

A KELER KSZF Zrt. Értékpapír- és deviza befogadási kondíciói

Hatályba lépés dátuma: 2018. január 12.

A KELER KSZF Zrt. Általános Üzletszabályzata alapján pénzügyi garanciaként a következőkben felsorolt értékpapírokat és devizákat fogadja el.

A magyar forintban denominált értékpapírok közül¹:

- az MTS Hungary-re bevezetett, illetve az EuroMTS és az ÁKK Zrt. között létrejött megállapodás szerint az MTS Hungary-re bevezetendő állampapírokat,
- az MTS Hungary-re történő bevezetéstől függetlenül a diszkontkincstárjegyeket és az egyéves magyar állampapírokat (korábbi nevén: kamatozó kincstárjegyeket),
- a BÉT-re bevezetett jelen kondíciós listában szereplő BUX-kosárban szereplő részvények közül: OTP, MOL, MTELEKOM, RICHTER.

A fentebb felsorolt értékpapírok CEEGEX jogcímre nem zárolhatóak fedezetként.

Külföldi devizákban denominált értékpapírok²:

A KELER KSZF Zrt. ilyen pénzügyi eszközt nem fogad be.

Befogadható pénzügyi eszközök:

A KELER KSZF Zrt. pénzügyi garanciaként elfogadja a magyar forintot (HUF-ot), továbbá a külföldi devizák közül: a CHF-et, az EUR-t, a GBP-t, és az USD-t, ***ez alól kivételt képeznek a CEEGEX jogcímre történő zárolások, ahol kizárólag EUR és HUF az elfogadott eszköz.***

A pénzügyi garanciaként befogadott értékpapírokat és devizákat a KELER KSZF Zrt. naponta, az elszámolási nap végén értékeli, miután értékpapíronként és devizánként megállapította a következő elszámolási napon alkalmazásra kerülő napi újraértékelési, és az ezzel megegyező, következő elszámolási napra vonatkozó zárolási árfolyamot (befogadási árfolyam).

A befogadási árfolyam számítása:

A befogadási árfolyam számítása értékpapírok és devizák esetében az alábbiak szerint történik:

$\text{Befogadási árfolyam} = \text{Értékelés alapjául szolgáló ár} * (1 - \text{haircut}\%)$

Az értékelés alapjául szolgáló ár: az értékpapír vagy deviza piaci értékét tükröző ár, amelyet a piaci információk alapján a KELER KSZF Zrt. értékpapíronként és devizánként naponta határoz meg,.

Haircut:

A haircut az adott eszköz kockázatát tükröző, százalékos formában meghatározott érték.

Limitkezelés:

Jelen kondíciók szerint bizonyos eszközök befogadhatósága limithez kötött, így a zárolás alkalmával egyes eszközök befogadását a KELER KSZF Zrt. visszautasíthatja.

Az egyes értékpapírokra alkalmazott befogadási kondíciók (értékelés alapjául szolgáló árak, haircut-ok), kategóriánként a következők:

¹ 2 nappal a lejárat előtt a KELER KSZF Zrt. nem fogad be HUF-ban denominált Magyar állampapírokat, kamatozó kincstárjegyeket és diszkontkincstárjegyeket

Értékpapír kategória		Értékelés alapjául szolgáló ár	Haircut	Limit
Magyar állampapírok	<1 év	ÁKK referencia hozamokból számított ár	2%	Korlátlan
	1-3 év		5%	Korlátlan
	3-10 év		8%	Korlátlan
	>10 év		12%	Korlátlan
Diszkontkincstárjegyek			2%	Korlátlan
Kamatozó kincstárjegyek			2%	Korlátlan
Részvények	OTP	legutolsó tőzsdei ár	24%	9 Mrd Ft
	MOL		20%	3 Mrd Ft
	RICHTER		15%	4 Mrd Ft
	MTELEKOM		15%	1 Mrd Ft

Az egyes devizák befogadási kondíciói a következők:

Biztosítékként befogadott devizák	Értékelő árfolyam	Haircut	Limit
HUF	Névleges érték	0%	Korlátlan
CHF	MNB deviza középárfolyam	8%	Korlátlan
EUR		7%	Korlátlan
GBP		7%	Korlátlan
USD		9%	Korlátlan

Energiapiaci biztosítékok egyedi kezelése:

Az energiapiaci alklíringtagok vonatkozásában az energiapiaci ügyletek teljesítésének biztosítékául elhelyezett EUR haircutja 0%-ban kerül meghatározásra.

CEEGEX piaci biztosítékok egyedi kezelése:

Gázpiaci klíringtagok vonatkozásában a CEEGEX jogcímre biztosítékként elhelyezett EUR haircutja 0%-ban kerül meghatározásra, a HUF haircut-ja pedig 7%-ban kerül meghatározásra.

A befogadási árfolyamok nyilvánossága:

Az egyes értékpapírokra és devizákra vonatkozó aktuális befogadási árfolyamok a napi értékelést követően a KID terminálokra kérdezhetők le. A közzétett befogadási árfolyamok minden esetben a soron következő értékelésig érvényesek.

Saját kibocsájtású papírokra vonatkozó korlátozások:

A KELER K SZF Zrt. értékpapírban elhelyezett pénzügyi garanciaként nem fogadja el a klíringtagjaitól a klíringtagok vagy azokhoz közvetett vagy közvetlen tulajdonlás útján kapcsolódó társult vállalkozások által kibocsátott értékpapírokat. Az előbbiekből kivételt képeznek a központi bankok vagy állam által kibocsátott értékpapírok.

Rendkívüli eljárás:

A KELER KSZF Zrt. fenntartja a jogot arra, hogy amennyiben a piaci körülmények azt indokolják, akár azonnali hatállyal, napon belüli átértékeléssel is megváltoztassa befogadási kondícióit a biztosítékként elfogadott értékpapírok és devizák értékelése tekintetében.

A KELER KSZF Zrt. a befogadási feltételek változásáról a partnereit honlapján (www.kelerkszf.hu), a Tőkepiaci közzétételi rendszer honlapján (www.kozzetetelek.hu) és a KID-en értesíti.

Budapest, 2017. december 20.

KELER KSZF Zrt.