

ČESKÁ ČNB NÁRODNÍ BANKA

VĚSTNÍK

Částka 23

Ročník 1999

Vydáno dne 27. prosince 1999

Obsah :

ČÁST OZNAMOVACÍ

24. Úřední sdělení České národní banky o změně ^(č. 9) Pravidel pro primární prodej střednědobých státních dluhopisů
25. Úřední sdělení České národní banky o podmínkách tvorby povinných minimálních rezerv
22. 12. 1999 : Věstník 23. 12. 1999

Pravidla pro primární prodej střednědob. státních dluhopisů organizovaný ČNB (Věstník č. 4/1997)

Změna	Věstník č.	platnost od
č. 1	13/1997	(1.8.1997)
č. 2	2/1998	(26.1.1998)
č. 3	7/1998	(4.5.1998)
č. 4	14/1998	(27.7.1998)
č. 5	22/1998	(27.10.1998)
č. 6	3/1999	(21.1.1999)
č. 7	9/1999	(27.4.1999)
č. 8	16/1999	(30.9.1999)
č. 9	23/1999	(30.12.1999)
č. 10	2/2000	(27. 2. 2000)

**Pravidla pro primární prodej
střednědob. státních dluhopisů
organizovaný ČNB (Věstník č. 4/1997)**

Změna	Věstník č.	platnost od
č. 1	13/1997	(1.8.1997)
č. 2	2/1998	(26.1.1998)
č. 3	7/1998	(4.5.1998)
č. 4	14/1998	(27.7.1998)
č. 5	22/1998	(27.10.1998)
č. 6	3/1999	(21.1.1999)
č. 7	9/1999	(27.4.1999)
č. 8	16/1999	(30.9.1999)
č. 9	23/1999	(30.12.1999)

C

Třídící znak							
2	2	4	9	9	6	1	1

ÚŘEDNÍ SDĚLENÍ ČESKÉ NÁRODNÍ BANKY

o změně

Pravidel pro primární prodej střednědobých státních dluhopisů
organizovaný Českou národní bankou

Česká národní banka provedla v souladu s § 20 Pravidel pro primární prodej střednědobých státních dluhopisů organizovaný Českou národní bankou (dále jen "Pravidla") s účinností od 30. prosince 1999 změnu Pravidel.

Změna má pořadové číslo 9 týká se:
strany 6 - nahrazena novou

Nová strana je uvedena v příloze.

Vrchní ředitel
RNDr. Niedermayer, v.r.

Příloha

Sekce bankovních obchodů
Odpovědný zaměstnanec:
Ing. Janda, tel. 2441 4418

e) podklady dokumentující plnění povinností PÚ vyplývajících z Pravidel (odst. 1 písm. h/).

(4) Seznam PÚ pro SD zveřejňovaný ČNB bude obsahovat zejména jméno a sídlo PÚ.

§ 8

Žádost o zařazení mezi přímé účastníky

(1) Žadatel o zařazení mezi PÚ (dále v části druhé jen "žadatel") podává ČNB písemnou žádost o zařazení mezi PÚ na kontaktní adresu.

(2) Žadatel v době podání žádosti musí splňovat následující podmínky:

a) vyhovuje § 4 odst. 1 a 2,

b) vyhovuje § 7 odst. 1 písm. a) až d),

c) ve třech aukcích předcházejících podání žádosti se pravidelně prostřednictvím některého (resp. některých) PÚ zúčastňoval všech aukcí SD vyhlášených ČNB vždy s celkovou objednávkou alespoň ve výši 50 mil. Kč,

d) jeho podíl na celkovém měsíčním obratu všech PÚ na sekundárním trhu SD činil alespoň 1% nejméně ve dvou měsících v kalendářním čtvrtletí předcházejícímu podání žádosti,

e) je schopen splnit ostatní podmínky kladené na PÚ v rozsahu § 7 odst. 1 písm. e) až n).

(3) V příloze žádosti uvede žadatel

a) podklady podle § 7 odst. 3 písm. b) až e),

b) informace o svých objednávkách v aukcích SD za období tří aukcí předcházejících podání žádosti,

c) údaje o měsíčních obrazech na sekundárním trhu SD za kalendářní čtvrtletí předcházející podání žádosti v členění podle čtvrtletního hlášení PÚ.

§ 9

Vyřizování žádosti o zařazení mezi přímé účastníky

(1) ČNB do 30 dnů po obdržení žádosti požádá žadatele o případné doplňující údaje.

(2) ČNB žadateli sdělí, do 30 dní po obdržení kompletní žádosti, zda jeho žádost byla přijata a projedná s ním výši jeho aukčních limitů a termín jeho zařazení mezi PÚ.

(3) Mezi PÚ je žadatel zařazen zpravidla v prvním měsíci kalendářního čtvrtletí.

(4) Zprávu o zařazení žadatele mezi PÚ zveřejní ČNB ve Věstníku ČNB a v Hospodářských novinách, popř. i jiným způsobem.

(5) V případě nepřijetí žádosti sdělí ČNB žadateli tuto skutečnost písemně ve lhůtě podle odst. 2.

(6) Na zařazení mezi PÚ není nárok a ČNB není povinna nepřijetí žádosti žadateli zdůvodňovat.

§ 10

Vyřazení ze skupiny přímých účastníků

Vyřadit ze skupiny PÚ lze

a) na základě žádosti PÚ o vyřazení ze skupiny PÚ,

b) postupem podle části páté Pravidel v rámci sankcí při porušení Pravidel.

Třídící znak							
2	2	5	9	9	6	1	1

ÚŘEDNÍ SDĚLENÍ ČESKÉ NÁRODNÍ BANKY

o podmínkách tvorby povinných minimálních rezerv

Česká národní banka (dále jen "ČNB") podle § 25 a § 26 zákona č. 6/1993 Sb., o České národní bance, ve znění pozdějších předpisů stanoví pro tvorbu povinných minimálních rezerv (dále jen "PMR") tyto podmínky:

1. Povinné minimální rezervy udržuje banka a pobočka zahraniční banky (dále jen "banka") ve formě průměrného čtrnáctidenního stavu ve stanoveném procentním rozsahu z primárních závazků vůči nebankovním klientům. Banka je povinna vést tyto prostředky na svém účtě u ČNB. PMR se neúročí.
2. PMR bank a poboček zahraničních bank včetně stavebních spořitelů a Českomoravské záruční a rozvojové banky, a.s. činí 2% ze všech primárních závazků vůči všem osobám s výjimkou bank¹⁾. Tento stav se stává požadovanou průměrnou výší PMR v rozhodném období. Rozhodným obdobím je čtrnáctidenní cyklus začínající čtvrtkem 7.10.1999 a dále pak každým druhým čtvrtkem po tomto datu.
3. Stanovená výše PMR vychází z průměru tří stavů primárních závazků dle tří posledních po sobě jdoucích a ČNB prověřených dekádních přehledů o stavu aktiv a pasív, uvedených v příloze.
4. Primární závazky se zjistí z dekádního přehledu o aktivech a pasívech V(ČNB-Ds) 6-36, části 2 (Pasiva) podle vzorce: ř. 9 + ř.19 + ř 23 -ř, 32

ř. 9 - vklady orgánů republiky a místních orgánů celkem
(při použití výkazu r. 1999 ř.45+65, při použití výkazu V(ČNB)21-09 ř 2)

ř.19 - vklady a ostatní úvěry přijaté od klientů celkem
(při použití výkazu r. 1999 ř.56+66, při použití výkazu V(ČNB)21-09 ř 3)

ř.23 - emitované dlužné cenné papíry se splatností do 5 let
(při použití výkazu r. 1999 ř.60+69, při použití výkazu V(ČNB)21-09 ř 4)

ř.32 - emitované dluhopisy se splatností do 5 let registrované v držení bank
(při použití výkazu r. 1999 ř.76+78, při použití výkazu V(ČNB)21-09 ř 5)

¹⁾ Opatření ČNB ze dne 20.5.1999, kterým se stanoví minimální výše likvidních prostředků, zveřejněné ve Sbírce zákonů č. 43/1999

5. Povinnosti tvorby PMR nepodléhají emitované dluhopisy s dobou splatnosti pět a více let od data vydání s výjimkou následujících případů:
- emitent si vyhradí podle § 12 odst.2 zákona č.530/1990 Sb., o dluhopisech, ve znění pozdějších předpisů, možnost předčasného splacení dluhopisu v jeho nominální hodnotě, nebo v hodnotě vyšší - v prospektu uvedené, které bude uskutečněno do pěti let od data vydání dluhopisu,
 - emitent se zaváže vůči majiteli dluhopisu podle §12 odst. 3 zákona č. 530/1990 Sb., o dluhopisech, ve znění pozdějších předpisů, k předčasnému splacení dluhopisu v jeho nominální hodnotě do pěti let od data vydání dluhopisu, které není vázáno na žádné jiné podmínky, než projevení vůle majitele dluhopisu žádat jeho předčasné splacení.

Pokud by se emitent zavázal pouze k předčasnému splacení dluhopisu na žádost majitele, který může toto předčasné splacení požadovat jen v případě, že nastanou podmínky pro předčasné splacení v emisních podmínkách specifikované, tato emise dluhopisů povinnosti tvorby PMR nepodléhá.

6. Banka je povinna si stanovenou výši PMR sama vypočítat a odsouhlasit telefonicky s ČNB. PMR se stanoví na celé koruny.
7. Při nepředložení jednoho dekádního přehledu, potřebného ke stanovení základny pro výpočet stanovené výše PMR, se základ vypočítá průměrem pouze ze dvou stavů, ale hodnota průměru se zvýší o 20 %. Při nepředložení dvou dekádních přehledů se vychází z jediného údaje, který se zvýší o 40%. Na opožděné předložení dekádního přehledu či opravy po termínu stanoveném pro předložení tohoto výkazu nebere ČNB zřetel.
8. Způsob výpočtu skutečně dosažené průměrné výše PMR se řídí:
- časovým základem, který je vždy 14 dní,
 - skutečnými kreditními zůstatky účtu banky v clearingovém centru ČNB, maximálně však:
 - ve výši stanovené PMR, navýšené o 10% u bank se stanovenou výší PMR 1 mld Kč a více, přičemž tato započitatelná odchylka se stanoví na celé Kč. Zaokrouhlená číslice, po které následuje číslice menší než 5, zůstává beze změny, zaokrouhlená číslice, po které následuje číslice 5 nebo větší než 5 se zvětšuje o jednu
 - ve výši stanovené PMR navýšené o 100 mil. Kč u bank se stanovenou výší pod 1 mld Kč
9. V případě nedodržení stanovené průměrné výše PMR zaplatí banka úrok ve výši platné lombardní sazby zvýšené o 6% (maximálně však ve výši trojnásobku platné diskontní sazby)²⁾, za dodatečný refinanční úvěr, zpětně kryjící chybějící průměrnou výši PMR v rozhodném čtrnáctidenním období. Úrok se stanoví z rozdílu mezi stanovenou výší a skutečně dosaženou výší PMR, sazby úroku za nedodržení PMR (dále jen "sazby úroku"), počtu dní rozhodného období, v němž došlo k nedodržení (tj. vždy 14 dní) a počtu dní v roce (365). Úrok zúčtuje ČNB inkasní formou k tíži vnitřního účtu bank pro zúčtování úroků. Inkaso provede ČNB vždy ve čtvrtek následujícího kalendářního týdne po skončení rozhodného období, tj. uprostřed následujícího cyklu PMR. Pokud na tento den připadne státní svátek, bude úrok zúčtován poslední pracovní den před tímto svátkem.

²⁾ § 26 odst. 1 zákona č. 6/1993 Sb., o České národní bance

V případě změny sazby úroku za nedodržení PMR v průběhu rozhodného období se úrok za nedodržení průměrné výše PMR stanoví podle bodu 9 těchto podmínek, jako součet částek, při použití:

- a) staré sazby úroku za kalendářní dny od prvního dne rozhodného období do dne předcházejícího den splatnosti nové sazby úroku
- b) nové sazby úroku za kalendářní dny ode dne platnosti nové sazby úroku do konce rozhodného období

10. Povinnost banky udržovat PMR končí počátkem rozhodného období povinných minimálních rezerv podle bodu 2 těchto podmínek, ve kterém zaniká povolení působit jako banka³⁾.

✓ 11. Ruší se Úřední sdělení České národní banky o podmínkách tvorby povinných minimálních rezerv zveřejněné ve Věstníku ČNB, částce 16/1999.

12. Podmínky vstupují v platnost 27.1.2000.

Vrchní ředitel
RNDr. Niedermayer, v.r.

Přílohy:

č.1: Přehled termínů pro propočet PMR v roce 2000

Sekce bankovních obchodů
Odpovědný zaměstnanec
Ing. Hiršalová, tel. 02/ 2441 4472

³⁾ §7a) zákona č. 21/1992 Sb., o bankách

Přehled termínů pro propočítání PMR v roce 2000

PMR - udržovací období od do	Termín zúčtování úroku za nedodržení PMR	Dekádní přehled aktiv a pasiv	Počet dní cyklu
30.12.1999 - 12.01.2000 včetně	01/20/00	20/11, 30/11, 10/12	14
13.01.2000 - 26.01.2000 včetně	02/03/00	30/11, 10/12, 20/12	14
27.01.2000 - 09.02.2000 včetně	02/17/00	20/12, 31/12, 10/1 *	14
10.02.2000 - 23.02.2000 včetně	03/02/00	31/12, 10/1*, 20/1 *	14
24.02.2000 - 08.03.2000 včetně	03/16/00	20/1*, 31/1, 10/2	14
09.03.2000 - 22.03.2000 včetně	03/30/00	31/1, 10/2, 20/2	14
23.03.2000 - 05.04.2000 včetně	04/13/00	20/2, 28/2, 10/3	14
06.04.2000 - 19.04.2000 včetně	04/27/00	28/2, 10/3, 20/3	14
20.04.2000 - 03.05.2000 včetně	05/11/00	10/3, 20/3, 31/3	14
04.05.2000 - 17.05.2000 včetně	05/25/00	31/3, 10/4, 20/4	14
18.05.2000 - 31.05.2000 včetně	06/08/00	10/4, 20/4, 30/4	14
01.06.2000 - 14.06.2000 včetně	06/22/00	30/4, 10/5, 20/5	14
15.06.2000 - 28.06.2000 včetně	07/04/00	10/5, 20/5, 31/5	14
29.06.2000 - 12.07.2000 včetně	07/18/00	20/5, 31/5, 10/6	14
13.07.2000 - 26.07.2000 včetně	08/01/00	31/5, 10/6, 20/6	14
27.07.2000 - 09.08.2000 včetně	08/15/00	20/6, 30/6, 10/7	14
10.08.2000 - 23.08.2000 včetně	08/29/00	30/6, 10/7, 20/7	14
24.08.2000 - 06.09.2000 včetně	09/12/00	20/7, 31/7, 10/8	14
07.09.2000 - 20.09.2000 včetně	09/26/00	31/7, 10/8, 20/8	14
21.09.2000 - 04.10.2000 včetně	10/10/00	10/8, 20/8, 31/8	14
05.10.2000 - 18.10.2000 včetně	10/24/00	31/8, 10/9, 20/9	14
19.10.2000 - 01.11.2000 včetně	11/07/00	10/9, 20/9, 30/9	14
02.11.2000 - 15.11.2000 včetně	11/21/00	30/9, 10/10, 20/10	14
16.11.2000 - 29.11.2000 včetně	12/05/00	10/10, 20/10, 31/10	14
30.11.2000 - 13.12.2000 včetně	12/19/00	20/10, 31/11, 10/11	14
14.12.2000 - 27.12.2000 včetně	01/02/01	10/11, 20/11, 30/11	14
28.12.2000 - 10.01.2001 včetně	01/16/01	20/11, 30/11, 10/12	14
11.01.2001 - 24.01.2001 včetně	01/30/01	30/11, 10/12, 20/12	14

* Údaje k 10.1. a 20.1.2000 z výkazu V(ČNB)21-09 "Vybrané údaje dekádního přehledu aktiv a pasív"