

KELER KSZF – 64/2021. számú leirat

HUDEX/Gáz piac

Hatálybalépés dátuma: 2021. július 9.

A KELER KSZF Zrt. Általános Üzletszabályzata alapján a HUDEX /Gáz piac garanciarendszerét az alábbiak szerint határozza meg.

Alapbiztosíték beállítási paraméterek

Termék név	Lejárat(ok)	Alapbiztosíték	Lejáratok közötti spread kedvezmény mértéke	Lejáratok közötti spread paraméterek
		EUR	%	EUR
Havi termék	minden lejáratban	5 790	67	3 821
Negyedéves termék	minden lejáratban	16 120	16	27 082
Szezonális termék	minden lejáratban	14 540	68	9 306
Éves termék	minden lejáratban	18 950	76	9 096

A Havi termék alapbiztosítéka 25 %-os prociklikussági puffert tartalmaz, a Negyedéves termék 16 %-os puffert, a Szezonális termékben a közzétételkor a prociklikussági puffer el van engedve, az Éves termékben 17 % a puffer értéke.

Lejáratok közötti spread kedvezmények:

Jelenleg a lejáratok közötti spread kedvezmények mértéke:

- Havi termék: 67 %
- Negyedéves termék: 16 %
- Szezonális termék: 68 %
- Éves termék: 76 %

A lejáratok közötti spread kedvezmény egy termékben két, ellentétes irányú pozíció (egy lejáratban vételi és egy másik lejáratban eladási) esetén alkalmazható. A lejáratok közötti spread paraméter számítása:

$$2 * \text{Alapbiztosíték} * (1 - \text{spread kedvezmény mértéke} [\%])$$

Termékek közti spread kedvezmények:

Jelenleg minden instrumentumra 0 % a termékek közötti spread kedvezmény.

Budapest, 2021. július 7.

KELER KSZF Zrt.