

МЕТОДИКА

ЗА ИЗЧИСЛЯВАНЕ НА ИНДЕКС ЗА СКЛЮЧЕНИТЕ СДЕЛКИ С ДЕПОЗИТИ ОВЪРНАЙТ В БЪЛГАРСКИ ЛЕВОВЕ „ЛЕОНИЯ Плюс“

Чл. 1. Определение на индекса

1.1. „ЛЕОНИЯ Плюс“ („LEONIA Plus“: LEv OverNight Index Average Plus) е справочен индекс на сключените и изпълнените сделки с депозити овърнайт в български левове от всички банки, лицензирани от Българската народна банка (БНБ), и клоновете на чуждестранни банки в страната.

1.2. Индексът „ЛЕОНИЯ Плюс“ е среднопретеглена стойност на лихвените проценти по всички сделки за предоставяне на необезпечени депозити овърнайт в български левове на междубанковия пазар в България.

1.3. Индексът „ЛЕОНИЯ Плюс“ се изчислява и публикува от БНБ всеки работен ден.

Чл. 2. Податели на данни

2.1. Податели на данни за изчисляването на индекса „ЛЕОНИЯ Плюс“ са всички банки, лицензирани от БНБ, и клоновете на чуждестранни банки в страната, участващи на междубанковия левов паричен пазар („податели на данни“). 2.2. Информацията за сделките, включени в изчисляването на индекса „ЛЕОНИЯ Плюс“, е част от ежедневната информация за междубанковия пазар в страната, която подателите на данни подават в БНБ.

2.3. За изчисляването на индекса „ЛЕОНИЯ Плюс“ подателите на данни подават до БНБ ежедневно информация за:

а) стойността на всяка сделка по предоставяне на необезпечени депозити овърнайт в български левове, сключена и изпълнена в течение на работния ден, преди края на системния ден на Системата за брутен сетълмент в реално време (RINGS) и с получател на депозита банка, лицензирана от БНБ, или клон на чуждестранна банка в страната;

б) стойността на лихвения процент за всяка една сделка по точка „а“;

в) останалите параметри, изисквани от БНБ по ежедневната информация за междубанковия пазар.

2.4. Получената информация по т. 2.3. се използва за изчисляване на индекса „ЛЕОНИЯ Плюс“, както и се включва в паричната и лихвената статистика, съставяна от БНБ на основание чл. 42 от Закона за БНБ и Наредба № 17 на БНБ от 29 март 2018 г. за паричната и лихвената статистика и статистиката на финансовите сметки.

Чл. 3. Изчисляване на индекса „ЛЕОНИЯ Плюс“

3.1. В обхвата на ежедневното изчисляване на индекса „ЛЕОНИЯ Плюс“ се включват данните, подадени по реда на т. 2.3, за сключените и изпълнени сделки за предоставяне на необезпечени депозити овърнайт в български левове.

3.2. „ЛЕОНИЯ Плюс” се изчислява като среднопретеглена стойност на лихвените проценти по всички сключени и изпълнени сделки с необезпечени депозити овърнайт в български левове между подателите на данни. Теглата се изчисляват въз основа на обема на предоставените необезпечени депозити овърнайт в български левове за деня. 3.3. Периодът на депозит овърнайт в български левове започва да тече от началото на един системен ден на RINGS и продължава до началото на следващия системен ден на RINGS.

3.4. В изчисляването на индекса „ЛЕОНИЯ Плюс” не се включват сделки с обезпечения.

3.5. Форматът на индекса „ЛЕОНИЯ Плюс” е с 2 знака след десетичната запетая. Конвенцията за броене на дните е „реален брой изминали дни/360” (“actual/360”).

Чл. 4. Публикуване на индекса

4.1. БНБ изчислява индекса „ЛЕОНИЯ Плюс” и го публикува до 18:30 ч. местно време на същия ден на интернет страницата на БНБ, с изключение на неработните дни.

4.2. БНБ публикува стойността на индекса „ЛЕОНИЯ Плюс”, общия обем на сделките в хиляди левове, броя на сключените сделки и датата на вальора на сделките до 18:30 ч. местно време на същия ден.

4.3. Когато в даден работен ден на междубанковия пазар няма сключени сделки за предоставяне на необезпечени депозити овърнайт в български левове, БНБ отбелязва, че индексът за деня не е наличен, като публикува индикатора „n/a” (неналичен, Not Available) за стойността на индекса и стойност „0” (нула) за обема и за броя на сделките.

4.4. Исторически данни за индекса по т. 4.2 се съхраняват от БНБ и са достъпни на интернет страницата ѝ.

4.5. Веднъж публикувани, стойностите на индекса се приемат за окончателни.

Заклучителни разпоредби

§ 1. Настоящата Методика за изчисляване на индекс за сключените сделки с депозити овърнайт в български левове „ЛЕОНИЯ Плюс” е приета на основание чл. 4, ал. 1 и чл. 16, т. 19 от Закона за БНБ с Решение № 37 от 16.03.2018 г. на Управителния съвет на БНБ, в сила от 1 юли 2018 г., изм. и доп. с Решение № 223 от 22.08.2018 г. на Управителния съвет на БНБ, в сила от 1 октомври 2018 г.

§ 2. Подателите на данни са задължени да подават информация съгласно изискванията и реда, предвидени в настоящата Методика за изчисляване на индекс за сключените сделки с депозити овърнайт в български левове „ЛЕОНИЯ Плюс”, Наредба № 17 на БНБ от 29 март 2018 г. за паричната и лихвената статистика и статистиката на финансовите сметки и Указание за определяне съдържанието и реда за подаване на формите за сключените сделки на междубанковия паричен пазар и на валутния пазар в България, утвърдено от подуправителя, ръководещ управление „Банково”.