

KELER KSZF – 108/2020. számú leirat

ECC limitrendszer

Hatálybalépés dátuma: 2020. december 1.

A KELER KSZF Zrt. az Általános Üzletszabályzata alapján az ECC kereskedési limitrendszert az alábbiak szerint határozza meg.

Kereskedési limitek

Az ECC által elszámolt azonnali és határidős piacokon az ECC lehetővé teszi kereskedési limitek alkalmazását. A KELER KSZF minden energiapiaci alklíringtag számára meghatároz egy kereskedési limitet, amely a beállítást követően minimum negyedévente felülvizsgálatra kerül, és amelyről a KELER KSZF értesíti az érintett alklíringtagokat elektronikus e-mail formájában. A kereskedési limit kizárólag pénzügyi limit, mennyiségi limitek nem kerülnek alkalmazásra.

A kereskedési limitek a KELER KSZF belső módszertana alapján kerülnek meghatározásra, az alábbi komponensek alapján:

- alklíringtagi minősítés: a KELER KSZF évente minősíti energiapiaci alklíringtagjait objektív pénzügyi és egyéb szubjektív szempontok alapján (Know Your Customer kérdőív), melynek eredménye befolyásolhatja a végső limitet,
- az elhelyezett alapszintű pénzügyi fedezetek összege,
- az ECC által számított alapbiztosíték igény átlagos alakulása az elmúlt negyedévben,
- kiegészítő pénzügyi fedezet összege (amennyiben rendelkezésre áll)

A meghatározott kereskedési limitet a KELER KSZF alklíringtagjai saját maguk allokálhatják az azonnali és határidős piacok között, szükségletüknek megfelelően. Az azonnali piacokon pre-trade limitek beállítására van lehetőség, az aukciós és folyamatos kereskedésű piacokra egyaránt. Az aukciós kereskedésű piacokon a kereskedési limit kereskedési napra szól, és naponta visszaáll a maximumra, míg a folyamatos kereskedésű piacokon a kereskedési limit elszámolási ciklushoz kötött, ezért mértékének elégségesnek kell lenni a hétvégi időszakra, illetve esetleges ECC munkarend szerinti hosszúhétvégékre.

Határidős piaci tagsággal is rendelkező alklíringtagoknak egy post-trade TMR (Total Margin Requirement) margin limit kerül beállításra. A post-trade margin limit lényege, hogy az alklíringtagok összes (azonnali és határidős piacot is beleértve), ECC által számított margin igénye nem haladja meg a beállított TMR értéket.

Kereskedési limitek változtatása

Az energiapiaci alklíringtagoknak lehetősége van a kereskedési limitek növelésére (csökkentésére), önkéntes alapszintű pénzügyi fedezet elhelyezésével (visszakérésével), figyelembe véve a megfelelő szorzókat, a megfelelő piacoknál. A kereskedési limitek változtatásának menete a következő:

1. A változtatási igényt minden esetben a limits@kelerkszf.hu email címre kérjük jelezni, megjelölve a növelésre (csökkentésre) szánt összeget és az érintett piacokat. Limit emelés kérése esetén az emeléshez szükséges összegnek rendelkezésre kell állnia az alklíringtag választott Settlement bankjánál vezetett folyószámláján.

2. Limitemelés esetén a KELER KSZF a limitemeléshez szükséges összeggel megterheli az alkíringtag Settlement banknál vezetett folyósámláját, limit csökkentés esetén az összeg a KELER KSZF által jóváírásra kerül az alkíringtag Settlement banknál vezetett folyósámláján.

A KELER KSZF-nek az adott nap 16:00 p.m. CET.-ig beérkezett limitmódosítási kéréseket áll módjában végrehajtani, abban az esetben amennyiben a limit növeléséhez szükséges összeg rendelkezésre áll az alkíringtag folyósámláján. Amennyiben az összeg rendelkezésre áll a megfelelő számlán 16:00 p.m. CET határidőig úgy a kereskedési limit aznap megemelésre kerül, legkésőbb az aznapi klíringnap végéig. Amennyiben az összeg nem áll rendelkezésre 16:00 p.m. CET határidőig, akkor már csak a következő klíringnap nyílik lehetőség az emelésre.

Szerbiában bejegyzett energiapiaci alkíringtagok számára **EUR-ban** teljesítendő energiapiaci alapszintű pénzügyi fedezet az energiapiaci alkíringtag saját, OTP Szerbiánál (OTP Banka Srbija) vezetett energiapiaci számlájára utalandó:

IBAN: a számla nyitásakor az OTP Szerbia által megadott számlaszám

Kedvezményezett szla.vezető bank SWIFT: OTPVRS22

Kedvezményezett szla.vezető bank neve: OTP Banka

Kedvezményezett neve: KELER KSZF Zrt.

Kereskedési limitek változtatása felülvizsgálati időszakban

Az energiapiaci alkíringtagok kereskedési limitei legalább negyedévente felülvizsgálatra kerülnek. A felülvizsgálat, a negyedévet követő hónapban zajlik, amelynek eredményéről az energiapiaci alkíringtag elektronikus e-mail útján értesítést kap.

A KELER KSZF fenntartja a jogot, hogy a felülvizsgálat napján a kereskedési limitek változtatására nincs lehetőség.

A felülvizsgálat eredményéről a KELER KSZF minden esetben értesíti energiapiaci alkíringtagjait, beleértve azon határidőt is, meddig az energiapiaci alkíringtagoknak lehetőségük van a változtatásra. A közölt határidőt követően a kereskedési limit változtatásra nincs lehetőség.

Budapest, 2020. november 26.

KELER KSZF Zrt.