



Tájékoztató a Magyar Nemzeti Bank és az Európai Központi Bank együttműködési megállapodása alapján bevezetésre kerülő eurolikviditást nyújtó jegybanki O/N FX-swap rendelkezésre állásról

A Magyar Nemzeti Bank és az Európai Központi Bank 2008. október 16-i együttműködési megállapodása alapján a Magyar Nemzeti Bank 2008. október 16-ától visszavonásig új eurolikviditást nyújtó egynapos (overnight) futamidejű FX-swap rendelkezésre állást vezet be. A rendelkezésre állás keretében az MNB Ügyfelei minden kereskedési napon előre meghatározott áron helyezhetnek el forintot a jegybanknál euróért cserébe, FX-swap ügyletek keretében. Az ajánlatok fogadási idejét és az előre meghatározott, swappontban kifejezett árat az MNB minden kereskedési napon 9:30 órakor hirdeti meg a Reuters NBHM és a Bloomberg NBH11 oldalán.

Az eurolikviditást nyújtó jegybanki O/N FX-swap rendelkezésre állás keretében kötött ügyletek induló lábán használt árfolyam 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 fedezeti számla 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 értéknappra 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 eurolikviditást nyújtó jegybanki O/N FX-swap rendelkezésre állás 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 eurolikviditást nyújtó jegybanki O/N FX-swap rendelkezésre állás
részletes paramétereit és feltételeit**

Ügylet neve	Eurolikviditást nyújtó O/N FX-swap rendelkezésre állás
Meghirdetés/felhívás időpontja, helye, tartalma	Napi rendelkezésre állás 2008. október 16-tól visszavonásig, a rendelkezésre állás pontos időpontját és az eurolikviditás swappontban kifejezett rögzített árát az MNB minden nap 9:30 órakor hirdeti meg a Reuters NBHM és a Bloomberg NBH11 oldalán
Ügyfélkör	Közvetlen VIBER- vagy BKR tagsággal rendelkező belföldi (tartalékköteles) hitelintézetek
Kezdeményező	Ügyfél
Üzletidő / ajánlatok fogadási ideje	A felhívásban szereplő időpontban
Ajánlatok formai kellei, tartalma	Az ajánlatok Reuters Dealingen vagy telefaxon nyújthatók be
Beadható ajánlatok száma ajánlattevőnként	Nincs korlát
Ajánlati korlát	Legalább 5 millió euro, 1 millió euro egész számú többszöröseként
Módosítási lehetőség	Nincs
Induló láb pénzügyi teljesítésének / elszámolásának napja	T
Lejárat láb pénzügyi teljesítésének / elszámolásának napja	T+1
Induló árfolyam	Az aktuális piaci árfolyam
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 itt nem szabályozott kérdésekben „A Jegybank forint- és devizapiaci műveleteinek üzleti feltételei” érvényesek.

Budapest, 2009. május 11.

MAGYAR NEMZETI BANK