

UCHWAŁA NR 19/2011
Zarządu Narodowego Banku Polskiego

z dnia 24 marca 2011 r.

zmieniająca uchwałę w sprawie trybu i szczegółowych zasad przekazywania przez banki do Narodowego Banku Polskiego danych niezbędnych do ustalania polityki pieniężnej i okresowych ocen sytuacji pieniężnej państwa oraz oceny sytuacji finansowej banków i ryzyka sektora bankowego

Na podstawie art. 23 ust. 4 ustawy z dnia 29 sierpnia 1997 r. o Narodowym Banku Polskim (Dz. U. z 2005 r. Nr 1, poz. 2 i Nr 167, poz. 1398, z 2006 r. Nr 157, poz. 1119, z 2007 r. Nr 25, poz. 162 i Nr 61, poz. 410, z 2008 r. Nr 209, poz. 1315 i 1317, z 2009 r. Nr 69, poz. 589 i Nr 143, poz. 1164 oraz z 2010 r. Nr 109, poz. 709 i Nr 257, poz. 1724) uchwała się, co następuje:

§ 1. W uchwale nr 23/2003 Zarządu Narodowego Banku Polskiego z dnia 25 lipca 2003 r. w sprawie trybu i szczegółowych zasad przekazywania przez banki do Narodowego Banku Polskiego danych niezbędnych do ustalania polityki pieniężnej i okresowych ocen sytuacji pieniężnej państwa oraz oceny sytuacji finansowej banków i ryzyka sektora bankowego (Dz. Urz. NBP Nr 16, poz. 26, z 2004 r. Nr 1, poz. 1, Nr 5, poz. 11 i Nr 20, poz. 38, z 2005 r. Nr 9, poz. 16, z 2006 r. Nr 10, poz. 10 i Nr 12, poz. 15, z 2007 r. Nr 1, poz. 1 i Nr 7, poz. 18, z 2008 r. Nr 6, poz. 8, z 2009 r. Nr 2, poz. 2 oraz z 2010 r. Nr 1, poz. 1) wprowadza się następujące zmiany:

1) w § 14 dotychczasową treść oznacza się jako ust. 1 i dodaje się ust. 2 i 3 w brzmieniu:

„2. Banki, które na podstawie zgody, o której mowa w art. 128 ust. 3 i art. 128d ust. 1 i 6 ustawy z dnia 29 sierpnia 1997 r. – Prawo bankowe, stosują metody statystyczne do obliczania wymogów kapitałowych, przekazują dane w zakresie załącznika nr 23 do uchwały, wyliczone z zastosowaniem metod statystycznych, z zastrzeżeniem ust. 3.

3. Banki, o których mowa w ust. 2, w okresie, w którym zgodnie z przepisami uchwały nr 76/2010 Komisji Nadzoru Finansowego z dnia 10 marca 2010 r. w sprawie zakresu i szczegółowych zasad wyznaczania wymogów kapitałowych z tytułu poszczególnych rodzajów ryzyka (Dz. Urz. KNF Nr 2, poz. 11 i Nr 8, poz. 38) obowiązane są do wyliczania porównawczego wymogu kapitałowego, przekazują dane w zakresie załącznika nr 23 do uchwały, wyliczone z zastosowaniem metod statystycznych oraz metod stosowanych przed uzyskaniem zgody na stosowanie metod statystycznych.”;

- 2) załącznik nr 1 do uchwały otrzymuje brzmienie określone w załączniku nr 1 do niniejszej uchwały;
- 3) w załączniku nr 2 do uchwały wzory: P0903, EBC33, EBC41 i EBC43 otrzymują brzmienie określone w załączniku nr 2 do niniejszej uchwały;
- 4) w załączniku nr 22 do uchwały wzór FIN028 otrzymuje brzmienie określone w załączniku nr 3 do niniejszej uchwały;
- 5) w załączniku nr 23 do uchwały wzór MKR SA FX otrzymuje brzmienie określone w załączniku nr 4 do niniejszej uchwały.

§ 2. Uchwała wchodzi w życie z dniem 31 marca 2011 r.

Przewodniczący Zarządu Narodowego Banku Polskiego:

wz. P. Wiesiołek

Załączniki do uchwały nr 19/2011 Zarządu Narodowego Banku Polskiego z dnia 24 marca 2011 r. (poz. 3)

Załącznik nr 1

LISTA BANKÓW
przekazujących do Narodowego Banku Polskiego dane
wymienione w załącznikach nr 2, 9, 13 i 18 do uchwały

1. Powszechna Kasa Oszczędności Bank Polski S.A.
2. Bank Gospodarki Żywnościowej S.A.
3. Bank Millennium S.A.
4. ING Bank Śląski S.A.
5. Bank BPH S.A.
6. Bank Zachodni WBK S.A.
7. Kredyt Bank S.A.
8. Bank Polska Kasa Opieki S.A.
9. Bank Handlowy w Warszawie S.A.
10. BRE Bank S.A.
11. Raiffeisen Bank Polska S.A.
12. Polski Bank Przedsiębiorczości S.A.
13. RBS Bank (Polska) S.A.
14. Bank Ochrony Środowiska S.A.
15. Societe Generale S.A. Oddział w Polsce
16. Deutsche Bank Polska S.A.
17. Santander Consumer Bank S.A.
18. AIG Bank Polska S.A.
19. Rabobank Polska S.A.
20. Bank Gospodarstwa Krajowego
21. BRE Bank Hipoteczny S.A.
22. Krakowski Bank Spółdzielczy
23. Bank Spółdzielczy w Brodnicy
24. LUKAS Bank S.A.
25. FORTIS BANK POLSKA S.A.
26. Bank DnB NORD Polska S.A.
27. BNP PARIBAS S.A. Oddział w Polsce
28. HSBC Bank Polska S.A.
29. NORDEA BANK POLSKA S.A.

P0903

INFORMACJA UZUPEŁNIAJĄCA - ZOBOWIĄZANIA PODPORZĄDKOWANE

		stan na dzień w tys. zł					
		REZYDENT		NIEREZYDENT		RAZEM	
		złote	dewizy	złote	dewizy		
	A1	B1	C1	D1	E1		
A1	1. Zobowiązania podporządkowane wobec:						
B1	a) monetarnych instytucji finansowych						
C1	w tym w formie wyemitowanych papierów wartościowych						
D1	b) pozostałych instytucji pośrednictwa finansowego i pomocniczych instytucji finansowych						
E1	w tym w formie wyemitowanych papierów wartościowych						
F1	c) instytucji ubezpieczeniowych i funduszy emerytalnych						
G1	w tym w formie wyemitowanych papierów wartościowych						
H1	d) przedsiębiorstw						
I1	w tym w formie wyemitowanych papierów wartościowych						
J1	e) instytucji rządowych szczebla centralnego						
K1	w tym w formie wyemitowanych papierów wartościowych						
L1	f) instytucji samorządowych i funduszy ubezpieczeń społecznych						
M1	w tym w formie wyemitowanych papierów wartościowych						
N1	g) gospodarstw domowych i instytucji niekomercyjnych działających na rzecz gospodarstw domowych						
O1	w tym w formie wyemitowanych papierów wartościowych						

EBC33

STRUKTURA GEOGRAFICZNA
część III
(dane kwartalne)

stan na dzieńw tys. zł

		Kraje członkowskie UGW (cz.III)			
		CY	MT	SK	EE
		A1	B1	C1	D1
A K T Y W A					
A1	2. Kredyty, pożyczki i inne należności				
B1	a. udzielone monetarnym instytucjom finansowym				
C1	b. udzielone instytucjom niemonetarnym				
D1	3. Dłużne papiery wartościowe				
E1	a. wyemitowane przez monetarne instytucje finansowe				
F1	z terminem pierwotnym do 1 roku włącznie				
G1	powyżej 1 roku do 2 lat włącznie				
H1	powyżej 2 lat				
I1	b. wyemitowane przez instytucje niemonetarne				
J1	4. Jednostki uczestnictwa funduszy rynku pieniężnego				
K1	5. Papiery wartościowe z prawem do kapitału i udziały				
P A S Y W A					
L1	9. Depozyty i inne zobowiązania				
M1	a. monetarnych instytucji finansowych				
N1	b. instytucji niemonetarnych				

EBC41

STRUKTURA WALUTOWA - AKTYWA - część I
(dane kwartalne)

stan na dzień w tys. zł

	Euro		Waluty pozostałych krajów Unii Europejskiej					Inne waluty łącznie ^{1/}
	Wszystkie waluty razem	Razem	DKK	SEK	GBP	PLN		
A1	B1	C1	D1	E1	F1	G1	H1	
2. Kredyty, pożyczki i inne należności								
A. Instytucje krajowe	X	X	X	X	X	X	X	
a. monetarne instytucje finansowe	X	X	X	X	X	X	X	
b. instytucje niemonetarne	X	X	X	X	X	X	X	
D5 w tym: gospodarstwa domowe	X	X	X	X	X	X	X	
D7 przedsiębiorstwa	X	X	X	X	X	X	X	
B. Instytucje krajów Unii Gospodarczej i Walutowej	X	X	X	X	X	X	X	
a. monetarne instytucje finansowe	X	X	X	X	X	X	X	
b. instytucje niemonetarne	X	X	X	X	X	X	X	
H1 C. Instytucje krajów reszty świata								
I1 z terminem pierwotnym do 1 roku włącznie	X							
J1 powyżej 1 roku	X							
K1 a. banki								
L1 b. instytucje niebankowe								
M1 3. Dłużne papiery wartościowe wyemitowane przez:	X	X						
N1 A. Instytucje krajowe	X	X						
O1 a. monetarne instytucje finansowe	X	X						
P1 b. instytucje niemonetarne	X	X						
Q1 B. Instytucje krajów Unii Gospodarczej i Walutowej	X	X						
R1 a. monetarne instytucje finansowe	X	X						
S1 b. instytucje niemonetarne	X	X						
T1 C. Instytucje krajów reszty świata								
U1 a. banki								
W1 b. instytucje niebankowe								

^{1/} BGN, CZK, HUF, LTL, LVL, RON

EBC43

STRUKTURA WALUTOWA - PASYWA - część I
(dane kwartalne)

		stan na dzień w tys. zł									
		Waluty pozostałych krajów Unii Europejskiej									
		Wszystkie waluty razem	Euro	Razem	DKK	SEK	GBP	PLN	Inne waluty łącznie ^{1/}		
		A1	B1	C1	D1	E1	F1	G1	H1		
A1	9. Depozyty i inne zobowiązania	X	X	X							
B1	A. Instytucje krajowe	X	X								
C1	a. monetarne instytucje finansowe	X	X								
D1	b. instytucje niemonetarne	X									
D5	w tym: gospodarstwa domowe	X		X	X	X	X	X	X	X	
D7	przedsiębiorstwa	X	X	X	X	X	X	X	X	X	
E1	B. Instytucje krajów Unii Gospodarczej i Walutowej	X	X								
F1	a. monetarne instytucje finansowe	X	X								
G1	b. instytucje niemonetarne	X									
H1	C. Instytucje krajów reszty świata										
I1	z terminem pierwotnym do 1 roku włącznie	X									
J1	powyżej 1 roku	X									
K1	a. banki										
L1	b. instytucje niebankowe										
M1	11. Emisja dłużnych papierów wartościowych	X	X								

^{1/} BGN, CZK, HUF, LTL, LVL, RON

Załącznik nr 3

FIN028 Struktura walutowa

	Struktura walutowa						
	Pozycje bilansowe, kredyty i inne należności	Pozycje bilansowe, pozostałe aktywa	Pozycje bilansowe, zobowiązania finansowe	Pozycje bilansowe, pozostałe pasywa	Pozycje pozabilansowe, kwoty do otrzymania	Pozycje pozabilansowe, kwoty do wydania	Pozycje strukturalne
EUR							
USD							
CHF							
JPY							
GBP							
DKK							
NOK							
SEK							
AUD							
HUF							
CZK							
CAD							
EEK	x	x	x	x	x	x	x
RUB							
SIT							
SKK	x	x	x	x	x	x	x
UAH							
LTL							
LVL							
Waluty niewymienne							
Inne waluty wymienne							

Załącznik nr 4

MKR SA FX Rzyko Rynkowe: wymóg kapitałowy z tytułu ryzyka walutowego

	Wszystkie pozycje						Pozycje netto		Pozycje podlegające narzutowi kapitałowemu			Wymogi kapitałowe
	Długie		Krótkie		Inne pozycje		Długie	Krótkie	Długie	Krótkie	Dopasowane	
	Pozycje bilansowe	Pozycje pozabilansowe	Pozycje bilansowe	Pozycje pozabilansowe	Długie	Krótkie						
Waluty w drugim etapie UGW									X	X		
Waluty będące przedmiotem porozumień międzynarodowych									X	X		
Waluty silnie skorelowane									X	X		
Pozostałe waluty (włączając CUIs traktowane jako pozostałe waluty)											X	
Złoto											X	
Inne ryzyka (oprócz ryzyka delta) związane z opcjami walutowymi	X	X	X	X	X	X	X	X				X
Pozycje dodatkowe: pozycje walutowe	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
EUR												X
DKK												X
EEK	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
LTL												X
SIT	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
CYP	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
LVL												X
MTL	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
SKK	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
Waluty ERM 2												X
GBP									X	X	X	X
SEK									X	X	X	X
CHF									X	X	X	X
Inne waluty EEA									X	X	X	X
USD									X	X	X	X
CAD									X	X	X	X
AUD									X	X	X	X
JPY									X	X	X	X
Inne waluty (spoza obszaru EEA)									X	X	X	X
CUIs traktowane jako odrębne waluty									X	X	X	X
pozycje walutowe									X	X	X	X