

A Magyar Nemzeti Bank H-KE-III-18/2024. számú határozata az OTP Bank Nyrt. számára a biztosítékeszközök cseréjére vonatkozó kockázatkezelési eljárások alóli mentesítés 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 Nova Kreditna Banka Maribor d.d. (székhely: Ulica Vita Kraigherja 004, 2000 Maribor, Szlovénia, LEI kód: 549300J0GSZ83GTKBZ89) (Nova KBM d.d.) 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:

Szerződő felek: OTP Bank Nyrt. és Nova KBM d.d

- 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, HKDq
 - az ügyletek lejárat tartománya: maximum 3 év
 - a nominális pénznemek: USD, EUR, CHF, GBP, JPY, CAD, HUF, RON, SEK, RUB, TRY, RSD, PLN, BGN, AUD, CAD, DKK, NOK, CZK, HKD
 - az elszámolási pénznemek: USD, EUR, CHF, GBP, JPY, CAD, HUF, RON, SEK, RUB, TRY, RSD, PLN, BGN, AUD, CAD, DKK, NOK, CZK, HKD
 - 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, RFR, 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, 2024. január 12.

A Magyar Nemzeti Bank nevében eljáró

**Dr. Barnóczki Péter s.k.,
Tőkepiaci és fogyasztóvédelmi jogérvényesítési
igazgatóságért felelős igazgató**

ELEKTRONIKUSAN ALÁÍRT IRAT