

A KELER KSZF Zrt. Értékpapír- és deviza befogadási kondíciói

Hatálybalépés dátuma: 2019. június 13.

A KELER KSZF Zrt. Általános Üzletszabályzata alapján pénzügyi garanciaként a következőkben felsorolt értékpapírokat és devizákat fogadja el. Továbbá a táblázatokban megtalálhatóak az egyes értékpapírokra alkalmazott befogadási kondíciók (értékelés alapjául szolgáló árak, haircut-ok és a KELER KSZF által az eszköz vonatkozásában alkalmazott koncentrációs limitek).

1. Multinet, BÉT derivatív és Kiegyensúlyozó és KEP piacok esetében

Kollaterál eszköz		Értékelés alapjául szolgáló ár	Haircut	Limit
Magyar államkötvények ¹	<1 év	ÁKK referencia hozamokból számított ár	2%	Korlátlan
	1-3 év		5%	Korlátlan
	3-10 év		8%	Korlátlan
	>10 év		12%	Korlátlan
ÁKK által kibocsátott HUF-ban denominált diszkontkincstárjegyek			2%	Korlátlan
ÁKK által kibocsátott HUF-ban denominált Egyéves magyar állampapírok 2019.09.29-ig			2%	4 Mrd Ft
ÁKK által kibocsátott HUF-ban denominált Egyéves magyar állampapírok 2019.09.30-tól			100%	0 Mrd Ft
Részvények	OTP	legutolsó tőzsdei ár	24%	9 Mrd Ft
	MOL		20%	3 Mrd Ft
	RICHTER		15%	4 Mrd Ft
	MTELEKOM		15%	0,6 Mrd Ft
Deviza	HUF	Névleges érték	0%	Korlátlan
	CHF	MNB középárfolyam	8%	Korlátlan
	EUR		7%	Korlátlan
	GBP		7%	Korlátlan
	USD		9%	Korlátlan

¹ Kizárólag az MTS Hungary-re bevezetett, illetve az MTS S.p.A (Italy) és az ÁKK Zrt. között létrejött megállapodás szerint az MTS Hungary-re bevezetendő HUF-ban denominált magyar államkötvények.

2. CEEGEX/HUDEX-gáz piac esetében

Kollaterál eszköz		Értékelés alapjául szolgáló ár	Haircut	Limit
Magyar államkötvények ²	<1 év	ÁKK referencia hozamokból számított ár	7%	Korlátlan
	1-3 év		8%	Korlátlan
	3-10 év		11%	Korlátlan
	>10 év		13%	Korlátlan
ÁKK által kibocsátott HUF-ban denominált Diszkontkincstárjegyek			7%	Korlátlan
ÁKK által kibocsátott HUF-ban denominált Egyéves magyar állampapírok 2019.09.29-ig			7%	A fenti táblázatnak megfelelően az összes jogcímre értendő
ÁKK által kibocsátott HUF-ban denominált Egyéves magyar állampapírok 2019.09.30-tól			100%	A fenti táblázatnak megfelelően az összes jogcímre értendő
Deviza	EUR	Névleges érték	0%	Korlátlan
	HUF	MNB középárfolyam	7%	Korlátlan

3. Energiapiaci jogcím esetében

Kollaterál eszköz		Értékelés alapjául szolgáló ár	Haircut	Limit
Deviza	EUR	Névleges érték	0%	Korlátlan
	HUF	MNB középárfolyam	7%	Korlátlan

Magyar kötvények, egyéves magyar állampapírok és diszkontkincstárjegyek befogadhatóságának korlátja:

2 nappal a lejárat előtt a KELER KSZF Zrt. nem fogadja be biztosítékeszközként a felsorolt eszközöket.

Külföldi devizákban denominált értékpapírok:

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

² Kizárólag az MTS Hungary-re bevezetett, illetve az MTS S.p.A (Italy) és az ÁKK Zrt. között létrejött megállapodás szerint az MTS Hungary-re bevezetendő HUF-ban denominált magyar államkötvények.

Befogadható eszközök értékelése:

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:

$\text{Befogadási árfolyam} = \text{Értékelés alapjául szolgáló ár} * (100\% - \text{haircut}\%)$

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.

A befogadási árfolyamok nyilvánossága:

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

Saját kibocsájtású papírokra vonatkozó korlátozások:

A KELER KSZF 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, 2019. június 6.

KELER KSZF Zrt.