



Tájékoztató a svájci frank likviditást nyújtó rögzített áru egyhetes jegybanki EUR/CHF FX-swap tenderről

A Magyar Nemzeti Bank 2009. február 2-ától visszavonásig új svájci frank likviditást nyújtó rögzített áru egyhetes futamidejű EUR/CHF FX-swap tendert vezet be. A tender keretében az alább - a tender részletes paramétereit és feltételeit között - meghatározott ügyfélkörbe tartozó hitelintézetek (Ügyfelek) minden hét első kereskedési napján köthetnek előre meghatározott áron EUR/CHF FX-swap ügyletet az MNB-vel. Az ügylet induló lábán az Ügyfél eurót nyújt az MNB-nek svájci frankért cserébe. Az előre meghatározott, swappontban kifejezett árat az MNB a tender napján 9:00 órakor hirdeti meg a Reuters NBHM és a Bloomberg NBH10 oldalán. Amennyiben a benyújtott ajánlatok összesített értéke nem éri el az 5 milliárd eurót, az MNB minden ajánlatot elfogad az előre meghatározott áron. Amennyiben a benyújtott ajánlatok összesített értéke meghaladja az 5 milliárd eurót, akkor az ajánlatok az 5 milliárd euró eléréséig 1 millió eurós egységekben kerülnek elfogadásra az előre meghatározott áron.

A svájci frank likviditást nyújtó egyhetes jegybanki EUR/CHF FX-swap tender keretében kötött ügyletek induló lábán használt technikai árfolyamot az MNB az aktuális EUR/CHF árfolyam 95 százalékában állapítja meg. Hasonlóképpen korrigálódik a lejáratiláb is. Az induló láb korrigált árfolyama és az adott Ügyfél által euróban benyújtott ajánlati összeg szorzata adja meg azt a svájci frank összeget, amelyet az MNB az ügylet induló lábán az Ügyfél számára nyújt az Ügyfél által megadott euró összegért cserébe. Ha szélsőséges árfolyammozgás miatt a technikai induló árfolyamba épített biztosíték nem nyújt elegendő fedezetet az MNB számára, az MNB fenntartja magának a jogot, hogy az ügylet futamideje alatt további fedezet biztosítását követelje meg Ügyfeleitől.

Ezen tender keretében az MNB és az Ügyfél a lejáró ügyletből, valamint az új ügyletből eredő, egyazon értéknapi eső, azonos devizanemben fennálló, egymással szembeni fizetési kötelezettségeiket kölcsönösen beszámítják, nettó módon számolják el, és csak a különbözet devizaösszegét fizetik meg egymásnak.

Az MNB a tender keretében kötött ügyletekből származó euró fizetési kötelezettségeit az adott értéknapi 16:00 óráig teljesíti, miután Ügyfelei teljesítették az MNB euró fizetésével szemben álló svájci frank fizetési kötelezettségüket. Az MNB a tender keretében kötött ügyletekből származó svájci frank fizetési kötelezettségeit az adott értéknapi 14:00 óráig teljesíti. Az MNB fenntartja magának a jogot, hogy az egyedi ügyletkötéskor olyan feltételt állapítson meg, ami lehetővé teszi, hogy az MNB az ügyletből származó svájci frank fizetési kötelezettségeit csak azután teljesítse, hogy Ügyfelei teljesítették az MNB svájci frank fizetésével szemben álló euró fizetési kötelezettségüket.

**A svájci frank likviditást nyújtó rögzített áru egyhetes jegybanki EUR/CHF FX-swap
tender részletes paraméterei és feltételei**

Ügylet neve	Svájci frank likviditást nyújtó rögzített áru egyhetes EUR/CHF FX-swap tender
Meghirdetés/felhívás időpontja, helye, tartalma	A tender pontos időpontját, a svájci frank likviditás swappontban kifejezett rögzített árát, az induló és lejáratú láb pénzügyi teljesítésének/elszámolásának napját, valamint az ügyletkötéshez használt aktuális és technikai induló EUR/CHF árfolyamot az MNB minden hét első kereskedési napján 9:00 órakor hirdeti meg a Reuters NBHM és a Bloomberg NBH10 oldalán
Ügyfélkör	Közvetlen VIBER- vagy BKR tagsággal rendelkező belföldi (tartalékköteles) hitelintézetek
Kezdeményező	Ügyfél
Üzletidő / ajánlatok fogadási ideje	Minden hét első kereskedési napján 9:00 és 9:30 óra között
Ajánlatok formai kellékei, tartalma	Az ajánlatok Reuters Dealingen vagy telefaxon nyújthatók be
Beadható ajánlatok száma ajánlattevőnként	Nincs korlát
Ajánlati korlát	Az ajánlatokat euróban kifejezve kell benyújtani, legalább 5 millió euróra vonatkozóan, 1 millió euro egész számú többszöröseként
Módosítási lehetőség	Nincs
Technikai induló árfolyam	Az aktuális EUR/CHF árfolyam 95 százaléka
Az MNB-vel szemben fennálló euro fizetési kötelezettség teljesítése	A Magyar Nemzeti Bank forint és külföldi pénznemek között végzett azonnali FX-piaci műveleteire vonatkozó állandó számlakapcsolataiban meghatározott EUR számlára
Az MNB-vel szemben fennálló svájci frank fizetési kötelezettség teljesítése	A Magyar Nemzeti Bank Swiss National Bank-nál vezetett számlájára: SWIFT kód: SNBZCHZZ80A Számlaszám: 40645.00029

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

Budapest, 2009. március 9.

MAGYAR NEMZETI BANK