

ANVISNINGAR FÖR RIKSBANKENS PROGRAM FÖR KREDIT I SVENSKA KRONOR MED RÖRLIG RÄNTA MOT SÄKERHET I FÖRETAGSCERTIFIKAT



■ Anvisningar för Riksbankens program för kredit i svenska kronor med rörlig ränta mot säkerhet i företagscertifikat

Dessa anvisningar gäller från och med den 13 februari 2008.

Motparter som omfattas

1. Programmet riktar sig till Riksbankens penningpolitiska motparter, dvs. de som har tillgång till Riksbankens in- och utlåningsfaciliteter.

Anmälan till programmet

2. Motpart ska anmäla sig till programmet på blanketten Anmälan av deltagande i Riksbankens program för kredit i SEK med rörlig ränta mot säkerhet i företagscertifikat (Bilaga 1 till Kreditvillkor rörlig F-kredit). Anmälan ska skickas till Riksbanken, Enheten för marknadsanalys och operationer (telefax 08-787 01 69).
3. Anmälan ska vara Riksbanken tillhanda senast klockan 10:00 på anbudsdagen vid det första anbudstillfälle som Motparten deltar i.

Anmälan av säkerheter inför auktion

4. Motpart kan anmäla att visst certifikatsprogram ska kunna vara säkerhet för kredit som lämnas inom ramen för kreditprogrammet. Anmälan ska göras på blanketten Anmälan av certifikatsprogram som ska kunna utgöra säkerhet för Riksbankens program för kredit i SEK mot säkerhet i företagscertifikat (Bilaga 3 till Kreditvillkor F-kredit) och ska sändas till Riksbanken, Enheten för affärsstöd och betalningsservice/Betalningssystem (e-post collateral@riksbank.se, telefax 08-24 77 11) senast klockan 15:00 (CET) tredje bankdagen för anbudsdagen. Original ska sändas via post till Riksbanken, Enheten för affärsstöd och betalningsservice/Betalningssystem, 103 37 Stockholm. Sådan anmälan bör göras så snart som möjligt efter att kredit som motparten önskar delta i annonserats. Anmälan ska göras för varje anbudstillfälle.
5. Om certifikatsprogrammet eller emittenten ej har ett kreditbetyg från Standard and Poor's, Moodys' Investor Service eller Fitch Ratings, ska motparten styrka att Riksbankens kreditvärdighetskrav uppfylls. Sådant bestyrkande görs på Bilaga 3.

Endast motpart som har rätt att tillämpa Internmetoden vid beräkning av kapitaltäckning enligt Basel II kan göra sådant bestyrkande.

Riksbanken har rätt att begära kompletterande information som visar att motpartens interna bedömning av kreditvärdigheten motsvarar Riksbankens kreditvärdighetskrav.

6. Om enligt motpartens bedömning kreditvärdighetskravet för ett certifikatsprogram som motparten anmält enligt p. 4 inte längre är uppfyllt ska motparten snarast underrätta Riksbanken skriftligen om detta förhållande.

7. Om Riksbanken inte accepterar något av de anmälda certifikatsprogrammen kommer Riksbanken att underrätta motparten om detta.

Anbudsförfarande

8. Anbudsvillkoren redovisas på Saxess/OMFIE sid. RIKX.
9. Anbud lämnat per telefon ska bekräftas via telefax 08-787 01 69, senast 15 minuter efter anbudstidens utgång.
10. Tilldelning redovisas på Saxess/OMFIE sid. RIKY.

Pantförklaring och pantkonto

11. När Riksbanken får anmälan enligt p. 2 kommer Riksbanken att öppna ett speciellt värdepapperskonto, pantkonto, i VPC som ska användas för de säkerheter som ställs inom ramen för programmet.
12. Riksbanken kommer att upprätta en pantförklaring i enlighet med Bilaga 2 till Kreditvillkor F-kredit som tillställs motparten via e-post till i anmälan angiven kontaktperson.
13. Undertecknad pantförklaring ska vara Riksbanken tillhanda senast vid utgången av bankdagen före likviddagen för det första anbudstillfället som Motparten deltar i. För programmets första anbudstillfälle innebär detta fredagen den 20 februari 2009.

Information om säkerheter som kommer att lämnas

14. För att Riksbanken ska få nödvändig förberedelse tid ska Motparten senast klockan 15:00 två bankdagar före respektive likviddag informera Riksbanken om vilka certifikatsprogram samt vilka certifikat (ISIN) som kommer att lämnas som säkerhet.
15. Denna information skickas till Riksbanken, Enheten för affärsstöd och betalningsservice/Betalningssystem (e-post collateral@riksbank.se, telefax 08-24 77 11).

Leverans av säkerheter

16. Certifikat som ska utgöra säkerhet ska levereras till det särskilda värdepapperskonto som öppnats för detta låneprogram (se p. 11) senast kl. 11.00 den aktuella likviddagen. Leveransen ska ske som bruttoavveckling utan likvid i VPC-systemet (PTSA eller BTSA).

Byte av säkerheter

17. Kredittagaren äger rätt att byta säkerheter under kreditens löptid. Kredittagaren ska i förväg avisera Riksbanken om vilka säkerheter som kommer att läggas in och vilka säkerheter man önskar ta ut. Det totala säkerhetsvärdet efter bytet ska minst uppgå till kreditbeloppet jämte ränta för kreditens hela löptid. Denna avisering görs via e-post till backofficegruppen@riksbank.se. Kredittagaren registrerar därefter bruttoavvecklingstransaktioner utan likvid i VPC-systemet, först PTSA/BTSA för tillkommande säkerheter och sedan PTKO/BTKO för de säkerheter som kredittagaren önskar få ut. Riksbanken kommer efter kontroll av kvarvarande säkerhetsvärde att möta dessa transaktioner utan onödigt dröjsmål.
18. För att undvika hantering av likvid avseende förfallande certifikat ska certifikat som förfaller under kreditens löptid ersättas av annat certifikat senast på bankdagen före likviddagen. För sådant byte gäller vad som anges i p. 17

Dokumentation

19. Följande dokument gäller för programmet:

- Särskilda villkor för Riksbankens program för kredit i svenska kronor med rörlig ränta mot säkerhet i företagscertifikat (Särskilda villkor rörlig F-kredit)
- Allmänna villkor för Riksbankens program för kredit i svenska kronor med rörlig ränta mot säkerhet i företagscertifikat (Kreditvillkor rörlig F-kredit)
- Villkor för säkerheter i Riksbankens program för kredit i svenska kronor med rörlig ränta mot säkerhet i företagscertifikat (Bilaga A till Allmänna villkor för Riksbankens program för kredit i svenska kronor med rörlig ränta mot säkerhet i företagscertifikat)
- Anmälan av deltagande i Riksbankens program för kredit i svenska kronor mot säkerhet i företagscertifikat (Bilaga 1 till Allmänna villkor för Riksbankens program för kredit i svenska kronor mot säkerhet i företagscertifikat)
- Pantförklaring (Bilaga 2 till Allmänna villkor för Riksbankens program för kredit i svenska kronor med rörlig ränta mot säkerhet i företagscertifikat)
- Anmälan av certifikatsprogram till Riksbankens program för kredit i svenska kronor med rörlig ränta mot säkerhet i företagscertifikat (Bilaga 3 till Allmänna villkor för Riksbankens program för kredit i svenska kronor med rörlig ränta mot säkerhet i företagscertifikat)
- Anvisningar för Riksbankens program för kredit i svenska kronor med rörlig ränta mot säkerhet i företagscertifikat

20. För respektive anbudstillfälle gäller följande dokument

- Särskilda villkor rörlig F-kredit – Anbudsdag ...
- Kreditvillkor rörlig F-kredit

21. Gällande versioner av dokumenten publiceras på Riksbankens webbplats.

Frågor

22. Frågor rörande kreditprogrammet kan ställas till Riksbanken enligt följande:

- Rörande anbudsförfarande – Riksbanken/Enheten för marknadsanalys och operationer (tel. 08-696 69 70)
- Rörande anmälan av säkerheter – till Riksbanken/Enheten för affärsstöd och betalningsservice/Betalningssystem, Monica Rönnerdahl, tel. 08-787 04 16, Kenny Bülow. Tel. 08-787 07 04 eller Eva Carlsson-Rönnehed, tel 08-787 04 81, e-post collateral@riksbank.se)
- Rörande inlämnande och byte av säkerheter samt ut- och återbetalning av kredit- till Riksbanken/Enheten för affärsstöd och betalningsservice/Backoffice (tel. 787 05 90, e-post backofficegruppen@riksbank.se)