

Metodický list

Referenční úroková sazba CZEONIA

I. Definice a obsah

Referenční úroková sazba CZEONIA (CZEch OverNight Index Average) je vážený průměr úrokových sazeb všech nezajištěných O/N depozit uložených bankami a pobočkami zahraničních bank na mezibankovním trhu (včetně depozit uložených do depozitní facility ČNB).

II. Zdroje a metodika zjišťování

Referenční úrokovou sazbu CZEONIA počítá a zveřejňuje ČNB na základě údajů dodaných bankami a pobočkami zahraničních bank.

III. Členění

Objem: celkový objem všech nezajištěných O/N depozit uložených bankami a pobočkami zahraničních bank na mezibankovním trhu (včetně depozit uložených do depozitní facility ČNB)

Sazba: průměrná úroková sazba uskutečněných obchodů vážená podle objemu jednotlivých obchodů

IV. Způsob výpočtu

Pro účely výpočtu celkového objemu a průměrné úrokové sazby vychází referenční banky 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.

Hodnota referenční úrokové sazby CZEONIA se vypočítá jako vážený průměr úrokových sazeb dodaných bankami a pobočkami zahraničních bank zaokrouhlený na dvě desetinná místa. Váhami jsou objemy depozit uložených jednotlivými referenčními bankami.

Hodnoty ke konci měsíce jsou údaje posledního pracovního dne daného měsíce. Měsíční průměry jsou prosté aritmetické průměry hodnot za všechny pracovní dny v měsíci.

V. Změna metodiky

S platností od 1. 7. 2020 je referenční úroková sazba CZEONIA počítána ze statistických dat, která jsou bankami a pobočkami zahraničních bank předkládána České národní bance na denní bázi v souladu s Vyhláškou č. 346/2013 Sb. ve výkazu CZEONIA01.