

Backtest módszertan Kiegyensúlyozó Elszámoláson

1. A visszamérés során közvetlenül azt vizsgálja a KELER KSZF, hogy az egyes elszámolási entitásokkal szemben meghatározott alapbiztosíték igények megfelelő mértékű fedezetet nyújtanak-e a napi árváltozásból eredő kockázatok fedezésére.
2. Az utótesztelést ennek megfelelően portfólió alapon végzi el, azaz a szegregáció szintjén minden egyes elszámolási entitást megvizsgál.
3. Napi rendszerességgel meghatározza az alapbiztosítékkal nem fedezett árfolyamváltozások értékét elszámolási entitásonként.
4. A 99%-os megfelelés vizsgálatakor gördülő elven, naponta vizsgálja az elszámolási entitások vonatkozásában az egy évre visszamenőleg rendelkezésre álló adatokat.
5. A visszamérés összesített eredményeiről negyedévente tájékoztatja a Kockázatkezelés Bizottságot, illetve egyedi kérésre biztosítja a hozzáférést a klíringtagok valamint a hozzájuk kapcsolódó elszámolási entitások számára a saját eredményekhez. Az aggregált eredményeket a honlapon közzéteszi.
6. Intézkedési eljárásokat határoz meg arra az esetre, ha az utótesztelés eredményei elmaradnának a várt 99%-os megfeleléségi szinttől.
7. Évente felülvizsgálja az utótesztelési módszertanát.

Kiegyensúlyozó Földgáz elszámoláson, a visszamérés módszertana eltér a magyar gázipiacon rendszerirányítóként működő klíringtag(ok) és a nem rendszerirányító klíringtagok esetében, mivel eltérő forgalmi biztosítékigény módszertan került alkalmazásra a rendszerrésztvevők és a rendszerüzemeltető vonatkozásában. Tehát külön back teszt készül a rendszerirányító(k)ra vonatkozóan és a többi klíringtagra (rendszerrésztvevőre) vonatkozóan, az alábbiak szerint:

- Azon klíringtagokra vonatkozóan, akik a magyar gázipiacon nem rendszerirányítóként működnek, az utótesztelés célja, annak vizsgálata, hogy a T-2 napra számolt forgalmi biztosítékok elegendő fedezetet nyújtanak-e a T-2 naptól a T-1 gáznapiig számított aggregált kitettségekre. A T napi (számítás napi) és T-1 napi forgalmi biztosítékok nem kerülnek bele a számításba.
- A rendszerirányító esetében pedig a T-2 gáznapi számolt forgalmi biztosítékokat viszonyítjuk a T-1 napra számolt vételárhoz. A vételár hétvége, illetve ünnepnapok esetében több napnyi vételárat is magába foglalhat. A rendszerirányítóhoz kapcsolódó vételár a többi klíringtaghoz tartozó adott gáznapi betáplálásokból és kivételezésekből kerül kiszámításra, és csak a pozitív értékek kerülnek figyelembe vételre.

Kiegyensúlyozó Földgáz elszámoláshoz kapcsolódóan a napi back tesztek mellett a KELER KSZF készít kalibrációs back teszteket is. A kalibrációs back teszt esetében is minden elszámolási napra vonatkozóan két számítás készül, külön a rendszerirányító(k)ra vonatkozóan, és a többi klíringtagra vonatkozóan. A kalibrációs back tesztek során kerül meghatározásra, kalibrálásra a szakértői puffer mértéke. A szakértői puffer egy modell korrekciós paraméter, melynek értéke 0%, amennyiben a napi back teszt eredménye eléri a 99%-ot. Amennyiben a napi back teszt megfelelés nem éri el a 99%-ot, akkor a szakértői puffer értéke 0%-nál nagyobb értéket fog felvenni, és ezzel a paraméterrel kerül növelésre a forgalmi biztosíték értéke.