



Särskilda villkor för Huvudkonto

Inlåningsfacilitet för centrala motparter

Riksbanken kan på begäran av RIX-deltagare under vissa förutsättningar låta särskilda villkor gälla för Huvudkonto i enlighet med avsnitt C.3.4 i Villkor för RIX och penningpolitiska instrument. En central motpart (CCP) kan ansöka om rätten att placera likviditet i svenska kronor i Riksbanken över natten i enlighet med vad som anges nedan.

Berättigade till faciliteten

Clearingorganisationer som;

- har rätt att verka som central motpart i enighet med EU:s förordning om OTC-derivat, CCP:er och transaktionsregister (Emir);
- clearar i svenska kronor; och
- är RIX-deltagare.

Utnyttjande

Faciliteten utnyttjas genom att den centrala motparten har ett tillgodohavande på sitt Huvudkonto i RIX när RIX stänger för dagen. Det finns ingen beloppsbegränsning för detta saldo. Beloppsbegränsningen i C.3.1 i Villkor för RIX och penningpolitiska instrument är därmed inte gällande för detta Huvudkonto.

Ränta

Ränta beräknas efter en räntesats som motsvarar Riksbankens vid var tid gällande reporänta efter avdrag med 0,75 procentenheter

Rapporteringskrav

Den centrala motparten ska på begäran lämna information om sin fullständiga likviditetsstruktur i svenska kronor och övriga uppgifter som kan vara nödvändiga för att Riksbanken ska kunna utföra sina uppgifter.



Avtalsmässig tillämpning

Tillgång till inlåningsfaciliteten lämnas genom att Riksbanken beslutar att särskilda villkor får gälla för den centrala motpartens Huvudkonto i enlighet avsnitt C.3.4 i Villkor för RIX och penningpolitiska instrument. De särskilda villkoren är de som framgår ovan.

För det fall den centrala motparten inte längre är berättigad till faciliteten enligt dessa särskilda villkor eller på annat sätt inte uppfyller de särskilda villkoren har Riksbanken rätt att besluta om att de särskilda villkoren ska upphöra att gälla för Huvudkontot.

Ansökan

För att kunna utnyttja inlåningsfaciliteten ska den centrala motparten ansöka om att särskilda villkor ska tillämpas för den centrala motpartens Huvudkonto i RIX.

Ansökans form

Ansökan ska göras skriftligt och vara undertecknad av behörig firmatecknare för den centrala motparten. Behörighetshandling för undertecknaren ska bifogas. Ansökan ska

Skickas per post till

Sveriges riksbank

Avdelningen för marknader

Enheten för marknadsstrategi

103 33 STOCKHOLM

och elektroniskt till

afm.enheten.for.marknadsstrategi@riksbank.se

Ansökans innehåll

I ansökan ska den centrala motparten

1. Förklara på vilket sätt man uppfyller kraven för att vara berättigad att ha tillgång till faciliteten (se avsnittet *Berättigade till faciliteten* ovan).
2. Lämna information om sin verksamhet och likviditetssituation i svenska kronor:
 - Information om exponeringar i SEK, både kredit och likviditet
 - Information om likviditetsbuffert i SEK
 - Information om likviditetspolicy
 - Information om likviditetsarrangemang i SEK
 - Information om volymer i SEK-avveckling
 - Information om volym i clearade kontrakt i SEK
 - Information om vilken typ av kontrakt i SEK som clearas
 - Information om godkända SEK säkerheter som accepteras
3. Bekräfta att man kommer att lämna information om sin fullständiga likviditetsstruktur i svenska kronor (jämför p. 2 ovan) och övriga uppgifter som kan vara nödvändiga för att Riksbanken ska kunna utföra sina uppgifter när Riksbanken så begär.
4. Kontaktperson med uppgift om namn, telefonnummer och e-postadress.



Ikraftträdande

Faciliteten kommer att träda i kraft vid den tidpunkt som anges i Riksbankens beslut.

Ytterligare information

Frågor rörande faciliteten och ansökningsförfarandet i stort kan ställas till afm.enheten.for.marknadsstrategi@riksbank.se, Per Åsberg Sommar. Frågor rörande punkterna 2 och 3 i ansökan ska ställas till Johanna Stenkula von Rosen.