

Třídící znak							
2	1	8	1	5	6	1	0

ÚŘEDNÍ SDĚLENÍ ČESKÉ NÁRODNÍ BANKY

ze dne 18. prosince 2015

o vydání druhé verze

Pravidel pro výpočet referenční úrokové sazby CZEONIA

- I.** Česká národní banka sděluje, že vydává druhou verzi Pravidel pro výpočet referenční úrokové sazby CZEONIA (dále jen „Pravidla“).
- II.** Pravidla tvoří přílohu tohoto úředního sdělení.
- III.** Dnem 1. ledna 2016 se nahrazuje úřední sdělení České národní banky č. 17/2001 ze dne 14. prosince 2001 o vydání Pravidel pro výpočet referenční úrokové sazby CZEONIA, uveřejněné ve Věstníku ČNB, částka 20/2001 dne 19. prosince 2001.
- IV.** Podle Pravidel vydaných tímto úředním sdělením se postupuje od 1. ledna 2016.

Viceguvernér

Ing. Mojmír Hampl, MSc., Ph.D. v. r.

Příloha: Pravidla pro výpočet referenční úrokové sazby CZEONIA

Sekce bankovních obchodů
Odpovědný zaměstnanec:
Ing. Zavadil, tel. 224415003

PRAVIDLA
PRO VÝPOČET REFERENČNÍ ÚROKOVÉ SAZBY
CZEONIA

leden 2016

I. Vymezení pojmů

Pro účely Pravidel se pod následujícími pojmy rozumí:

- a) "Referenční banka" je banka, již byl udělen statut referenční banky podle části II. Pravidel pro referenční banky a výpočet (fixing) referenčních úrokových sazeb PRIBOR¹,
- b) "CZEONIA" (CZEch OverNight Index Average) je vážený průměr úrokových sazeb všech nezajištěných O/N depozit uložených referenčními bankami na mezibankovním trhu.

II. Výpočet referenční úrokové sazby CZEONIA

(1) Referenční úrokovou sazbu CZEONIA počítá a uveřejňuje ČNB na základě údajů dodaných referenčními bankami.

(2) Referenční banky jsou povinny předávat ČNB pro výpočet referenční úrokové sazby CZEONIA:

- a) celkový objem všech nezajištěných O/N depozit uložených referenčními bankami na mezibankovním trhu,
- b) průměrnou úrokovou sazbu uskutečněných obchodů váženou podle objemu jednotlivých obchodů.

(3) Pro účely výpočtu celkového objemu a průměrné úrokové sazby dle předcházejícího odstavce vyjde referenční banka ze všech depozitních obchodů, které splňují následující podmínky:

- a) jsou uzavřeny a vypořádány v den výpočtu se splatností v nejbližší následující pracovní den po dni výpočtu (tzv. O/N splatnost),
- b) referenční banka je poskytovatelem peněžních prostředků,
- c) protistranou je banka nebo pobočka zahraniční banky se sídlem v České republice nebo ČNB,
- d) protistrana neposkytuje věřiteli žádné zajištění.

(4) Referenční banky jsou povinny uvedené informace předat ČNB každý pracovní den nejpozději 15 minut po ukončení účetního dne systému mezibankovního platebního styku CERTIS, provozovaném ČNB. Částka transakcí se zaokrouhluje matematicky na celé miliony CZK, průměrná úroková sazba se zaokrouhluje matematicky na dvě desetinná místa.

(5) V případě pochybností o správnosti dodaných dat může ČNB zkontaktovat nesrovnalosti přímo s dotyčnou referenční bankou.

(6) Hodnota referenční úrokové sazby CZEONIA se vypočítá jako vážený průměr úrokových sazeb dodaných referenčními bankami zaokrouhlený na dvě desetinná místa. Váhami jsou objemy depozit uložených jednotlivými referenčními bankami.

¹ Úřední sdělení ČNB č 3/2015 ze dne 1. 4. 2015 uveřejněné ve Věstníku ČNB č. 3/2015

(7) Způsob výpočtu hodnoty referenční úrokové sazby CZEONIA dle odstavců 1 až 6 může měnit ČNB po konzultaci s The Financial Markets Association of the Czech Republic (A.C.I.).

III.

Uveřejňování a dostupnost hodnot referenční úrokové sazby CZEONIA

Hodnota referenční úrokové sazby CZEONIA a objem zobchodovaných depozit pro daný den budou uveřejněny bezprostředně po ukončení procedury výpočtu prostřednictvím informačních agentur a způsobem umožňujícím dálkový přístup.

IV.

Uveřejňování a změny Pravidel

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

V.

Účinnost

Tato Pravidla nabývají účinnosti dnem 1. ledna 2016.