

| Třídící znak | | | | | | | |
|--------------|---|---|---|---|---|---|---|
| 2 | 1 | 6 | 1 | 8 | 6 | 1 | 0 |

ÚŘEDNÍ SDĚLENÍ ČESKÉ NÁRODNÍ BANKY

ze dne 28. června 2018

o vydání třetí verze Pravidel pro výpočet referenční úrokové sazby CZEONIA

- I. Česká národní banka sděluje, že vydává třetí verzi Pravidel pro výpočet referenční úrokové sazby CZEONIA (dále jen „Pravidla“).
- II. Pravidla tvoří přílohu tohoto úředního sdělení.
- III. Dnem vyhlášení se nahrazuje úřední sdělení České národní banky č. 17/2015 ze dne 18. prosince 2015 o vydání druhé verze Pravidel pro výpočet referenční úrokové sazby CZEONIA, uveřejněné ve Věstníku ČNB, částka 14/2015 dne 21. prosince 2015.
- IV. Podle Pravidel vydaných tímto úředním sdělením se postupuje ode dne vyhlášení.

Viceguvernér
Ing. Mojmír Hampl, MSc., Ph.D. v. r.

Příloha: Pravidla pro výpočet referenční úrokové sazby CZEONIA

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

PRAVIDLA
PRO VÝPOČET REFERENČNÍ ÚROKOVÉ SAZBY
CZEONIA

červen 2018

I. Vymezení pojmů

Pro účely Pravidel se pod následujícími pojmy rozumí:

- a) "Referenční banka" je banka, jíž byl udělen statut referenční banky podle článku III,
- 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 předávají 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 předávají informace podle odst. 2 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 Kč, 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.

(7) Hodnota referenční úrokové sazby CZEONIA a objem zobchodovaných depozit pro daný den budou uveřejněny prostřednictvím informačních agentur a způsobem umožňujícím dálkový přístup bezprostředně po ukončení procedury výpočtu. Není-li v daném dni uskutečněn referenčními banky žádný obchod podle odst. 3, nebude pro tento den úroková sazba CZEONIA stanovena.

(8) Referenční banky nastaví účinný mechanismus kontroly správnosti předávaných dat.

III.

Referenční banky

- (1) Žádost o udělení statutu referenční banky zasílá banka odboru korunových a devizových intervencí ČNB.
- (2) O udělení statutu referenční banky rozhoduje ČNB do 30 dnů po obdržení žádosti.
- (3) ČNB může odebrat bance status referenční banky v případě opakovaného závažného porušování Pravidel, příp. na žádost banky.
- (4) Seznam referenčních bank zveřejňuje ČNB 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 vyhlášení.