

KELER KSZF – 82/2021. számú leirat

HUDEX/Gáz piac

Hatálybalépés dátuma: 2021. augusztus 27.

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	6 610	74	3 437
Negyedéves termék	minden lejáratban	18 900	16	31 752
Szezonális termék	minden lejáratban	21 710	57	18 671
Éves termék	minden lejáratban	21 590	69	13 386

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

Lejáratok közötti spread kedvezmények:

Jelenleg a lejáratok közötti spread kedvezmények mértéke:

- Havi termék: 74 %
- Negyedéves termék: 16 %
- Szezonális termék: 57 %
- Éves termék: 69 %

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 26.

KELER KSZF Zrt.