

KELER KSZF – 109/2022. számú leirat

CEEGEX azonnali piac

Hatálybalépés dátuma: 2022. augusztus 1.

A KELER KSZF Zrt. Általános Üzletszabályzata alapján a **CEEGEX** Közép-Kelet-Európai Szervezett Földgázpiac Zrt. (továbbiakban CEEGEX) azonnali piaci garanciarendszere az alábbiak szerint került meghatározásra:

Azonnali piaci biztosíték számítás

Forgalmi biztosíték

- KELER KSZF által algoritmus alapján meghatározott forgalmi biztosíték igény CEEGEX piacon nincs. A Klíringtagok önkéntes alapon, a kívánt kereskedési limitjeiknek megfelelően határozhatják meg a szükséges forgalmi biztosíték összegét.
- A klíringtagoknak a tervezett kereskedési limitjüknek és a kitettségüknek megfelelő mértékű kollaterál eszközt (EUR) kell elhelyezniük forgalmi biztosítékként.
- Amennyiben a Klíringtagok pénzügyi kötelezettséget nem generálnak, úgy nem szükséges elhelyezni forgalmi biztosítékot, tehát a minimum forgalmi biztosíték CEEGEX klíringtag esetén: 0 EUR.

Pozíciós limit a CEEGEX azonnali piac vonatkozásában

A pozíciós limit a KELER KSZF kedvezményezettséggel CEEGEX jogcímre zárolt biztosítékeszközök pénzügyi pozíciókkal korrigált mindenkori értéke.

$$\text{Pozíciós limit} = \frac{B}{1 + \hat{A}FA} + T + \min(Tp; 0) + \min(Sp; 0)$$

ahol,

- B: Biztosítékeszközök értéke (CEEGEX elszámolásra elhelyezett biztosítékok).
- $\hat{A}FA$: A belföldi gázpiaci klíringtag esetében a mindenkori $\hat{A}FA$ %-ban meghatározott mértéke, külföldi gázpiaci klíringtag esetében - jelen számításban - 0 %.
- T: Kumulált pénzügyi pozíció az aktuális elszámolási ciklusban a még el nem számolt CEEGEX tranzakciók alapján (értéke pozitív nettó eladó esetén, negatív nettó vevő esetén).
- Tp: Kumulált pénzügyi pozíció az előző elszámolási ciklusban a még el nem számolt CEEGEX tranzakciók alapján (értéke pozitív nettó eladó esetén, negatív nettó vevő esetén).
- Sp: Nettó pénzügyi pozíció az előző elszámolási ciklusban elszámolt, de még nem teljesített, CEEGEX-en kötött tranzakciók alapján (értéke pozitív nettó eladó esetén, negatív nettó vevő esetén).

Budapest, 2022. július 08.

KELER KSZF Zrt.