



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. För att Riksbanken ska kunna beakta ett utnyttjande av inlåningsfaciliteten på ett korrekt sätt vid genomförande av penningpolitiska transaktioner behöver den centrala motpartens sammanlagda saldo i RIX vara oförändrat efter klockan 16. Saldot på Huvudkontot vid dagens slut (f.n. klockan 17.00) ska därför vara samma som RIX-deltagarens sammanlagda saldo på Huvudkontot samt LOM-konton klockan 16:00 samma dag.

Ränta

Ränta beräknas efter en räntesats som motsvarar Riksbankens vid var tid gällande Inlåningsränta (d.v.s. den räntesats som motsvarar Riksbankens ränta för Inlåning under de Stående Faciliteterna, enligt D.2.4.2 i Villkor för RIX och penningpolitiska instrument, f.n. 0,75 procentenheter under reporäntan). Om saldot när RIX stänger inte överensstämmer med det sammanlagda saldot klockan 16.00 (se ovan under Utnyttjande) ska den centrala motparten erlägga ränta på det största av saldot när RIX stänger och det sammanlagda saldot kl 16.00. Denna ränta beräknas efter den räntesats som motsvarar Inlåningsräntan med ett tillägg på fem 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 ska lämnas för åtminstone var och en av de närmast föregående tolv månaderna:
 - Information om exponeringar i SEK, både kredit- och likviditetsrisk
 - 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 vilka säkerheter denominerade i SEK 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

Ansökan om att särskilda villkor ska tillämpas kan lämnas från 1 november 2018. Centrala motparter som lämnar kompletta ansökningar till Riksbanken senast den 15 november 2018, har tillgång till inlåningsfaciliteten den 15 december 2018, under förutsättning att Riksbanken beviljar ansökan. Riksbankens beslut meddelas skriftligt.

För ansökan som görs senare kommer faciliteten att träda i kraft vid den tidpunkt som anges i Riksbankens beslut.

Ytterligare information

Frågor rörande faciliteten och ansökningsförfarandet i stort kan ställas till Per Åsberg Sommar, Avdelningen för Marknader, per.asberg.sommar@riksbank.se . Frågor rörande punkterna 2 och 3 i ansökan ska ställas till Johanna Stenkula von Rosen, Avdelningen för Finansiell Stabilitet, johanna.stenkulavonrosen@riksbank.se .