

AZ EURO LIKVIDITÁST NYÚJTÓ, VÁLTOZÓ ÁRAS, KÉTHETES FUTAMIDEJŰ JEGYBANKI
EUR/HUF FX-SWAP TENDER FELTÉTELEI

2014. DECEMBER 22.

A tender időpontja:	15:00-15:30 óra
Induló láb elszámolásának napja:	2014.12.23
Lejárati láb elszámolásának napja:	2015.01.07
Induló EUR/HUF árfolyam:	316,20
Meghirdetett mennyiség:	600 millió EUR
Maximális elfogadható swappont (a technikai induló EUR/HUF árfolyamra vetítve):	4,20 swappont
Eredményhirdetés időpontja:	16:00 óra

Az MNB a benyújtott ajánlatok ár szerinti sorba rendezése alapján dönt azok elfogadásáról. Amennyiben a legmagasabb, még elfogadott swapponhoz kapcsolódó ajánlatok teljes összegben történő kielégítése a maximálisan elfogadható mennyiség átlépését jelentené, akkor az MNB ezeket az ajánlatokat 1 millió eurós egységekben a kártyaleosztás szabályai szerint elégti ki a maximálisan elfogadható mennyiség eléréséig. Az ajánlatok beküldését követően az MNB jogosult emelni a maximálisan elfogadható mennyiséget.

Az euro likviditást nyújtó kéthetes jegybanki EUR/HUF FX-swap tender keretében kötött ügyletek induló lábán használt árfolyamot az MNB rögzíti, az megegyezik az aktuális piaci árfolyammal. Az MNB fedezeti számlát vezet az Ügyfeleknek, és naponta kiértékeli az Ügyfél valamennyi nyitott jegybanki EUR/HUF FX-swap ügyletét. Ezen ügyletek vonatkozásában a forintlábak kamatokkal növelt összegének és a fedezetiszámla-egyenleg együttes összegének (együttesen: forint fedezet) minden nap el kell érnie az Ügyfélnek ezen ügyletekből származó, MNB felé fennálló euro tartozásának forintban kifejezett összegének 105 százalékát. Az euro összeg forintra történő átszámítása az MNB adott napi hivatalos EUR/HUF árfolyamán történik.

Amennyiben az Ügyfél forint fedezete az adott napi kiértékeléskor a szükséges értéket nem éri el, akkor az MNB az Ügyfél egyidejű értesítése mellett megterheli az Ügyfél MNB-nél vezetett pénzforgalmi számláját a szükséges fedezettség eléréséhez hiányzó összeggel, és az összeget az Ügyfél fedezeti számlájára vezeti. Amennyiben a forint fedezet a szükséges értéket a kiértékeléskor meghaladja, a többletet az MNB az Ügyfél fedezeti számlájáról az Ügyfél MNB-nél vezetett pénzforgalmi számlájára vezeti. Az MNB az Ügyfél fedezeti számlájának pozitív egyenlegére a mindenkori jegybanki alapkamatnak megfelelő kamatot fizet, amit minden hónap utolsó napján ír jóvá az Ügyfél MNB-nél vezetett pénzforgalmi számláján. Az Ügyfél fedezeti számlájának negatív egyenlegére az Ügyfél a mindenkori jegybanki alapkamatnak megfelelő kamatot fizet az MNB részére, amelynek összegével az MNB minden hónap utolsó napján megterheli az Ügyfél MNB-nél vezetett pénzforgalmi számláját.

Ezen tender és az MNB más, EUR/HUF FX-swap tenderei keretében az MNB és az Ügyfél a bármilyen futamidejű lejáró, valamint új EUR/HUF FX-swap ügyletekből eredő, egyazon értéknapi eső, azonos pénznemben fennálló, egymással szembeni fizetési kötelezettségeiket kölcsönösen beszámítják, nettó módon számolják el, és csak a különbözet összegét fizetik meg egymásnak.

Az MNB az euro likviditást nyújtó kéthetes futamidejű jegybanki EUR/HUF FX-swap tender esetében a fizetés fizetés után (Payment after payment, PaP) elvet alkalmazza, ami azt jelenti, hogy az ügyletből eredő kötelezettségének csak az ügyfél fizetési teljesítésének megtörténte után tesz eleget.

Az euro likviditást nyújtó kéthetes futamidejű jegybanki EUR/HUF FX-swap tender részletes paraméterei

Ügylet neve	Euro likviditást nyújtó kéthetes futamidejű jegybanki EUR/HUF FX-swap tender
Meghirdetés/felhívás időpontja, helye, tartalma	A benyújtható maximális swappontot és a maximálisan elfogadható mennyiséget az MNB a jelen tenderfeltételekben, a Reuters NBHP és a Bloomberg NBH6 oldalán hirdeti meg.
Ügyfélkör	Közvetlen VIBER- vagy BKR tagsággal rendelkező belföldi (tartalékköteles) hitelintézetek
Kezdeményező	Ügyfél
Üzletidő / ajánlatok fogadási ideje	15:00-15:30
Ajánlatok formai kellékei, tartalma	Az ajánlatok Reuters Dealingen vagy faxon nyújthatók be, az igényelt euro összeg és a swappontban kifejezett árajánlat megjelölésével
Beadható ajánlatok száma ajánlattevőnként	3
Ajánlati korlát	Ajánlatonként legalább 5 millió euro, 1 millió euro egész számú többszöröseként
Módosítási lehetőség	Nincs
Elfogadási lépcsőköz	1 millió euro
Eredményhirdetés időpontja, helye	A tender napján 16:00 óra, a Reuters NBHN és a Bloomberg NBH6 oldalán
Eredményhirdetés tartalma	Benyújtott ajánlatok összege, elfogadott ajánlatok összege, elfogadott legmagasabb, legalacsonyabb és átlagos swappont
Induló láb pénzügyi teljesítésének / elszámolásának napja	2014. december 23.
Lejáratiláb pénzügyi teljesítésének / elszámolásának napja	2015. január 7.
A napi kiértékelés és a fedezeti számla-műveletek időpontja	14:00 óra és VIBER zárás között.
Az MNB-vel szemben fennálló euro fizetési kötelezettség teljesítése	A Magyar Nemzeti Bank forint és külföldi pénznemek között végzett azonnali devizapiaci műveleteire vonatkozó állandó számlakapcsolataiban meghatározott EUR számlára

Az itt nem szabályozott kérdésekben „A Jegybank forint- és devizapiaci műveleteinek üzleti feltételei” érvényesek.

Budapest, 2014. december 22.

MAGYAR NEMZETI BANK