

Třídící znak							
2	0	2	0	6	6	1	0

**ÚŘEDNÍ SDĚLENÍ  
ČESKÉ NÁRODNÍ BANKY**  
ze dne 18. dubna 2006

o vydání třetí verze  
**Pravidel pro referenční banky a výpočet (fixing) referenčních úrokových sazeb  
(PRIBID a PRIBOR)**

Česká národní banka vydává třetí verzi Pravidel pro referenční banky a výpočet (fixing) referenčních úrokových sazeb (PRIBID a PRIBOR), která nabývají účinnosti dne 1. května 2006. Tímto dnem se ruší úřední sdělení České národní banky č. 5/2000 ze dne 30. června 2000 o vydání Pravidel pro referenční banky a výpočet (fixing) referenčních úrokových sazeb (PRIBID a PRIBOR), uveřejněné ve Věstníku ČNB částka 7/2000 a úřední sdělení České národní banky č. 8/2000 ze dne 12. září 2000 o vydání změny č. 1 Pravidel pro referenční banky a výpočet (fixing) referenčních úrokových sazeb (PRIBID a PRIBOR), uveřejněné ve Věstníku ČNB částka 11/2000.

Vrchní ředitel  
prof. Ing. Robert Holman, CSc. v.r.

Příloha

Sekce bankovních obchodů  
Odpovědný zaměstnanec:  
Ing. Jiří Zavadil, tel. 224 415 003

PRAVIDLA  
PRO REFERENČNÍ BANKY  
A VÝPOČET (FIXING) REFERENČNÍCH ÚROKOVÝCH  
SAZEB (PRIBID a PRIBOR)

květen 2006

## Obsah

§ 1 Vymezení pojmů .....	4
§ 2 Udělení statutu referenční banky.....	4
§ 3 Odebrání statutu referenční banky .....	4
§ 4 Práva a povinnosti referenčních bank .....	5
§ 5 Seznam referenčních bank .....	5
§ 6 Výpočet (fixing) referenčních úrokových sazeb (PRIBID a PRIBOR).....	5
§ 7 Zveřejňování a dostupnost hodnot referenčních úrokových sazeb PRIBID a PRIBOR .....	6
§ 8 Zveřejňování a změny Pravidel.....	6
§ 9 Zrušovací ustanovení.....	6
§10 Účinnost .....	6

## § 1 Vymezení pojmů

Pro účely Pravidel pro referenční banky a výpočet (fixing) referenčních úrokových sazeb (PRIBID a PRIBOR), (dále jen „Pravidla“) se pod následujícími pojmy rozumí:

- a) „referenční banka“ je banka, jíž byl udělen statut referenční banky podle § 2 Pravidel a která dodává data pro výpočet hodnot referenčních sazeb PRIBID a PRIBOR,
- b) „kotace“ je úroveň ceny, za kterou je referenční banka ochotna koupit (strana kotace bid) od jiné referenční banky mezibankovní depozitum nebo prodat (strana kotace offer) jiné referenční bance mezibankovní depozitum v souladu se standardními pravidly obchodování,
- c) „kalkulační agent“ je organizace pověřená The Financial Markets Association of the Czech Republic (A.C.I.) (dále jen „Czech Forex Club“) počítáním (fixingem) a zveřejňováním hodnot referenčních úrokových sazeb PRIBID a PRIBOR,
- d) „PRIBID“ (Prague Interbank Bid Rate) je referenční hodnota úrokových sazeb na trhu mezibankovních depozit, kterou počítá (fixuje) kalkulační agent pro Czech Forex Club z kotací referenčních bank pro nákup depozit (bid) podle algoritmu uvedeného v § 6 Pravidel,
- e) „PRIBOR“ (Prague Interbank Offered Rate) je referenční hodnota úrokových sazeb na trhu mezibankovních depozit, kterou počítá (fixuje) kalkulační agent pro Czech Forex Club z kotací referenčních bank pro prodej depozit (offer) podle algoritmu uvedeného v § 6 Pravidel.

## § 2 Udělení statutu referenční banky

(1) Písemnou žádost o udělení statutu referenční banky zasílá banka Czech Forex Clubu.

(2) O udělení statutu referenční banky rozhoduje Czech Forex Club do 30 dnů po obdržení žádosti. Česká národní banka může vyslovit s jeho rozhodnutím nesouhlas. Na udělení statutu referenční banky není nárok a Czech Forex Club není povinen zamítnutí žádosti žadateli zdůvodňovat.

(3) Rozhodnutí o udělení statutu referenční banky bude žadateli oznámeno písemně.

## § 3 Odebrání statutu referenční banky

(1) Czech Forex Club může referenční bance odebrat statut referenční banky po konzultaci s Českou národní bankou:

- a) na základě žádosti referenční banky,
- b) v případě hrubého nebo opakovaného porušení standardních pravidel obchodování (The International Code of Conduct and Practice for the Financial Markets),
- c) v případě neschopnosti splňovat podmínky podle § 4 odst. 3.

(2) O odebrání statutu referenční banky rozhoduje Czech Forex Club. Česká národní banka může vyslovit s jeho rozhodnutím nesouhlas.

(3) Rozhodnutí o odebrání statutu referenční banky bude bance oznámeno písemně.

## § 4

**Práva a povinnosti referenčních bank**

(1) Referenční banky se vyjadřují ke změnám algoritmu pro výpočet referenčních sazeb.

(2) Referenční banky se vyjadřují k žádostem o udělení statutu referenční banky a ke změnám ve složení referenčních bank.

(3) Referenční banky mají povinnost dodávat data pro výpočet (fixing) hodnot referenčních sazeb PRIBID a PRIBOR v čase a formě určených kalkulačním agentem a splňovat technické a organizační podmínky stanovené kalkulačním agentem.

(4) Referenční banky musí být významnými účastníky mezibankovního trhu depozit a produktů odvozených od úrokových sazeb, a to i za rychle se měnících tržních podmínek.

## § 5

**Seznam referenčních bank**

(1) Seznam referenčních bank zveřejňuje vhodným způsobem Česká národní banka. Seznam referenčních bank obsahuje zejména název a sídlo referenčních bank.

(2) Referenční banky souhlasí s uvedením v seznamu referenčních bank.

## § 6

**Výpočet (fixing) referenčních úrokových sazeb (PRIBID a PRIBOR)**

(1) Kotace pro výpočet hodnot sazeb PRIBID a PRIBOR jsou referenčními bankami dodávány kalkulačnímu agentovi každý pracovní den mezi 10:30 až 10:45 hod. místního času.

(2) V době mezi 10:45 až 11:00 hod. místního času provádí kalkulační agent kontrolu formální správnosti dodaných kotací a případné nesrovnalosti řeší přímo s dotyčnou referenční bankou. Referenční banky mohou výjimečně své kotace v tomto čase ještě změnit, nejpozději však do 11:00 hod. místního času.

(3) Výpočet (fixing) hodnot referenčních sazeb PRIBID a PRIBOR probíhá v 11:00 hod. místního času.

(4) Hodnoty referenčních sazeb PRIBID a PRIBOR se počítají jako matematický aritmetický průměr zaokrouhlený na dvě desetinná místa pro následující splatnosti: 1 den (O/N), 1, 2 týdny, 1, 2, 3, 6, 9 měsíců a 1 rok následujícím způsobem:

- a) v případě, že kalkulační agent obdrží kotaci od jedenácti nebo více referenčních bank, bude sazba pro příslušnou splatnost aritmetickým průměrem sazeb po vyloučení dvou nejvyšších a dvou nejnižších sazeb,
- b) v případě, že kalkulační agent obdrží přinejmenším šest, ale méně než jedenáct kotací, bude sazba pro příslušnou splatnost aritmetickým průměrem zbývajících sazeb po vyloučení jedné nejvyšší a jedné nejnižší sazby,
- c) v případě, že kalkulační agent obdrží buď čtyři nebo pět kotací, bude sazba pro příslušnou splatnost aritmetickým průměrem všech těchto sazeb,
- d) v případě, že kalkulační agent obdrží méně než čtyři kotace, sazba pro příslušnou splatnost nebude stanovena.

(5) Hodnoty referenčních sazeb PRIBID a PRIBOR (s výjimkou splatnosti O/N) jsou vypočítány (zafixovány) pro obchody, jejichž vypořádání proběhne druhý pracovní den po dni výpočtu (fixingu), s konvencí act/360.

(6) Hodnoty sazeb PRIBID a PRIBOR jsou po jejich vyhlášení konečné.

(7) Způsob výpočtu hodnot referenčních sazeb PRIBID a PRIBOR dle odstavců 1 až 6 může měnit Czech Forex Club po konzultaci s Českou národní bankou. Česká národní banka může vyslovit s jeho rozhodnutím o změně způsobu výpočtu nesouhlas.

## § 7

### **Zveřejňování a dostupnost hodnot referenčních úrokových sazeb PRIBID a PRIBOR**

Hodnoty sazeb PRIBID a PRIBOR společně s kotacemi jednotlivých referenčních bank budou zveřejněny bezprostředně po ukončení procedury výpočtu (fixingu) a budou dostupné např. v informačních systémech Reuters, Bloomberg a dále způsobem umožňujícím dálkový přístup (prostřednictvím Internetu).

## § 8

### **Zveřejňování a změny Pravidel**

(1) Tato Pravidla zveřejňuje Česká národní banka ve Věstníku ČNB formou úředního sdělení a dále způsobem umožňujícím dálkový přístup (prostřednictvím Internetu).

(2) Česká národní banka je oprávněna po dohodě s Czech Forex Clubem Pravidla měnit a doplňovat. Změny nebo doplnění Pravidel zveřejňuje Česká národní banka ve Věstníku ČNB formou úředního sdělení a dále způsobem umožňujícím dálkový přístup (prostřednictvím Internetu).

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

## § 9

### **Zrušovací ustanovení**

Dnem účinnosti těchto Pravidel se ruší úřední sdělení České národní banky č. 5/2000 ze dne 30. června 2000 o vydání Pravidel pro referenční banky a výpočet (fixing) referenčních úrokových sazeb (PRIBID a PRIBOR), uveřejněné ve Věstníku ČNB částka 7/2000 a úřední sdělení České národní banky č. 8/2000 ze dne 12. září 2000 o vydání změny č. 1 Pravidel pro referenční banky a výpočet (fixing) referenčních úrokových sazeb (PRIBID a PRIBOR), uveřejněné ve Věstníku ČNB částka 11/2000.

## §10

### **Účinnost**

Tato Pravidla nabývají účinnosti dne 1. května 2006.

Vrchní ředitel  
prof. Ing. Robert Holman, CSc. v.r.