



Sammanfattande auktionsvillkor för lån i USD

DATUM: 2009-10-15
AVDELNING: Avdelningen för penningpolitik
HANDLÄGGARE: Enheten för marknadsanalys och operationer
HANTERINGSKLASS:

SVERIGES RIKSBANK
SE-103 37 Stockholm
(Brunkebergstorg 11)

Tel +46 8 787 00 00
Fax +46 8 21 05 31
registratorn@riksbank.se
www.riksbank.se

DNR

■ Sammanfattande villkor för Riksbankens kredit i amerikanska dollar

Detta är en sammanfattning av villkoren.

Instrument: Lån via anbud.

Motpartskrets: Riksbankens primära penningpolitiska motparter enligt Villkor för RIX och penningpolitiska instrument (Villkoren).

Valuta: Amerikanska dollar (USD).

Löptid: 84 dagar.

Erbjudet belopp: 5 miljarder USD.

Lägsta tillåtna anbud: 100 miljoner USD.

Storlek på anbud: Anbud ska avse multiplar av det lägsta tillåtna anbudet.

Högsta tillåtna anbud från enskild anbudsgivare: 2,0 miljarder USD.

Maximalt antal anbud: 10 stycken per enskild anbudsgivare.

Största tilldelning till enskild anbudsgivare: 40 procent av totalt erbjudet belopp.

Lägsta anbudsränta: Den ränta som anges av Riksbanken i Saxess/OMFIE sid. RIKU vid anbudstidens början (och som motsvarar USD 3 month Overnight Index Swap + 0,50 procentenheter).

Anbudsränta: Anges med högst tre decimaler.

Anbudstid: Tisdagen den 20 oktober, 13:00-13:30 (CET/CEST).

Lämnande av anbud	<p>Anbud ska innehålla såväl belopp (USD) som räntesats.</p> <p>Anbud lämnas per telefon 08-696 69 70, och ska konfirmeras via telefax 08-787 01 69.</p> <p>Det via telefon lämnade anbudet är bindande och ska ha lämnats före anbudstidens utgång.</p>
Tilldelning:	<p>Bud accepteras från högsta ränta och successivt lägre. Summan av volymen av de accepterade anbuderna får inte överstiga det erbjudna beloppet. Om flera anbud avser den lägsta accepterade räntan sker tilldelning pro rata.</p> <p>Riksbanken förbehåller sig rätten att tilldela ett belopp som understiger det erbjudna beloppet om enligt Riksbankens bedömning särskilda skäl föreligger.</p>
Besked om tilldelning:	<p>Tisdagen den 20 oktober klockan 14:00 (CET/CEST) i Saxess/OMFIE sid. RIKV.</p>
Avrundning:	<p>Vid eventuell nedskärning av anbudsbelopp görs detta till närmaste multipel av 1 miljon.</p>
Likviddag:	<p>Fredagen den 23 oktober 2009.</p>
Förfallodag:	<p>Fredagen den 15 januari 2010.</p>
Räntesats:	<p>Den lägst accepterade räntan tillämpas för samtliga motparter vilka erhållit tilldelning i auktionen.</p>
Räntekonvention:	<p>Verkligt antal dagar/360 (Act/360).</p>
Säkerheter:	<p>Säkerheter som godtas enligt Villkoren. För värdering av säkerheter gäller vad som anges i Villkoren. Dock skall vad som nedan anges gälla.</p> <p>Säkerheter ska finnas registrerade på särskilt värdepapperskonto som är pantsatt till Riksbanken senast klockan 15:00 (CET/CEST) på likviddagen.</p>
Återbetalning:	<p>Lånebeloppet jämte ränta ska inbetalas till Riksbankens konto hos Federal Reserve Bank of New York senast klockan 15:00 (CET/CEST) på förfallodagen.</p>
Dokumentation:	<p>Villkor för kreditavtal i amerikanska dollar med anmälan om deltagande samt pantförklaring.</p> <p>Riksbankens Standing Settlement Instruction för detta lån (som kan erhållas från Riksbanken).</p> <p>Om motparten ej tidigare lämnat Standing Settlement Instructions till Riksbanken, ska dessa lämnas via SWIFT till Riksbanken före anbudstidens början.</p>