

KELER KSZF – 73/2021. számú leirat

HUDEX/Gáz piac

Hatálybalépés dátuma: 2021. augusztus 6.

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	72	3 242
Negyedéves termék	minden lejáratban	16 770	16	28 174
Szezonális termék	minden lejáratban	18 360	57	15 790
Éves termék	minden lejáratban	18 950	70	11 370

A Havi termék alapbiztosítéka 25 %-os prociklikussági puffert tartalmaz, a Negyedéves és a Szezonális termékekben a közzétételkor a prociklikussági puffer el van engedve, az Éves termékben 6 % a puffer értéke.

Lejáratok közötti spread kedvezmények:

Jelenleg a lejáratok közötti spread kedvezmények mértéke:

- Havi termék: 72 %
- Negyedéves termék: 16 %
- Szezonális termék: 57 %
- Éves termék: 70 %

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. augusztus 5.

KELER KSZF Zrt.