank systemu transakcje z kontrahentami niebankowymi należy wykazywać według następujących kategorii (szczegółowy opis kategorii – patrz uwagi do tabel I.2):

1. Instytucje ubezpieczeniowe.
2. Fundusze emerytalne.
3. Pozostałe instytucje pośrednictwa finansowego  
3a. Fundusze inwestycyjne.
4. Pomocnicze instytucje finansowe.
5. Przedsiębiorstwa.
6. Gospodarstwa domowe.
7. Instytucje niekomercyjne działające na rzecz gospodarstw domowych.
8. Instytucje rządowe szczebla centralnego.
9. Fundusze ubezpieczeń społecznych.
10. Instytucje samorządowe.

Jeśli przekazywanie informacji o transakcjach z podmiotami niebankowymi w podziale na powyższe kategorie jest niemożliwe należy podawać zagregowaną wartość transakcji z wszystkimi podmiotami niebankowymi.

### 2.1. Lista operacji REPO i REVERSE REPO (z wyłączeniem operacji dokonanych z NBP) ROZPOCZĘTYCH (i już zakończonych, jak i niezakończonych) w danym miesiącu sprawozdawczym.

zabezpieczonych na bonach pieniężnych NBP

w mln PLN

Lp.	Data waluty	Typ operacji	Data odkupu / sprzedaży	Nazwa kontrahenta	Wartość nominalna bonów
I.1		(*)		Bank X	
...					
<b>Suma</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	
I.2		(**)		Bank X	
...					
<b>Suma</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	
<b>Razem</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	

(\*) - (K/PO) - kupno z przyrzeczeniem odsprzedaży

(\*\*) - (S/PO) - sprzedaż z przyrzeczeniem odkupu

Struktura terminowa:

<b>Ogółem</b>	<b>K/PO wartość w mln PLN</b>	<b>S/PO wartość w mln PLN</b>
W tym:		
- 1 dzień		
- powyżej 1 dnia do 7 dni włącznie		
- powyżej 7 dni i do 1 miesiąca włącznie		
- powyżej 1 miesiąca i do 3 miesięcy włącznie		
- powyżej 3 miesięcy i do 6 miesięcy włącznie		
- powyżej 6 miesięcy i do 1 roku włącznie		

**2.2 Lista operacji SELL-BUY-BACK i BUY-SELL-BACK (z wyłączeniem operacji dokonywanych z NBP) ROZPOCZĘTYCH (i już zakończonych, jak i niezakończonych) w danym miesiącu sprawozdawczym.**

zabezpieczonych na bonach pieniężnych NBP

w mln PLN

<b>Lp.</b>	<b>Data waluty</b>	<b>Typ operacji</b>	<b>Data odkupu / sprzedaży</b>	<b>Nazwa kontrahenta</b>	<b>Wartość nominalna bonów</b>
I.1		(*)		Bank X	
...					
<b>Suma</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	
I.2		(**)		Bank X	
...					
<b>Suma</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	
<b>Razem</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	

(\*) – (SBB) – sell-buy-back

(\*\*) – (BSB) – buy-sell-back

Struktura terminowa:

<b>Ogółem</b>	<b>SBB wartość w mln PLN</b>	<b>BSB wartość w mln PLN</b>
W tym:		
- 1 dzień		
- powyżej 1 dnia do 7 dni włącznie		
- powyżej 7 dni i do 1 miesiąca włącznie		
- powyżej 1 miesiąca i do 3 miesięcy włącznie		
- powyżej 3 miesięcy i do 6 miesięcy włącznie		
- powyżej 6 miesięcy i do 1 roku włącznie		

**2.3.a Lista operacji REPO i REVERSE REPO (z wyłączeniem operacji dokonanych z NBP) ROZPOCZĘTYCH (i już zakończonych, jak i niezakończonych) w danym miesiącu sprawozdawczym.**

zabezpieczonych na obligacjach skarbowych

w mln PLN

Lp.	Data waluty	Typ operacji	Data odkupu / sprzedaży	Nazwa banku / kategoria kontrahenta niebankowego	Wartość nominalna obligacji
I.1		(*)		Bank X	
...				...	
II.1				Kategoria X	
...				...	
<b>Suma (*)</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	
I.1.		(**)		Bank.X	
...					
II.1				Kategoria X	
<b>Suma (**)</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	
<b>Razem</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	

(\*) - (K/PO) - kupno z przyrzeczeniem odsprzedaży

(\*\*) - (S/PO) - sprzedaż z przyrzeczeniem odkupu

Struktura terminowa:

Ogółem	K/PO wartość w mln PLN	S/PO wartość w mln PLN
W tym:		
- 1 dzień		
- powyżej 1 dnia do 7 dni włącznie		
- powyżej 7 dni i do 1 miesiąca włącznie		
- powyżej 1 miesiąca i do 3 miesięcy włącznie		
- powyżej 3 miesięcy i do 6 miesięcy włącznie		
- powyżej 6 miesięcy i do 1 roku włącznie		

**2.3.b Lista operacji REPO i REVERSE REPO (z wyłączeniem operacji dokonanych z NBP) ROZPOCZĘTYCH (i już zakończonych, jak i niezakończonych) w danym miesiącu sprawozdawczym.**

zabezpieczonych na obligacjach NBP

w mln PLN

Lp.	Data waluty	Typ operacji	Data odkupu / sprzedaży	Nazwa banku / kategoria kontrahenta niebankowego	Wartość nominalna obligacji
I.1		(*)		Bank X	
...				...	
II.1				Kategoria X	
...				...	
<b>Suma (*)</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	
I.1.		(**)		Bank.X	
...					
II.1				Kategoria X	
<b>Suma (**)</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	
<b>Razem</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	

(\*) - (K/PO) - kupno z przyrzeczeniem odsprzedaży

(\*\*) - (S/PO) - sprzedaż z przyrzeczeniem odkupu

Struktura terminowa:

Ogółem	K/PO wartość w mln PLN	S/PO wartość w mln PLN
W tym:		
- 1 dzień		
- powyżej 1 dnia do 7 dni włącznie		
- powyżej 7 dni i do 1 miesiąca włącznie		
- powyżej 1 miesiąca i do 3 miesięcy włącznie		
- powyżej 3 miesięcy i do 6 miesięcy włącznie		
- powyżej 6 miesięcy i do 1 roku włącznie		

**2.3.c Lista operacji REPO i REVERSE REPO (z wyłączeniem operacji dokonanych z NBP) ROZPOCZĘTYCH (i już zakończonych, jak i niezakończonych) w danym miesiącu sprawozdawczym.**

zabezpieczonych na pozostałych obligacjach

w mln PLN

Lp.	Data waluty	Typ operacji	Data odkupu / sprzedaży	Nazwa banku / kategoria kontrahenta niebankowego	Wartość nominalna obligacji
I.1		(*)		Bank X	
...				...	
II.1				Kategoria X	
...				...	
<b>Suma (*)</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	
I.1.		(**)		Bank.X	
...					
II.1				Kategoria X	
<b>Suma (**)</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	
<b>Razem</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	

(\*) - (K/PO) - kupno z przyrzeczeniem odsprzedaży

(\*\*) - (S/PO) - sprzedaż z przyrzeczeniem odkupu

Struktura terminowa:

Ogółem	K/PO wartość w mln PLN	S/PO wartość w mln PLN
W tym:		
- 1 dzień		
- powyżej 1 dnia do 7 dni włącznie		
- powyżej 7 dni i do 1 miesiąca włącznie		
- powyżej 1 miesiąca i do 3 miesięcy włącznie		
- powyżej 3 miesięcy i do 6 miesięcy włącznie		
- powyżej 6 miesięcy i do 1 roku włącznie		

**2.4.a Lista operacji SELL-BUY-BACK i BUY-SELL-BACK (z wyłączeniem operacji dokonanych z NBP) ROZPOCZĘTYCH (i już zakończonych, jak i niezakończonych) w danym miesiącu sprawozdawczym.**

zabezpieczonych na obligacjach skarbowych

w mln PLN

Lp.	Data waluty	Typ operacji	Data odkupu / sprzedaży	Nazwa banku / kategoria kontrahenta niebankowego	Wartość nominalna obligacji
I.1		(*)		Bank X	
...				...	
II.1				Kategoria X	
...				...	
<b>Suma (*)</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	
I.1.		(**)		Bank.X	
...					
II.1				Kategoria X	
<b>Suma (**)</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	
<b>Razem</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	

(\*) (SBB) - sell-buy-back

(\*\*) (BSB) - buy-sell-back

Struktura terminowa:

Ogółem	SBB wartość w mln PLN	BSB wartość w mln PLN
W tym:		
- 1 dzień		
- powyżej 1 dnia do 7 dni włącznie		
- powyżej 7 dni i do 1 miesiąca włącznie		
- powyżej 1 miesiąca i do 3 miesięcy włącznie		
- powyżej 3 miesięcy i do 6 miesięcy włącznie		
- powyżej 6 miesięcy i do 1 roku włącznie		

**2.4.b Lista operacji SELL-BUY-BACK i BUY-SELL-BACK (z wyłączeniem operacji dokonanych z NBP) ROZPOCZĘTYCH (i już zakończonych, jak i niezakończonych) w danym miesiącu sprawozdawczym.**

zabezpieczonych na obligacjach NBP

w mln PLN

Lp.	Data waluty	Typ operacji	Data odkupu / sprzedaży	Nazwa banku / kategoria kontrahenta niebankowego	Wartość nominalna obligacji
I.1		(*)		Bank X	
...				...	
II.1				Kategoria X	
...				...	
<b>Suma (*)</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	
I.1.		(**)		Bank.X	
...					
II.1				Kategoria X	
<b>Suma (**)</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	
<b>Razem</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	

(\*) (SBB) - sell-buy-back

(\*\*) (BSB) - buy-sell-back

Struktura terminowa:

Ogółem	SBB wartość w mln PLN	BSB wartość w mln PLN
W tym:		
- 1 dzień		
- powyżej 1 dnia do 7 dni włącznie		
- powyżej 7 dni i do 1 miesiąca włącznie		
- powyżej 1 miesiąca i do 3 miesięcy włącznie		
- powyżej 3 miesięcy i do 6 miesięcy włącznie		
- powyżej 6 miesięcy i do 1 roku włącznie		



**2.4.c Lista operacji SELL-BUY-BACK i BUY-SELL-BACK (z wyłączeniem operacji dokonanych z NBP) ROZPOCZĘTYCH (i już zakończonych, jak i niezakończonych) w danym miesiącu sprawozdawczym.**

zabezpieczonych na pozostałych obligacjach

w mln PLN

Lp.	Data waluty	Typ operacji	Data odkupu / sprzedaży	Nazwa banku / kategoria kontrahenta niebankowego	Wartość nominalna obligacji
I.1		(*)		Bank X	
...				...	
II.1				Kategoria X	
...				...	
<b>Suma (*)</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	
I.1.		(**)		Bank.X	
...					
II.1				Kategoria X	
<b>Suma (**)</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	
<b>Razem</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	

(\*) (SBB) - sell-buy-back

(\*\*) (BSB) - buy-sell-back

Struktura terminowa:

Ogółem	SBB wartość w mln PLN	BSB wartość w mln PLN
W tym:		
- 1 dzień		
- powyżej 1 dnia do 7 dni włącznie		
- powyżej 7 dni i do 1 miesiąca włącznie		
- powyżej 1 miesiąca i do 3 miesięcy włącznie		
- powyżej 3 miesięcy i do 6 miesięcy włącznie		
- powyżej 6 miesięcy i do 1 roku włącznie		

### 3. Kontrakty na stopę procentową i kurs walutowy.

IRS i FRA przekazuje się informacje tylko o kontraktach, w których kwota nominalna transakcji jest denominowana w PLN

CIRS przekazuje się informacje tylko o kontraktach, w których jedną z walut jest PLN

#### 3.1. Obroty według wartości nominalnej instrumentów wyrażonej w mln PLN (informacja o kontraktach ZAWARTYCH w okresie sprawozdawczym).

Lp.	Rodzaj kontraktu	Transakcje zabezpieczające		Transakcje spekulacyjne		Razem obroty 3+4+5+6
		Kwoty zakupione	Kwoty sprzedane	Kwoty zakupione	Kwoty sprzedane	
1	2	3	4	5	6	7
<b>1.</b>	<b>Kontrakty IRS</b>					
1.1.	Z rezydentami w tym:					
1.1.1	Banki					
1.1.2.	podmioty niebankowe					
1.2.	z nierezydentami					
<b>2.</b>	<b>Kontrakty FRA</b>					
2.1.	z rezydentami w tym:					
2.1.1	Banki					
2.1.2.	podmioty niebankowe					
2.2.	z nierezydentami					
<b>3.</b>	<b>Kontrakty CIRS</b>					
3.1.	z rezydentami w tym:					
3.1.1.	Banki					
3.1.2.	podmioty niebankowe					
3.2.	z nierezydentami					
<b>4.</b>	<b>Opcje walutowe na kurs USD/PLN</b>					
4.1.	z rezydentami w tym:					
4.1.1.	Banki					
4.1.2	podmioty niebankowe					
4.2.	Z nierezydentami					
<b>5.</b>	<b>Opcje walutowe na kurs EUR/PLN</b>					
5.1.	Z rezydentami w tym:					
5.1.1.	Banki					
5.1.2.	Podmioty niebankowe					
5.2.	z nierezydentami					

<b>6..</b>	<b>Opcje na stopę procentową</b>					
6.1.	z rezydentami w tym:					
6.1.1	Banki					
6.1.2.	podmioty niebankowe					
6.2.	z nierezydentami					

### 3.2 Struktura terminowa obrotów wg wartości nominalnej instrumentów wyrażonej w mln PLN.

Przekazuje się informacje o kontraktach ZAWARTYCH w okresie sprawozdawczym.

IRS i FRA      przekazuje się informacje tylko o kontraktach, w których kwota nominalna transakcji jest denominowana w PLN

CIRS            przekazuje się informacje tylko o kontraktach, w których jedną z walut jest PLN

#### IRS, CIRS

<b>Pierwotny termin zapadalności</b>	<b>Kontrakty IRS</b>	<b>Kontrakty CIRS</b>
<b>Ogółem</b> w tym:		
- do 1 roku włącznie		
- powyżej 1 roku i do 2 lat włącznie		
- powyżej 2 lat i do 3 lat włącznie		
- powyżej 3 lat i do 5 lat włącznie		
- powyżej 5 lat i do 10 lat włącznie		
- powyżej 10 lat		

#### Opcje walutowe na kurs EUR/PLN i USD/PLN oraz opcje na stopę procentową

<b>Pierwotny termin wykonania</b>	<b>Opcje na kurs USD/PLN</b>	<b>Opcje na kurs EUR/PLN</b>	<b>Opcje na stopę procentową</b>
<b>Ogółem</b> w tym:			
- do 1 miesiąca włącznie			
- powyżej 1 i do 3 miesięcy włącznie			
- powyżej 3 i do 6 miesięcy włącznie			
- powyżej 6 i do 9 miesięcy włącznie			
- powyżej 9 miesięcy i do 1 roku			
- powyżej 1 roku			

**FRA (według pierwotnego terminu zapadalności)**

<b>Rodzaj kontraktu</b>	<b>Wartość</b>	<b>Rodzaj kontraktu</b>	<b>Wartość</b>
<b>1x2</b>		<b>9x12</b>	
<b>2x3</b>		<b>1x7</b>	
<b>1x4</b>		<b>3x9</b>	
<b>3x6</b>		<b>6x12</b>	
<b>6x9</b>		<b>Pozostałe</b>	

Osoba odpowiedzialna za sporządzanie i terminowe dostarczanie informacji miesięcznej do Departamentu Operacji Krajowych Narodowego Banku Polskiego.

Imię i nazwisko:  
Funkcja:  
Departament:  
tel. fax.:  
Pieczętka i podpis

### III. Informacja o obrotach na rynku walutowym

Informacja o skali obrotów na rynku walutowym z bankami i podmiotami niebankowymi ( z wyjątkiem transakcji z NBP) zrealizowanych przez bank według **daty waluty**\*\*\* (daty rozliczenia transakcji) po kursie ogłaszanych przez NBP, o którym mowa w § 1 ust. 2 Uchwały nr 51/2002 Zarządu Narodowego Banku Polskiego z dnia 23 września 2002 r. w sprawie sposobu wyliczania kursów złotego w stosunku do walut obcych (Dz. Urz. NBP nr 14/2002 poz. 39).

\*\*\* - Informujemy, że w sprawozdaniach za **2004 r.** dane o obrotach zrealizowanych na rynku walutowym powinny być przekazywane do NBP według **daty zawarcia transakcji** (taki jest standard Banku Rozrachunków Międzynarodowych; inne banki centralne prezentują statystykę obrotów na rynku walutowym także według daty zawarcia transakcji). Statystyka obrotów według daty zawarcia pozwala na trafniejszą interpretację procesów zachodzących na rynku walutowym, w szczególności w segmencie transakcji terminowych.

Banki sprawozdające według daty zawarcia transakcji nie powinny zmieniać systemu. Pozostałe banki prosimy o zmodyfikowanie systemu, aby najpóźniej dane za styczeń 2004 r. były przekazane według daty zawarcia transakcji.

W 2003 r. obie formy prezentacji są poprawne. Mogą Państwo wybrać i przekazywać informację o obrotach na rynku walutowym albo według daty waluty, albo według daty zawarcia transakcji (wybraną formę proszę zaznaczyć na formularzu).

#### Uwagi:

W miarę możliwości dostosowania systemu w państwa Banku, prosimy o wyróżnienie wśród transakcji z podmiotami niebankowymi transakcji zawartych z rezydentami i nierezydentami (tytuły wierszy napisane kursywą).

W transakcjach z podmiotami niebankowymi wykazuje się tylko transakcje **NEGOCJOWANE**.

Obie wymiany („nogi”) transakcji fx swap (wymianę początkową i wymianę końcową - spot i forward) należy wykazywać w rubrykach fx swap – wymiany początkowej („nogi spot”) nie wykazujemy w transakcjach kasowych..

Terminy zapadalności (TZ) transakcji terminowych można wyznaczyć na przykład następująco:

- Sprawozdawczość według daty waluty (daty rozliczenia):  
*transakcje fx swap* TZ = data przepływu końcowego – data przepływu początkowego  
*transakcje forward* TZ = data rozliczenia – dwa dni robocze (spot) - data zawarcia transakcji
- Sprawozdawczość według daty zawarcia transakcji:  
*transakcje fx swap* TZ = data przepływu końcowego – dwa dni robocze (spot) – data rozpoczęcia transakcji  
*transakcje forward* TZ = data rozliczenia – dwa dni robocze (spot) - data zawarcia transakcji

## 1. WALUTA – WALUTA

Dane prezentowane są według:  daty waluty /  daty zawarcia transakcji

TYP TRANSAKCJI i termin zapadalności	Obroty ogółem			w tym					
	Kupno	Sprzedaż	razem	EUR			USD		
				kupno	Sprzedaż	Razem	kupno	sprzedaż	razem
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
<b>1. Natychmiastowe SPOT</b>									
1.1 z bankami rezydentami									
1.2. z bankami nierezydentami									
1.3. z pod. niebankowymi									
<i>1.3.a. rezydentami</i>									
<i>1.3.b. nierezydentami</i>									
<b>2. Terminowe</b>									
<b>2.1. Outright forward</b>									
2.1.1 z bankami rezydentami									
2.1.2. z bankami nierezydentami									
2.1.3. z pod. niebankowymi									
<i>2.1.3.a. rezydentami</i>									
<i>2.1.3.b. nierezydentami</i>									
<b>2.2. FX swap</b>									
2.2.1 z bankami rezydentami									
2.2.2. z bankami nierezydentami									
2.2.3. z pod. niebankowymi									
<i>2.2.3.a. rezydentami</i>									
<i>2.2.3.b. nierezydentami</i>									
<b>3. Terminy zapadalności wiersz 2</b>									
3.1. do 7 dni	X	X		X	X		X	X	
3.2. powyżej 7 dni i do 1 miesiąca	X	X		X	X		X	X	
3.3. powyżej 1 i do 3 miesięcy	X	X		X	X		X	X	
3.4. powyżej 3 miesięcy i do roku	X	X		X	X		X	X	
3.5. ponad 1 rok	X	X		X	X		X	X	

## 2. WALUTA – ZŁOTY

Dane prezentowane są według:  daty waluty /  daty zawarcia transakcji

TYP TRANSAKCJI i termin zapadalności	Obroty ogółem			w tym					
				EUR			USD		
	kupno	sprzedaż	razem	kupno	sprzedaż	razem	kupno	sprzedaż	razem
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
<b>1. Natychmiastowe SPOT</b>									
1.1 z bankami rezydentami									
1.2. z bankami nierezydentami									
1.3. z pod. niebankowymi									
<i>1.3.a. rezydentami</i>									
<i>1.3.b. nierezydentami</i>									
<b>2. Terminowe</b>									
<b>2.1. Outright forward</b>									
2.1.1 z bankami rezydentami									
2.1.2. z bankami nierezydentami									
2.1.3. z pod. niebankowymi									
<i>2.1.3.a. rezydentami</i>									
<i>2.1.3.b. nierezydentami</i>									
<b>2.2. FX swap</b>									
2.2.1 z bankami rezydentami									
2.2.2. z bankami nierezydentami									
2.2.3. z pod. niebankowymi									
<i>2.2.3.a. rezydentami</i>									
<i>2.2.3.b. nierezydentami</i>									
<b>3. Terminy zapadalności wiersz 2</b>									
3.1. do 7 dni	X	X		X	X		X	X	
3.2. powyżej 7 dni i do 1 miesiąca	X	X		X	X		X	X	
3.3. powyżej 1 i do 3 miesięcy	X	X		X	X		X	X	
3.4. powyżej 3 miesięcy i do roku	X	X		X	X		X	X	
3.5. ponad 1 rok	X	X		X	X		X	X	

## Załącznik nr 3 do Regulaminu

### DEKLARACJA

Niniejszym deklarujemy zamiar przystąpienia do konkursu na wybór DSPW. Tym samym przystępujemy do postępowania kwalifikacyjnego odbywającego się w 2003 r. W ramach postępowania kwalifikacyjnego zobowiązujemy się do realizacji postanowień Regulaminu pełnienia funkcji Dealera Skarbowych Papierów Wartościowych, zwanego dalej „Regulaminem”, oraz do przekazywania Emitentowi, za pośrednictwem Narodowego Banku Polskiego oraz Krajowego Depozytu Papierów Wartościowych S.A., informacji, o których mowa w Regulaminie.

Jednocześnie wyrażamy zgodę na:

- a) udostępnianie Ministrowi Finansów lub osobom przez niego upoważnionym danych dotyczących skarbowych papierów wartościowych przez Narodowy Bank Polski oraz Krajowy Depozyt Papierów Wartościowych S.A.,
- b) kontrolowanie przez upoważnionych przedstawicieli Ministra Finansów oraz NBP w okresie postępowania kwalifikacyjnego realizacji postanowień Regulaminu oraz rzetelności sprawozdań, o których mowa w Regulaminie.

W związku z tym upoważniamy Ministra Finansów i NBP oraz osoby przez nich upoważnione do weryfikacji w siedzibie Banku informacji i danych przekazywanych Ministrowi Finansów w związku z postępowaniem kwalifikacyjnym na wybór DSPW. W tym celu Bank zobowiązuje się udostępniać wszelkie informacje niezbędne dla przeprowadzenia tej weryfikacji. Niezależnie od tego, Bank upoważnia Ministra Finansów i NBP oraz osoby przez niego upoważnione do podejmowania innych, uznanych za nieodzowne, czynności weryfikacyjno-kontrolnych, dotyczących działań Banku związanych z postępowaniem kwalifikacyjnym na wybór DSPW.

Wyrażamy zgodę na dokonywanie przez Ministra Finansów lub osoby przez niego upoważnione oceny realizacji przez Bank postanowień wyżej wymienionych przepisów oraz na przyjęcie oceny określonej w § 19, jako oceny uzyskanej w wyniku postępowania kwalifikacyjnego.

BANK