

**Regulamin
z dnia 5 grudnia 2003 r.
pełnienia funkcji
Dealera Skarbowych Papierów Wartościowych**

I. Postanowienia ogólne.

§ 1. Regulamin określa zasady pełnienia funkcji Dealera Skarbowych Papierów Wartościowych, a 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) „Emitencie” - rozumie się przez to Ministra Finansów,
- 2) „NBP” – rozumie się przez to Narodowy Bank Polski,
- 3) „KDPW” – rozumie się przez to Krajowy Depozyt Papierów Wartościowych S.A.,
- 4) „CeTO” – rozumie się przez to Centralną Tabelę Ofert S.A.,
- 5) „DSPW” - rozumie się przez to Dealerów Skarbowych Papierów Wartościowych,
- 6) „Radzie Uczestników Rynku SPW” – rozumie się przez to zespół, w skład którego wchodzi przedstawiciele DSPW, NBP, KDPW oraz CeTO Rada jest zespołem opiniodawczo-doradczym funkcjonującym przy Ministrze Finansów,
- 7) „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: PK0704, DK0809,
- 8) „Zorganizowanym elektronicznym rynku wtórnym” - rozumie się przez to formę elektronicznego obrotu SPW wskazaną przez Emitenta, na podstawie umowy zawartej z CeTO,
- 9) „IAD” - rozumie się przez to Indeks Aktywności Dealerskiej,
- 10) „Fixingu 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,
- 11) „Emisjach bazowych” – 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,
- 12) „FRA (Forward Rate Agreement)” – rozumie się przez to transakcje służące zabezpieczeniu stopy procentowej,
- 13) „IRS (Interest Rate Swap)” – rozumie się przez to transakcje polegające na wymianie płatności odsetkowych w jednej walucie pomiędzy dwoma partnerami,
- 14) „Transakcjach negocjowanych” – rozumie się przez to transakcje zawierane w trybie automatycznego kojarzenia dyspozycji, w których warunki transakcji zostały uprzednio indywidualnie wynegocjowane na zorganizowanym elektronicznym rynku wtórnym SPW.

II. Obowiązki i uprawnienia DSPW.

§ 3.1.DSPW są zobowiązani do uczestniczenia we wszystkich rodzajach przetargów SPW organizowanych przez NBP w imieniu Emitenta, z zastrzeżeniem § 7 pkt 2.

2. DSPW są zobowiązani nabyć na przetargach, o których mowa w § 3 ust. 1, w ciągu kwartału nie mniej niż:

- a) 3% wartości nominalnej obligacji skarbowych sprzedanych w ciągu kwartału na tych przetargach,
- b) 3% wartości nominalnej bonów skarbowych sprzedanych w ciągu kwartału na tych przetargach.

3. Niespełnienie jednego z warunków, o których mowa ust. 2, skutkuje pomniejszeniem ocen danego DSPW, o których mowa w § 10, od 1 do 5 punktów. Ponowne nie spełnienie tych warunków w jednym z kolejnych okresów ocen skutkuje ponownym pomniejszeniem ocen 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 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 ocen danego DSPW, o których mowa w § 10, o 1-2 punkty.

§ 5.1. DSPW są zobowiązani do kwotowania SPW, od godz. 9.00 do godz. 16.30, na zorganizowanym elektronicznym rynku wtórnym, poprzez podawanie cen kupna i sprzedaży za każde 100 zł wartości nominalnej, w szczególności emisji bazowych. Minimalny, dzienny czas kwotowania przez jednego DSPW wynosi 6 godzin.

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. W takim przypadku DSPW są zobowiązani kwotować emisje bazowe nie przekraczając *spread'u* określonego przez Emitenta. *Spread* jest liczony jako punkt bazowy ceny (z dokładnością do jednego grosza) za każde 100 zł wartości nominalnej SPW.

4. Wartość nominalna kwotowania dla emisji bazowych oraz pozostałych emisji SPW jest określona zgodnie z zasadami obowiązującymi na zorganizowanym elektronicznym rynku wtórnym SPW.

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 ponadto obowiązani do:

- 1) przesyłania do KDPW oraz NBP instrukcji rozliczeniowych umożliwiających tym instytucjom sporządzanie raportów według wzorów, określonych w załącznikach nr 1.1.-1.3 do regulaminu,
- 2) przesyłania NBP raportów, w formie określonej w załączniku nr 2 do regulaminu, dotyczących działań banku na rynku finansowym, w terminie do 8-go dnia kalendarzowego następującego po miesiącu sprawozdawczym,
- 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 przetargach, o których mowa w § 3 ust. 1, z zastrzeżeniem pkt 2 oraz § 22;

- 2) zakupów (wyłącznie przez tych 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 w 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 może ustalić maksymalne *spready* dla emisji bazowych oraz jest zobowiązany do sporządzania wykazów emisji bazowych, a także sporządzania wykazu SPW objętych fixingiem i podawania, co najmniej raz w roku, tych informacji do wiadomości publicznej w sposób, o którym mowa w § 21.

2. Wykaz emisji bazowych, maksymalne *spready* 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 oceny rocznej oraz oceny pośredniej DSPW oraz kandydatów na DSPW zgodnie z § 19 Regulaminu.

§ 11. Emitent oraz NBP, na podstawie udzielonego w umowie o pełnienie funkcji DSPW upoważnienia, ma prawo do dokonywania, w siedzibie Banku, weryfikacji informacji i danych przekazywanych Emitentowi, NBP i KDPW 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 rażącego naruszenia obowiązków DSPW, Emitent może pozbawić funkcji DSPW, poprzez rozwiązanie 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 § 21.

3. W przypadku rozwiązania umowy w trybie natychmiastowym Emitent może zawrzeć umowę o pełnienie funkcji DSPW z bankiem, który osiągnął największą liczbę punktów w ocenie rocznej w ostatnim konkursie na DSPW spośród banków, które nie uzyskały statusu DSPW. Umowa z tym bankiem jest zawierana 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, są stabilne i bezpieczne finansowo, podlegają krajowemu nadzorowi Komisji Nadzoru Bankowego, posiadają odpowiedni potencjał rozliczeniowy i ofertowy, działają w Polsce, dla których NBP, na mocy zawartych umów prowadzi bieżące rachunki bankowe,
- 2) są posiadaczami rachunków papierów wartościowych lub kont depozytowych bonów skarbowych prowadzonych w NBP oraz rachunków i kont depozytowych prowadzonych w KDPW,
- 3) w okresie wskazanym w oświadczeniu, o którym mowa w załączniku nr 3 do regulaminu, osiągnęły wartość nominalną obrotów brutto na rynku wtórnym bonów skarbowych nie mniejszą niż 1% lub obligacji skarbowych nie mniejszą niż 1% wartości nominalnej łącznych obrotów zarejestrowanych odpowiednio przez: NBP lub KDPW.

§ 14.1. Bank, który zamierza ubiegać się o uzyskanie statusu DSPW powinien przedłożyć Emitentowi pisemną deklarację oraz oświadczenie o spełnianiu warunków, o których mowa w § 13 ust. 2, według wzorów stanowiących załącznik nr 3 do regulaminu.

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 i 6 oraz akceptację postanowień § 10 - 12 ust. 1 regulaminu.

3. Emitent zastrzega sobie prawo zweryfikowania przedstawionego oświadczenia oraz odrzucenia deklaracji, w przypadku niespełnienia warunków, o których mowa w §13 ust. 2.

§ 15. Każdy z kandydatów na DSPW podlega ocenie według kryteriów określonych w regulaminie.

§ 16. 1. Podstawą obliczania 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, z zastrzeżeniem ust. 2; ocena jest 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 punktów,
- f) powyżej 10% – 6 punktów;

3) wartości nominalnej obrotów bonami skarbowymi zrealizowanych przez bank w ramach transakcji na zorganizowanym elektronicznym rynku wtórnym pomiędzy bankami z wyłączeniem transakcji negocjowanych oraz w ramach transakcji pomiędzy bankami i rezydentami nie będącymi bankami w stosunku do łącznej wartości nominalnej takich obrotów zrealizowanych przez DSPW oraz kandydatów na DSPW na zorganizowanym elektronicznym rynku wtórnym, z zastrzeżeniem ust. 2; ocena jest dokonywana według następującej skali:

- a) powyżej 0% do 2% włącznie – 2 punkty,
- b) powyżej 2% do 4% włącznie – 4 punkty,
- c) powyżej 4% do 6% włącznie – 6 punktów,
- d) powyżej 6% do 8% włącznie – 8 punktów,
- e) powyżej 8% do 10% włącznie – 10 punktów,
- f) 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, z zastrzeżeniem ust. 2; ocena 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 na zorganizowanym elektronicznym rynku wtórnym pomiędzy bankami z wyłączeniem transakcji negocjowanych oraz w ramach transakcji pomiędzy bankami i rezydentami nie będącymi bankami w stosunku do łącznej wartości nominalnej takich obrotów zrealizowanych przez DSPW oraz kandydatów na DSPW na zorganizowanym elektronicznym rynku wtórnym, z zastrzeżeniem ust. 2; ocena 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, z zastrzeżeniem ust. 2; ocena 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% – 6 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, z zastrzeżeniem ust. 2; ocena 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 oraz rynku kontraktów terminowych na obligacje zorganizowanego przez Giełdę Papierów Wartościowych w Warszawie S.A. w stosunku do łącznej wartości nominalnej obrotów zrealizowanych na tych rynkach przez DSPW oraz kandydatów na DSPW; ocena jest 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 jest 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;

10) wartości nominalnej obrotów bonami skarbowymi zrealizowanych przez bank w ramach transakcji repo, buy-sell back i sell-buy back w stosunku do łącznej wartości nominalnej takich obrotów zrealizowanych przez DSPW oraz kandydatów na DSPW, z zastrzeżeniem ust. 2 pkt 2; ocena 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% – 6 punktów;

11) wartości nominalnej obrotów obligacjami skarbowymi zrealizowanych przez bank w ramach transakcji repo, buy-sell back i sell-buy back w stosunku do łącznej wartości nominalnej takich obrotów zrealizowanych przez DSPW oraz kandydatów na DSPW, z zastrzeżeniem ust. 2 pkt 2; ocena 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.

2. Kryteria są wyliczane z uwzględnieniem następujących zasad:

- 1) w wartości obrotów, o których mowa w ust. 1 pkt 2-7 nie uwzględnia się transakcji repo, buy-sell back i sell-buy back, a w pkt 2 i 4 dodatkowo nie uwzględnia się transakcji zawartych z rezydentami nie będącymi bankami,
- 2) do liczby punktów uzyskanych z tytułu kryteriów, o których mowa w ust. 1 pkt 10 i 11 doliczany jest 1 pkt za każde 3% udziału wartości nominalnej obrotów bonami lub obligacjami skarbowymi zrealizowanych przez DSPW oraz kandydata na DSPW na zorganizowanym elektronicznym rynku wtórnym w ramach transakcji repo, buy-sell back i sell-buy back w sumie wartości nominalnej takich obrotów bonami lub obligacjami skarbowymi zrealizowanych przez DSPW oraz kandydatów na DSPW w danym okresie dokonywania oceny; maksymalna liczba dodatkowych punktów z tytułu takich transakcji w przypadku bonów skarbowych nie może wynieść więcej niż 3 pkt, a obligacji skarbowych – nie więcej niż 7 pkt.

§ 17. Ocena IAD obejmuje również ocenę DSPW oraz kandydata na DSPW pod względem:

- 1) liczby emisji innych niż emisje bazowe, będących przedmiotem zawartych transakcji na zorganizowanym elektronicznym rynku wtórnym SPW – max. 3 pkt,
- 2) doradzania Emitentowi w dziedzinie polityki emisyjnej SPW - max. 3 punkty,
- 3) innych wymagań, a w szczególności: wypełniania obowiązków stałego dwustronnego kwotowania emisji bazowych, działania na rzecz rozwoju przejrzystego i efektywnego rynku SPW – max. 3 pkt.

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

2. Kryteria, określone w §16 ust. 1 pkt 2, 3, 6 i 10, są obliczane w oparciu o transakcje rozliczone w Rejestrze Papierów Wartościowych prowadzonym przez NBP.
 3. Kryteria, określone w §16 ust. 1 pkt 4, 5, 7 i 11, są obliczane w oparciu o transakcje rozliczone przez KDPW.
 4. Kryteria, określone w §16 ust. 1 pkt 8 i 9, są obliczane w oparciu o dane przesłane przez DSPW i kandydatów na DSPW zgodnie z § 6 pkt 2 oraz w oparciu o dane KDPW.
 5. Wartość bonów lub obligacji skarbowych zakupionych przez poszczególnych DSPW, o której mowa w § 3 ust. 2, jest wyliczana z uwzględnieniem sumy bonów lub obligacji skarbowych zakupionych przez DSPW. Wyliczenia są dokonywane na podstawie danych NBP i KDPW. 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 jest dokonywane 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. Ocena pośrednia jest dokonywana co kwartał wg IAD określonego w dziale IV regulaminu i jest sumą punktów uzyskanych w ramach IAD oraz punktów ujemnych, o których mowa w § 3 ust. 3, § 4 ust. 3 oraz § 12 ust. 1.
2. Ocena roczna jest ustalana jako średnia trzech ocen pośrednich w okresie od stycznia do września (okres konkursu).
 3. Ocena roczna może być pomniejszona zgodnie z § 3 ust. 3, § 4 ust. 3 oraz § 12 ust. 1 także po zakończeniu okresu konkursu, do czasu ogłoszenia jego wyników.

§ 20.1. Emitent ma prawo zawarcia umowy o pełnienie funkcji DSPW na okres jednego roku z kandydatami na DSPW, którzy osiągnęli największą liczbę punktów w ocenie rocznej.

2. Lista banków, z którymi Emitent zawarł umowy o pełnienie funkcji DSPW, jest podawana do publicznej wiadomości w sposób, o którym mowa w § 21.

§ 21.1. Emitent ogłasza listę DSPW w serwisach informacyjnych oraz w serwisie internetowym Ministerstwa Finansów, po dokonaniu oceny rocznej oraz po każdorazowej zmianie tej listy.

2. Emitent przesyła 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. Postanowienia przejściowe i końcowe.

§ 22. 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.

§ 23. W przypadku zmian w regulaminie Emitent jest zobowiązany do poinformowania o nich DSPW, co najmniej na tydzień przed ich wejściem w życie.

§ 24. Regulamin wchodzi w życie z dniem 1 stycznia 2004 r.

MINISTER FINANSÓW

**Załącznik nr 1 do regulaminu
DSPW z dnia 5 grudnia 2003 r.**

Załącznik nr 1.1

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

w tys. zł, wg wartości
nominalnej

Wyszczególnienie	ogółem (3+4+5+6)	repo	buy-sell back i sell-buy back	kupno i sprzedaż	inne transakcje
1	2	3	4	5	6
I. Obligacje/bony 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/bonów 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		
				w tym: z DSPW	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					
	buy-sell back i 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/bonów skarbowych rozliczone przez
 (nazwa DSPW) w dniu

w tys. zł,

Wyszczególnienie	Transakcje rozliczane pieniężnie w KDPW /NBP		Transakcje rozliczane pieniężnie poza KDPW/NBP	Suma transakcji wg wartości nominalnej
	wg cen transakcyjnych	wg wartości nominalnej	wg wartości nominalnej	ogółem (3+4)
1	2	3	4	5
I. Obligacje/bony 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/NBP, na podstawie przesłanych instrukcji rozliczeniowych.

NAZWA BANKU DSPW

DATA

**INFORMACJA
O DZIAŁANIACH BANKU NA RYNKU FINANSOWYM
w 2004 roku**

I. Informacja o nieskarbowych instrumentach dłużnych.

1. Informacja o emisjach i emitentach nieskarbowych instrumentów dłużnych.

Dane o każdej serii emisji dokonanej w miesiącu sprawozdawczym przesyłają banki pełniące funkcję Agenta Emisji.

0.	Numer rozliczeniowy (nazwa) banku sprawozdającego	
	EMISJA	
1.	Pełna nazwa emitenta	
2.a.	Kategoria emitenta	
2.b.	rezydent / nierezydent	
3.	Instrument długoterminowy/krótkoterminowy	
4.	Rodzaj instrumentu dłużnego	
5.	Podstawa prawna emisji	
6.	Status emisji	
7.	Kod ISIN	
8.	Data emisji	
9.	Data zapadalności	
10.	Pierwotny okres zapadalności	
11.	Data zakończenia programu emisji	
12.	Czas trwania programu emisji	
13.	Wartość programu (limit zadłużenia) w mln jednostek	
14.	Waluta programu emisji (np. PLN, USD, EUR)	
15.	Wartość emisji (w mln jednostek waluty emisji)	
16.	Waluta emisji (np. PLN, USD, EUR)	
17.	Nominał (w tys jednostek waluty emisji)	
18.	Cena emisyjna (w walucie emisji)	
19.	Rodzaj oprocentowania	
20.	Formuła oprocentowania	
21.	Częstotliwość płatności kuponów	
22.	Data płatności pierwszego kuponu	
23.	Rynek wtórny	
24.	Wbudowane instrumenty pochodne, inne właściwości	
25.	Inne funkcje pełnione przez agenta emisji	
26.	Gwarant objęcia emisji – nazwa	
27.	Gwarant wykupu emisji – nazwa	
28.	Rating(i) emitenta długoterminowy	

Przekazuje się informacje o nieskarbowych instrumentach dłużnych wyemitowanych tylko na podstawie prawa polskiego.

Informację o każdej emisji prosimy przekazywać na **oddzielnej** stronie, na której powinna być umieszczona nazwa Państwa Banku.

Prosimy także o przekazywanie informacji o **emisjach, które zostały wykupione przed terminem zapadalności**. Dla takich emisji proszę wypełniać tabelę jak dla nowej emisji i wyraźnie dopisać tekst: **“Emisja wykupiona przed terminem zapadalności”**.

Uwagi:

Przekazuje się informacje jedynie o wartości emisji uplasowanych w miesiącu sprawozdawczym.

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.

Szczegółowa metodyka sprawozdawczości opisująca wszystkie kategorie wyszczególnione w powyższej tabeli zostanie przesłana Państwu pocztą elektroniczną.

Wszelkie pytania i wątpliwości dotyczące tego obszaru sprawozdawczości prosimy zgłaszać za pośrednictwem poczty elektronicznej na adres: **dsf.wrsf@mail.nbp.pl**

2. Nabywcy nieskarbowych instrumentów dłużnych.

Przekazuje się informacje o instrumentach dłużnych wyemitowanych tylko na podstawie prawa polskiego.

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

Poniższe 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 zostanie przekazana w terminie późniejszym.

2.1. Nabywcy bankowych papierów wartościowych emitowanych na podstawie Ustawy Prawo bankowe.

mln PLN	Bankowe papiery wartościowe o pierwotnym terminie zapadalności do jednego roku włącznie		Bankowe papiery wartościowe o pierwotnym terminie zapadalności powyżej jednego roku	
	REZYDENT	NIEREZYDENT	REZYDENT	NIEREZYDENT
TYP INWESTORA				
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)				
Międzynarodowe instytucje finansowe	X		X	
Razem				

2.2. Nabywcy obligacji bankowych emitowanych na podstawie Ustawy o obligacjach.

mln PLN	Obligacje bankowe o pierwotnym terminie zapadalności do jednego roku włącznie		Obligacje bankowe o pierwotnym terminie zapadalności powyżej jednego roku	
	REZYDENT	NIEREZYDENT	REZYDENT	NIEREZYDENT
TYP INWESTORA				
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)				
Międzynarodowe instytucje finansowe	X		X	
Razem				

2.3. Nabywcy listów zastawnych emitowanych na podstawie Ustawy o listach zastawnych i bankach hipotecznych oraz obligacji komunalnych (emitowanych przez jednostki samorządu terytorialnego: miasta, gminy, powiaty, województwa)

mln PLN	Listy zastawne		Obligacje komunalne	
	REZYDENT	NIEREZYDENT	REZYDENT	NIEREZYDENT
TYP INWESTORA				
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)				
Międzynarodowe instytucje finansowe	X		X	
Razem				

2.4. Nabywcy innych nieskarbowych instrumentów dłużnych (w tym: obligacji korporacyjnych, krótkoterminowych instrumentów dłużnych emitowanych na podstawie Ustawy o obligacjach, Prawa wekslowego, Kodeksu cywilnego)

mln PLN	Inne instrumenty dłużne o pierwotnym terminie zapadalności do jednego roku		Inne instrumenty dłużne o pierwotnym terminie zapadalności powyżej jednego roku	
	REZYDENT	NIEREZYDENT	REZYDENT	NIEREZYDENT
TYP INWESTORA				
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)				
Międzynarodowe instytucje finansowe	X		X	
Razem				

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) Narodowy Fundusz Zdrowia, ZUS, KRUS
- 9) jednostki samorządu terytorialnego (JST): 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).

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

1. Obroty na RYNKU WTÓRNYM nieskarbowych instrumentów dłużnych w mln PLN.

Przekazuje się informacje o instrumentach dłużnych wyemitowanych **tylko na podstawie prawa polskiego** – (emisje zarówno niepubliczne, jak i publiczne). 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). **Nie wykazuje się transakcji warunkowych.**

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).

Obroty w mln PLN	z bankami	z niebankami
Obligacje NBP		
Bankowe papiery wartościowe o pierwotnym terminie zapadalności do 1 roku łącznie		
Bankowe papiery wartościowe o pierwotnym terminie zapadalności powyżej jednego roku		
Obligacje bankowe o pierwotnym terminie zapadalności do 1 roku łącznie		
Obligacje bankowe o pierwotnym terminie zapadalności powyżej jednego roku		
Listy zastawne		
Obligacje komunalne		
Inne instrumenty dłużne o pierwotnym terminie zapadalności do 1 roku łącznie		
Inne instrumenty dłużne o pierwotnym terminie zapadalności powyżej jednego roku		

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

2. 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 instrumentu dłużnego	Nominowany w PLN		Nominowany w Euro		Nominowany w pozostałej walucie obcej	
	Wyemitowany przez:		Wyemitowany przez:		Wyemitowany przez:	
	REZYDENTA	NIEREZYDENT	REZYDENTA	NIEREZYDENTA	REZYDENTA	NIEREZYDENT
		A				A
Obligacje skarbowe		X		X		X
Bankowe papiery wartościowe o pierwotnym terminie zapadalności do 1 roku włącznie 1)						
Bankowe papiery wartościowe o pierwotnym terminie zapadalności powyżej 1 roku 1)						
Obligacje bankowe o pierwotnym terminie zapadalności do 1 roku włącznie 2)						
Obligacje bankowe o pierwotnym Terminie zapadalności powyżej 1 roku 2)						
Listy zastawne						
Obligacje komunalne						
Inne instrumenty dłużne o						

pierwotnym terminie zapadalności do 1 roku włącznie 3)						
Inne instrumenty dłużne o pierwotnym terminie zapadalności powyżej 1 roku 3)						

1) bankowe papiery wartościowe emitowane na podstawie Ustawy Prawo bankowe

2) bankowe papiery wartościowe emitowane na podstawie Ustawy o obligacjach

3) instrumenty dłużne emitowane na podstawie Ustawy o obligacjach, Kodeksu cywilnego, Prawa wekslowego

3. Transakcje warunkowe

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

3.1. Transakcje REPO i REVERSE REPO (z wyłączeniem operacji dokonanych z NBP) rozpoczętych (i już zakończonych, jak i niezakończonych) w danym miesiącu sprawozdawczym w mln PLN.

	Instrument zabezpieczający	Bony pieniężne NBP		Obligacje NBP		Obligacje skarbowe		Pozostałe instrumenty dłużne	
		K/PO	S/PO	K/PO	S/PO	K/PO	S/PO	K/PO	S/PO
1.	Monetarne instytucje finansowe								
2.	Instytucje niebankowe	X	X						
2.a	Instytucje ubezpieczeniowe	X	X						
2.b	Fundusze emerytalne	X	X						
2.c	Fundusze inwestycyjne	X	X						
2.d	Przedsiębiorstwa	X	X						
2.e	Pozostałe kategorie	X	X						
3.	Nierezydenci	X	X						
	Razem								
	STRUKTURA TERMINOWA	K/PO	S/PO	K/PO	S/PO	K/PO	S/PO	K/PO	S/PO
1.	1 dniowe								
2.	Powyżej 1 dnia do 7 dni włącznie								
3.	Powyżej 7 dni do 1 miesiąca włącznie								
4.	Powyżej 1 do 3 miesięcy włącznie								
5.	Powyżej 3 do 6 miesięcy włącznie								
6.	Powyżej 6 miesięcy								
	Razem								

K/PO – kupno z przyrzeczeniem odsprzedaży

S/PO – sprzedaż z przyrzeczeniem odkupu

3.2. Transakcje SELL-BUY BACK i BUY-SELL-BACK (z wyłączeniem operacji dokonanych z NBP) rozpoczętych (i już zakończonych, jak i niezakończonych) w danym miesiącu sprawozdawczym w mln PLN.

	Instrument zabezpieczający	Bony pieniężne NBP		Obligacje NBP		Obligacje skarbowe		Pozostałe instrumenty dłużne	
		SBB	BSB	SBB	BSB	SBB	BSB	SBB	BSB
	KATEGORIA KONTRAHENTA								
1.	Monetarne instytucje finansowe								
2.	Instytucje niebankowe	X	X						
2.a	Instytucje ubezpieczeniowe	X	X						
2.b	Fundusze emerytalne	X	X						
2.c	Fundusze inwestycyjne	X	X						
2.d	Przedsiębiorstwa	X	X						
2.e	Pozostałe kategorie	X	X						
3.	Nierezydenci	X	X						
	Razem								
	STRUKTURA TERMINOWA	SBB	BSB	SBB	BSB	SBB	BSB	SBB	BSB
1.	1 dniowe								
2.	Powyżej 1 dnia do 7 dni włącznie								
3.	Powyżej 7 dni do 1 miesiąca włącznie								
4.	Powyżej 1 do 3 miesięcy włącznie								
5.	Powyżej 3 do 6 miesięcy włącznie								
6.	Powyżej 6 miesięcy								
	Razem								

SBB – sell-buy-back

BSB – buy-sell-back

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

Imię i nazwisko:
tel. fax.:

Funkcja:
Pieczęć i podpis:

Departament:

III. Informacja o obrotach na pozagiełdowym rynku instrumentów pochodnych i rynku walutowym

1. Instrumenty pochodne na kurs walutowy i stopę procentową

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

Lp.	Rodzaj kontraktu	Kwoty zakupione	Kwoty sprzedane	Razem obroty
1.	Kontrakty IRS			
1.1.	z rezydentami w tym:			
1.1.1	bankami			
1.1.2.	podmiotami niebankowymi			
1.2.	z nierezydentami			
2.	Kontrakty FRA			
2.1.	z rezydentami w tym:			
2.1.1	bankami			
2.1.2.	podmiotami niebankowymi			
2.2.	z nierezydentami			
3.	Kontrakty CIRS	X	X	
3.1.	z rezydentami w tym:	X	X	
3.1.1.	bankami	X	X	
3.1.2.	podmiotami niebankowymi	X	X	
3.2.	z nierezydentami	X	X	
4.	Opcje walutowe na kurs USD/PLN			
4.1.	z rezydentami w tym:			
4.1.1.	bankami			
4.1.2	podmiotami niebankowymi			
4.2.	z nierezydentami			
5.	Opcje walutowe na kurs EUR/PLN			
5.1.	z rezydentami w tym:			
5.1.1.	bankami			
5.1.2.	podmiotami niebankowymi			
5.2.	z nierezydentami			
6..	Opcje na stopę procentową			
6.1.	z rezydentami w tym:			
6.1.1	bankami			
6.1.2.	podmiotami niebankowymi			
6.2.	z nierezydentami			

IRS i FRA

Przekazuje się informacje tylko o kontraktach, w których kwota nominalna transakcji jest denominowana w PLN. Kupno IRS oznacza dokonywanie płatności odsetkowych obliczonych według stałej stopy procentowej.

CIRS

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

Strategie opcyjne

Każda pojedyncza opcja składająca się na strategię opcyjną (np. straddle, risk reversla) powinna być sprawozdana oddzielnie odpowiednio jako opcja kupiona lub sprzedana.

1.2 Struktura terminowa obrotów wg wartości nominalnej instrumentów wyrażonej w mln PLN (informacja o kontraktach ZAWARTYCH w okresie sprawozdawczym).

IRS, CIRS

Pierwotny termin zapadalności	Kontrakty IRS	Kontrakty CIRS
Ogółem 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

Pierwotny termin wykonania	Opcje na kurs USD/PLN	Opcje na kurs EUR/PLN	Opcje na stopę procentową
Ogółem 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)

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

2. Obroty 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 zawarcia transakcji** po kursie ogłaszającym przez NBP, o którym mowa w Uchwale 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) z późniejszymi zmianami.

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 (najczęściej “nogi spot”) nie wykazuje się w transakcjach kasowych.

2.1 WALUTA OBCA – WALUTA OBCA

Transakcje zawarte w miesiącu sprawozdawczym w **mln PLN**.

TYP TRANSAKCJI i termin zapadalności	OGÓŁEM	w tym	
		EUR	USD
1	2	3	4
1. Natychmiastowe SPOT			
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>			
2. Terminowe			
2.1. Outright forward			
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>			
2.2. FX swap			
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>			
3. Terminy zapadalności wiersz 2			
3.1. do 7 dni			
3.2. powyżej 7 dni i do 1 miesiąca			
3.3. powyżej 1 i do 3 miesięcy			
3.4. powyżej 3 miesięcy i do roku			
3.5. ponad 1 rok			

2.2 WALUTA OBCA – ZŁOTY

Transakcje zawarte w miesiącu sprawozdawczym w mln PLN.

TYP TRANSAKCJI i termin zapadalności	OGÓŁEM	w tym	
		EUR	USD
1	2	3	4
1. Natychmiastowe SPOT			
1.1 z bankami rezydentami			
1.2. z bankami nierezydentami			
1.3. z pod. niebankowymi			
1.3.a. rezydentami			
1.3.b. nierezydentami			
2. Terminowe			
2.1. Outright forward			
2.1.1 z bankami rezydentami			
2.1.2. z bankami nierezydentami			
2.1.3. z pod. niebankowymi			
2.1.3.a. rezydentami			
2.1.3.b. nierezydentami			
2.2. FX swap			
2.2.1 z bankami rezydentami			
2.2.2. z bankami nierezydentami			
2.2.3. z pod. niebankowymi			
2.2.3.a. rezydentami			
2.2.3.b. nierezydentami			
3. Terminy zapadalności wiersz 2			
3.1. do 7 dni			
3.2. powyżej 7 dni i do 1 miesiąca			
3.3. powyżej 1 i do 3 miesięcy			
3.4. powyżej 3 miesięcy i do roku			
3.5. ponad 1 rok			

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

1.

(pieczęć firmowa Banku)

DEKLARACJA

Niniejszym deklarujemy zamiar przystąpienia do konkursu na wybór DSPW na 2005 r. odbywającego się od dnia 1 stycznia do dnia 30 września 2004 r. W związku z tym 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:

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

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 rocznej określonej w Regulaminie, jako oceny uzyskanej w wyniku postępowania kwalifikacyjnego.

*(pieczęcie i podpisy osób
upoważnionych do reprezentowania Banku)*

2.

(pieczęć firmowa Banku)

OŚWIADCZENIE

Bank(nazwa)..... oświadcza, że w okresie od października 2002 r. do września 2003 r. osiągnął obrót na rynku wtórnym o łącznej wartości nominalnej:

- bonów skarbowych -PLN,
- obligacji skarbowych -PLN,

to jest nie mniej niż 1% łącznej wartości nominalnej obrotów bonami lub obligacjami skarbowych zarejestrowanej przez odpowiednio: Narodowy Bank Polski lub Krajowy Depozyt Papierów Wartościowych S.A.

Ponadto Bank(nazwa)..... oświadcza, że jest posiadaczem rachunków papierów wartościowych lub kont depozytowych bonów skarbowych oraz rachunku bieżącego prowadzonych przez Narodowy Bank Polski oraz rachunków i kont depozytowych prowadzonych przez Krajowy Depozyt Papierów Wartościowych S.A.

*(pieczęcie i podpisy osób
upoważnionych do reprezentowania Banku)*