

Suvestinė redakcija nuo 2020-04-01

Nutarimas paskelbtas: TAR 2015-10-08, i. k. 2015-14904



LIETUVOS BANKO VALDYBA

NUTARIMAS

DĖL LIETUVOS BANKO PERKAMŲ LIETUVOS RESPUBLIKOS VYRIAUSYBĖS VERTYBINIŲ POPIERIŲ AUKCIONŲ TAISYKLIŲ PATVIRTINIMO

2015 m. spalio 7 d. Nr. 03-149
Vilnius

Vadovaudamasi Lietuvos Respublikos Lietuvos banko įstatymo 25 straipsnio 1 dalimi ir 3 dalies 1 punktu, Lietuvos banko valdyba **n u t a r i a**:

1. Patvirtinti Lietuvos banko perkamų Lietuvos Respublikos Vyriausybės vertybinių popierių aukcionų taisykles (pridedamos).
2. Pavesti Lietuvos banko valdybos pirmininkui patvirtinti šio nutarimo 1 punkte nurodytų taisyklių įgyvendinimo tvarkos aprašą.

Valdybos pirmininko pavaduotoja,
pavaduojanti Valdybos pirmininką

Ingrida Šimonytė

PATVIRTINTA
Lietuvos banko valdybos
2015 m. spalio 7 d.
nutarimu Nr. 03-149
(Lietuvos banko valdybos
2016 m. balandžio 14 d.
nutarimo Nr. 03-50 redakcija)

LIETUVOS BANKO PERKAMŲ LIETUVOS RESPUBLIKOS VYRIAUSYBĖS VERTYBINIŲ POPIERIŲ AUKCIONŲ TAISYKLĖS

I SKYRIUS BENDROSIOS NUOSTATOS

1. Lietuvos banko perkamų Lietuvos Respublikos Vyriausybės vertybinių popierių aukcionų taisyklėse (toliau – Taisyklės) nustatyta Lietuvos banko pinigų politikos tikslais pagal Europos Centrinio Banko sprendimus arba kitus teisės aktus vykdomas Eurosistemos vertybinių popierių pirkimo programos (toliau – pirkimo programos) perkamų Lietuvos Respublikos Vyriausybės vertybinių popierių (VVP) aukcionų (toliau – aukcionai) vykdymo tvarka ir sąlygos.

Punkto pakeitimai:

Nr. [03-41](#), 2020-03-31, paskelbta TAR 2020-03-31, i. k. 2020-06690

2. Lietuvos bankas pagal Taisyklės perka VVP.
3. Aukcionai vykdomi Lietuvos banko darbo dienomis, išskyrus tas darbo dienas, kuriomis yra:

3.1. organizuojami VVP išleidimo aukcionai;
3.2. išleidžiami VVP sindikato arba kitu viešojo platinimo būdu.
4. Aukciono dieną Lietuvos bankas nevykdo VVP pirkimų sudarydamas dvišalius sandorius.
5. VVP pirkimo operacijos atliekamos sutartinių kainų aukciono būdu (angl. *multiple price*), kai aukcioną laimėję pasiūlymai tenkinami pagal pasiūlymuose nurodytas kainas (pelningumą, angl. *yield to maturity*).

6. Teisę dalyvauti pagal Taisyklės vykdomuose aukcionuose turi subjektai, kurie atitinka pirkimo programą, kurią įgyvendinant vykdomi aukcionai, reglamentuojančių Europos Centrinio Banko teisės aktų reikalavimus (toliau – sandorio šalis).

Punkto pakeitimai:

Nr. [03-41](#), 2020-03-31, paskelbta TAR 2020-03-31, i. k. 2020-06690

II SKYRIUS AUKCIONO ORGANIZAVIMAS

7. Lietuvos bankas likus ne mažiau kaip 1 val. iki aukciono sąlygose nustatyto pasiūlymų priėmimo aukcione ribinio laiko *Bloomberg* sistemos arba Lietuvos banko apsikeitimo failais sistemos (AFS) priemonėmis, o šių priemonių sutrikimų atveju – kitomis Lietuvos bankui priimtinais ryšio arba elektroninėmis duomenų apsikeitimo priemonėmis, praneša visoms sandorio šalims, išskyrus sandorio šalį, kurioms pagal Taisyklių 15 punkto nuostatas neleidžiama dalyvauti aukcione, šias aukciono sąlygas:

- 7.1. aukciono numeris, data ir pasiūlymų priėmimo aukcione ribinis laikas;
- 7.2. atsiskaitymų už perkamus VVP diena;
- 7.3. VVP emisijų, kurios vykdomame aukcione gali būti perkamos, sąrašas;
- 7.4. kitos papildomos sąlygos ir informacija, jei tokios aukciono sąlygos būtų nustatytos:

7.4.1. vienos sandorio šalies aukcionui pateikiamas didžiausias pasiūlymų kiekis pagal kiekvienos emisijos VVP ir (arba) didžiausia pasiūlymo (-ų) suma, pagal kiekvienos emisijos VVP (nominaliąja verte);

7.4.2. Lietuvos bankui priimtina didžiausia kaina (mažiausias pelningumas) pagal kiekvienos emisijos VVP;

7.4.3. orientacinė didžiausia perkamų VVP suma arba didžiausia suma sandoriams sudaryti (nominaliąja verte) pagal kiekvienos emisijos VVP;

7.4.4. didžiausia visų aukcionui tinkamų emisijų VVP bendra suma sandoriams sudaryti (VVP nominaliąja verte);

7.4.5. pasiūlymuose nurodomos kainos (pelningumo) skaitmenų po kablelio skaičius ir (arba) kartotinis.

8. Lietuvos bankas aukciono dalyviams gali neskelbti 7.4.2–7.4.4 papunkčiuose nurodytų papildomų sąlygų ir (arba) informacijos.

9. Pageidaujanti dalyvauti aukcione sandorio šalys aukciono dieną ne vėliau kaip iki aukciono sąlygose nustatyto pasiūlymo priėmimo aukcione ribinio laiko Lietuvos bankui pateikia pasiūlymus *Bloomberg* sistemos priemonėmis (aukcioną vykdant per *Bloomberg* sistemą) arba Taisyklių 1 priede nurodytos formos paraišką su pasiūlymais (aukciono pasiūlymus surenkant per AFS arba kitomis Lietuvos bankui priimtinais ryšio arba elektroninėmis duomenų apsikeitimo priemonėmis).

10. Mažiausia nominalioji VVP vertė, kuri gali būti nurodyta pasiūlyme sudaryti su Lietuvos banku sandorį (-ius) arba taikoma tenkinant šį pasiūlymą, ir šios sumos kartotinis yra 100 000 eurų. Jei sandorio šalis pateikė pasiūlymą, kuris neatitinka šio sumos kartotinio reikalavimo, Lietuvos bankas vienašališkai mažina pasiūlymo sumą iki artimiausio šiame punkte nustatyto sumos kartotinio dydžio.

11. Sandorio šalis, nesutinkanti, kad jos pasiūlyme nurodyta suma būtų tenkinama iš dalies, turi tai nurodyti teikdama paraišką.

12. Sandorio šalis privalo užtikrinti, kad pasiūlymus *Bloomberg* sistemos priemonėmis ir AFS pateiktų sandorio šalies įgaliotieji asmenys. Pasiūlymus gali pateikti ir asmenys, sandorio šalies įgalioti sudaryti dvišalius vertybinių popierių pirkimo–pardavimo sandorius. Pasiūlymus pateikiant kitomis Lietuvos bankui priimtinais ryšio arba elektroninėmis duomenų apsikeitimo priemonėmis, Taisyklių 1 priede nurodytos formos paraišką turi pasirašyti šiame punkte nurodyti asmenys.

13. Sandorio šalis negali keisti arba atsiimti pateiktų pasiūlymų po pasiūlymų priėmimo aukcione ribinio laiko.

14. Lietuvos bankas turi teisę atmesti bet kurį aukcionui pateiktą pasiūlymą, jeigu jis neatitinka Taisyklių ir aukciono sąlygų, ir apie tai nedelsdamas informuoja pasiūlymą pateikusių sandorio šalį.

15. Lietuvos banko valdybos pirmininko arba jo įgalioto asmens sprendimu sandorio šaliai gali būti neleidžiama dalyvauti aukcione šiais atvejais:

15.1. kai sandorio šalis neatitinka pirkimo programą, kurią įgyvendinant vykdomas aukcionas, reglamentuojančių Europos Centrinio Banko teisės aktų reikalavimų;

Punkto pakeitimai:

Nr. [03-41](#), 2020-03-31, paskelbta TAR 2020-03-31, i. k. 2020-06690

15.2. kai sandorio šalis nesilaiko Taisyklių nuostatų;

15.3. kai sandorio šalis pripažino, kad negali įvykdyti paskutinio pagal aukcioną sudaryto sandorio;

15.4. kai yra kitų priežasčių, dėl kurių, Lietuvos banko vertinimu, sandorio šalis gali nesugebėti tinkamai ir laiku atsiskaityti pagal sandorį.

16. Lietuvos bankas nedelsdamas informuoja sandorio šalį apie sprendimą neleisti jai dalyvauti aukcione.

III SKYRIUS

AUKCIONO VYKDYMAS

17. Aukcionas vyksta Lietuvos banke, nedalyvaujant sandorio šalių atstovams.
18. Aukciono metu pagal kiekvienos emisijos VVP sudaromi pasiūlymų, kurie išdėstomi pagal siūlomą kainą didėjimo tvarka (pagal pelningumą mažėjimo tvarka), sąrašai.
19. Jeigu aukciono vienos ar kelių emisijų VVP nustatytos sumos (nominaliąja verte) sandoriams sudaryti dalis, likusi nuo visiškai patenkintų pasiūlymų atitinkamame sąraše, yra mažesnė negu sąrašo ribiniuose vienodos (ir mažiausios Lietuvos bankui priimtinos, jeigu buvo tokia nustatyta) kainos (pelningumo) pasiūlymuose nurodyta bendra suma, šie pasiūlymai gali būti proporcingai mažinami, suapvalinus iki vieno pasiūlymo sumos kartotinio. Jeigu sandorio šalis nurodė, kad nesutinka, kad jos kuriame nors iš šių ribinių pasiūlymų nurodyta suma būtų tenkinama iš dalies, toks pasiūlymas atmetamas ir likę pasiūlymai proporcingai mažinami jo neįskaitant. Taip pat gali būti nuspręsta visiškai patenkinti sąrašo ribinius vienodos kainos (pelningumo) pasiūlymus, dėl to aukciono metu padidinus didžiausią tų emisijų VVP sumą (nominaliąja verte) sandoriams sudaryti.
20. Lietuvos bankas VVP perka už mažiausią (-ias) pasiūlymo (-ų) kainą (-as) (didžiausią (-ius) pasiūlymo (-ų) pelningumą (-us) ir pasilieka teisę pasirinkti, kurį VVP (-ius) ir kokį kiekį pirkti arba nepirkti visai, atsižvelgdamas į kiekvieno VVP pasiūlyme nurodyto kainos (pelningumo) nuokrypį nuo aukciono metu rinkoje vyraujančios kainos (pelningumo).
21. Jeigu Lietuvos bankas negauna nė vieno jį tenkinančio pasiūlymo, aukcionas laikomas neįvykusiu.
22. Individualūs pasiūlymai patvirtinami ne vėliau kaip per 1 valandą po pasiūlymų priėmimo aukcione ribinio laiko, pranešant per *Bloomberg* sistemą arba AFS. Jeigu nėra galimybės pasiūlymus patvirtinti per *Bloomberg* sistemą arba AFS, pasiūlymai patvirtinami telefonu sandorio šalies 12 punkte nurodytiems asmenims. Sandorio šalis, kurios pasiūlymas buvo patenkintas, gavusi patvirtinimą privalo vykdyti savo įsipareigojimus.
23. Kiekvienas aukcione patenkintas pasiūlymas laikomas atskiru pirkimo arba pardavimo sandoriu ir yra vykdomas atskirai.
24. Sandorio šalis, nesulaukusi 22 punkte nurodyto patvirtinimo, privalo nedelsdama informuoti Lietuvos banką.
25. Aukciono rezultatai skelbiami Lietuvos banko tinklalapyje ne vėliau kaip per 1 valandą po pasiūlymų priėmimo aukcione ribinio laiko ir ne vėliau, kai 22 punkte nustatyta tvarka visoms aukcione dalyvavusioms sandorio šalims patvirtinami individualūs pasiūlymai. Lietuvos bankas skelbia pirkimo programą reglamentuojančiuose Europos Centrinio Banko teisės aktuose nustatytus aukciono rezultatų duomenis. Aukciono rezultatai papildomai gali būti skelbiami ir per *Bloomberg* sistemą.

Punkto pakeitimai:

Nr. [03-41](#), 2020-03-31, paskelbta TAR 2020-03-31, i. k. 2020-06690

IV SKYRIUS

BAIGIAMOSIOS NUOSTATOS

26. Sandorio šalis, neatsiskaičiusi už pagal aukcioną sudarytą sandorį, privalo sumokėti Lietuvos bankui pagal Tarptautinės kapitalo rinkos asociacijos antrinės rinkos taisykles ir rekomendacijas (angl. *International Capital Market Association (ICMA) rules and recommendations for the secondary market*) apskaičiuotą kompensaciją.

27. Viename aukcione gali būti perkami VVP pagal kelias skirtingas pirkimo programas.

Papildyta punktu:

Nr. [03-41](#), 2020-03-31, paskelbta TAR 2020-03-31, i. k. 2020-06690

28. Jeigu tai neprieštarauja Europos Centrinio Banko teisės aktams, gali būti neatskleidžiama, kokias konkrečias pirkimo programas įgyvendina konkretūs aukcionai.

Papildyta punktu:

Nr. [03-41](#), 2020-03-31, paskelbta TAR 2020-03-31, i. k. 2020-06690

Priedo pakeitimai:

Nr. [03-50](#), 2016-04-14, paskelbta TAR 2016-04-18, i. k. 2016-09610

(paraiškos teikėjo pavadinimas)

Lietuvos banko
Operacijų ir mokėjimų departamentui
Totorių g. 4
LT-01121 Vilnius

**PARAIŠKA
DALYVAUTI LIETUVOS BANKO PERKAMŲ VVP AUKCIONE**

201__ m. _____ d.

Aukciono data 201__ m. _____ d.

Paraiškos Nr. _____

Aukciono kodas _____

Eil. nr.	VVP ISIN	Nominalioji vertė, EUR	Kaina (pelningumas, proc.)	Dalinė suma*

Įsipareigojame laiku ir visiškai atsiskaityti už tuos sandorius, kuriuos apie patenkintus mūsų pasiūlymus pranešęs patvirtins Lietuvos bankas.

(vardas ir pavardė)

(parašas)

Priedo pakeitimai:

Nr. [03-50](#), 2016-04-14, paskelbta TAR 2016-04-18, i. k. 2016-09610

* Galimos reikšmės „T“ arba „N“. Nurodydama „T“ arba neužpildydama šio stulpelio, sandorio šalis sutinka, kad pasiūlyme nurodyta VVP nominaliosios vertės suma gali būti tenkinama iš dalies. Nurodydama „N“, sandorio šalis nesutinka, kad jos pasiūlyme nurodyta VVP nominaliosios vertės suma būtų tenkinama iš dalies.

Pakeitimai:

1.

Lietuvos bankas, Nutarimas

Nr. [03-50](#), 2016-04-14, paskelbta TAR 2016-04-18, i. k. 2016-09610

Dėl Lietuvos banko valdybos 2015 m. spalio 7 d. nutarimo Nr. 03-149 „Dėl Lietuvos banko perkamų Lietuvos Respublikos Vyriausybės vertybinių popierių aukcionų taisyklių patvirtinimo“ pakeitimo

2.

Lietuvos bankas, Nutarimas

Nr. [03-41](#), 2020-03-31, paskelbta TAR 2020-03-31, i. k. 2020-06690

Dėl Lietuvos banko valdybos 2015 m. spalio 7 d. nutarimo Nr. 03-149 „Dėl Lietuvos banko perkamų Lietuvos Respublikos Vyriausybės vertybinių popierių aukcionų taisyklių patvirtinimo“ pakeitimo