

A Magyar Nemzeti Bank H-KE-III-116/2022. számú határozata az OTP Bank Nyrt. számára a biztosítékeszközök cseréjére vonatkozó kockázatkezelési eljárások alóli mentesítése tárgyában

Az OTP Bank Nyrt. (székhely: 1051 Budapest, Nádor u. 16.) **(Társaság)** által a Magyar Nemzeti Bankhoz (székhely: 1013 Budapest, Krisztina körút 55.) **(MNB)** benyújtott kérelemre indult eljárásban az MNB az alábbi

h a t á r o z a t o t

hozza:

Az MNB mentesíti a Társaságot (LEI: 529900W3MOO00A18X956) a DSK Bank EAD [székhely: Sofia 1036, Sofia Region (capital), Sofia Municipality, Oborishte District 19, Moskovska Str., Bulgaria, LEI kód: 529900GEH0DAUTAXUA94] és a Társaság; az OTP Bank Romania S.A. (székhely: Bucharest, District 1, 66-68 Buzesti Street, Romania, LEI kód: 5299003TM0P7W8DNUF61) és a Társaság; valamint a SKB banka d.d. Ljubljana (székhely: Ajdovščina 4, 1000 Ljubljana, Slovenia, LEI kód: 549300H7CCQ6BSQBGG72) és a Társaság között, mint ugyanazon csoporthoz tartozó pénzügyi szerződő felek között létrejövő tőzsdén kívüli származtatott ügyletek tekintetében a biztosítékeszközök cseréjére vonatkozó kockázatkezelési eljárások alól, az alábbi ügyletekre nézve:

1) szerződő felek: OTP Bank Nyrt. és DSK Bank EAD

- a. a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek eszközkategóriája: árupiac
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek típusa: swap, forward, opciós ügyletek
 - az alaptermék típusa: energia, nemesfém, közönséges fém, mezőgazdasági termékek, puha áruk, alternatív energia, egyéb
 - az ügyletek lejárat tartománya: maximum 2 év
 - a nominális pénznemek: USD, EUR, CHF, GBP, JPY, CAD
 - az elszámolási pénznemek: USD, EUR, CHF, GBP, JPY, CAD
 - az elszámolás típusa: készpénz
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható mérete: 10 millió EUR
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható éves forgalma: 5 000 millió EUR
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható éves gyakorisága: 500 ügylet/év

- b. a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek eszközkategóriája: deviza
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek típusa: forward, swap és opciós ügyletek
 - az alaptermék típusa: USD, GBP, EUR, CHF, JPY, CAD, HUF, RON, SEK, RUB, TRY, RSD, PLN, BGN, AUD, CAD, DKK, NOK, CZK, HRK
 - az ügyletek lejárat tartománya: maximum 2 év
 - a nominális pénznemek: USD, EUR, CHF, GBP, JPY, CAD, HUF, RON, SEK, RUB, TRY, RSD, PLN, BGN, AUD, CAD, DKK, NOK, CZK, HRK
 - az elszámolási pénznemek: USD, EUR, CHF, GBP, JPY, CAD, HUF, RON, SEK, RUB, TRY, RSD, PLN, BGN, AUD, CAD, DKK, NOK, CZK, HRK
 - az elszámolás típusa: készpénz
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható mérete: 60 millió EUR
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható éves forgalma: 270 000 millió EUR
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható éves gyakorisága: 4 500 ügylet/év

- c. a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek eszközkategóriája: kamat
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek típusa: forward, swap és opciós ügyletek
 - az alaptermék típusa: államkötvény, LIBOR, OIS, Central Bank Policy Rate, EURIBOR
 - az ügyletek lejárat tartománya: maximum 30 év
 - a nominális pénznemek: USD, EUR, CHF, GBP, JPY
 - az elszámolási pénznemek: USD, EUR, CHF, GBP, JPY
 - az elszámolás típusa: készpénz
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható mérete: 25 millió EUR

- a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható éves forgalma: 3 750 millió EUR
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható éves gyakorisága: 150 ügylet/év
- d. a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek eszközkategóriája: részvény
- a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek típusa: swap és opciós ügyletek
 - az alaptermék típusa: single, index
 - az ügyletek lejárat tartománya: maximum 10 év
 - a nominális pénznemek: USD, EUR, CHF, GBP, JPY, CAD
 - az elszámolási pénznemek: USD, EUR, CHF, GBP, JPY, CAD
 - az elszámolás típusa: készpénz
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható mérete: 2 millió EUR
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható éves forgalma: 100 millió EUR
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható éves gyakorisága: 50 ügylet/év

2) szerződő felek: OTP Bank Nyrt. és OTP Bank Romania S.A.

- a. a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek eszközkategóriája: deviza
- a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek típusa: forward, swap és opciós ügyletek
 - az alaptermék típusa: USD, GBP, EUR, CHF, JPY, CAD, HUF, RON, SEK, RUB, TRY, RSD, PLN, BGN, AUD, CAD, DKK, NOK, CZK, HRK
 - az ügyletek lejárat tartománya: maximum 2 év
 - a nominális pénznemek: USD, EUR, CHF, GBP, JPY, CAD, HUF, RON, SEK, RUB, TRY, RSD, PLN, BGN, AUD, CAD, DKK, NOK, CZK, HRK
 - az elszámolási pénznemek: USD, EUR, CHF, GBP, JPY, CAD, HUF, RON, SEK, RUB, TRY, RSD, PLN, BGN, AUD, CAD, DKK, NOK, CZK, HRK
 - az elszámolás típusa: készpénz
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható mérete: 50 millió EUR
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható éves forgalma: 180 000 millió EUR
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható éves gyakorisága: 3 600 ügylet/év
- b. a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek eszközkategóriája: kamat
- a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek típusa: swap és opciós ügyletek
 - az alaptermék típusa: államkötvény, LIBOR, OIS, Central Bank Policy Rate, EURIBOR, egyéb (pl. ROBOR, BUBOR, WIBOR)
 - az ügyletek lejárat tartománya: maximum 30 év
 - a nominális pénznemek: USD, EUR, CHF, GBP, JPY, HUF, RON, PLN
 - az elszámolási pénznemek: USD, EUR, CHF, GBP, JPY, HUF, RON, PLN
 - az elszámolás típusa: készpénz
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható mérete: 15 millió EUR
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható éves forgalma: 1 500 millió EUR
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható éves gyakorisága: 100 ügylet/év

3) szerződő felek: OTP Bank Nyrt. és SKB banka d.d. Ljubljana

- a. a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek eszközkategóriája: áru piac
- a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek típusa: swap, forward, opciós ügyletek
 - az alaptermék típusa: energia, nemesfém, közönséges fém, mezőgazdasági termékek, puha áruk, alternatív energia, egyéb
 - az ügyletek lejárat tartománya: maximum 2 év
 - a nominális pénznemek: USD, EUR, CHF, GBP, JPY, CAD
 - az elszámolási pénznemek: USD, EUR, CHF, GBP, JPY, CAD
 - az elszámolás típusa: készpénz
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható mérete: 10 millió EUR
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható éves forgalma: 5 000 millió EUR
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható éves gyakorisága: 500 ügylet/év
- b. a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek eszközkategóriája: deviza

- a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek típusa: forward, swap és opciós ügyletek
 - az alaptermék típusa: USD, GBP, EUR, CHF, JPY, CAD, HUF, RON, SEK, RUB, TRY, RSD, PLN, BGN, AUD, CAD, DKK, NOK, CZK, HRK
 - az ügyletek lejárat tartománya: maximum 2 év
 - a nominális pénznemek: USD, EUR, CHF, GBP, JPY, CAD, HUF, RON, SEK, RUB, TRY, RSD, PLN, BGN, AUD, CAD, DKK, NOK, CZK, HRK
 - az elszámolási pénznemek: USD, EUR, CHF, GBP, JPY, CAD, HUF, RON, SEK, RUB, TRY, RSD, PLN, BGN, AUD, CAD, DKK, NOK, CZK, HRK
 - az elszámolás típusa: készpénz
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható mérete: 60 millió EUR
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható éves forgalma: 270 000 millió EUR
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható éves gyakorisága: 4 500 ügylet/év
- c. a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek eszközkategóriája: kamat
- a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek típusa: forward, swap és opciós ügyletek
 - az alaptermék típusa: államkötvény, LIBOR, OIS, Central Bank Policy Rate, EURIBOR
 - az ügyletek lejárat tartománya: maximum 30 év
 - a nominális pénznemek: USD, EUR, CHF, GBP, JPY
 - az elszámolási pénznemek: USD, EUR, CHF, GBP, JPY
 - az elszámolás típusa: készpénz
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható mérete: 25 millió EUR
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható éves forgalma: 3 750 millió EUR
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható éves gyakorisága: 150 ügylet/év
- d. a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek eszközkategóriája: részvény
- a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek típusa: swap és opciós ügyletek
 - az alaptermék típusa: single, index
 - az ügyletek lejárat tartománya: maximum 10 év
 - a nominális pénznemek: USD, EUR, CHF, GBP, JPY, CAD
 - az elszámolási pénznemek: USD, EUR, CHF, GBP, JPY, CAD
 - az elszámolás típusa: készpénz
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható mérete: 2 millió EUR
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható éves forgalma: 100 millió EUR
 - a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek várható éves gyakorisága: 50 ügylet/év

A Társaság köteles közzétenni a fenti mentességre vonatkozó információkat.

Az eljárás során eljárási költség nem merült fel.

(...)

Budapest, 2022. március 01.

A Magyar Nemzeti Bank nevében eljáró

Dr. Barnóczki Péter
Tőkepiaci és fogyasztóvédelmi jogérvényesítési
igazgatóságért felelős igazgató