

KELER KSZF-13-2015. számú leirat

Kereskedési Platform garanciarendszer

Hatályos: 2015. május 1.

A KELER KSZF Zrt. Általános Üzletszabályzata alapján 2015. május 1-i hatállyal az **Kereskedési Platform** garanciarendszerét az alábbiak szerint határozza meg.

FORGALMI BIZTOSÍTÉK

- Figyelembe vett visszamenőleges időszak: 12 gázhónap
- A forgalmi biztosíték százalékos mértéke: 8%.
- Forgalom meghatározás alapja: a kereskedett vételi Kereskedési Platform piaci ügyletek és vételi egyensúlytalansági pozíciók mindenkor ÁFA-val növelt bruttó értéke, továbbá a havi esedékességű korrekciós elszámolásból keletkező nettó pénzügyi kötelezettség ÁFA-val növelt bruttó értéke. Belföldi gázpiaci klíringtagok esetében a bruttó érték a mindenkor ÁFA %-ban meghatározott mértékével növelt nettó érték, míg külföldi gázpiaci klíringtagok esetében a bruttó érték megegyezik a nettó értékkel (az ÁFA mértéke 0%).
- A forgalmi biztosíték kötelezettségek számítása az adott piacon figyelembe vett visszamenőleges időszak havi kumulált ÁFA-val növelt bruttó vételi forgalom értéke alapján történik. Belföldi gázpiaci klíringtagok esetében a bruttó érték a mindenkor ÁFA %-ban meghatározott mértékével növelt nettó érték, míg külföldi gázpiaci klíringtagok esetében a bruttó érték megegyezik a nettó értékkel (az ÁFA mértéke 0%).
- Minimum: 10.000.000 Ft
- Maximum: rendszerirányítási engedélyes klíringtag esetében 750.000.000 Ft

LIMITFEDEZETTSÉG

$$\text{Limitfedez ettség} = B / (1 + \text{ÁFA}) + \left(\sum_{i=1}^n E_{\text{napi}} + \sum_{i=1}^n T_{E_{\text{napi}}} + S_{\text{előzőhavi}} + S_{K_{\text{előzőhavi}}} \right)$$

ahol,

- B = biztosítékeszközök (Gázpiaci kereskedés jogcímre KELER KSZF kedvezményezettséggel zárolt / letett eszközök)
- ÁFA = a belföldi gázpiaci klíringtag esetében a mindenkor ÁFA %-ban meghatározott mértéke, külföldi gázpiaci klíringtag esetében – jelen számításban – 0%.
- E_{napi} = tárgy gázhavi napi kumulált egyensúlytalansági pozíciókból származó nettó pénzügyi eredmény
- $T_{E_{\text{napi}}}$ = tárgy gázhavi napi kumulált kereskedett Kereskedési Platform piaci eladási ügyletekből származó pénzügyi követelés
- $S_{\text{előzőhavi}} = E + (T_V - T_E)$ az előző elszámolási ciklusból származó nettó pénzügyi eredmény, T_V = tárgy gázhavi napi kumulált kereskedett Kereskedési Platform piaci vételi ügyletekből származó pénzügyi kötelezettség
- $S_{K_{\text{előzőhavi}}} = (E + (T_V - T_E)) + E_{\text{Korrekció}}$ az előző elszámolási ciklusból származó nem teljesített pénzügyi kötelezettség, valamint az előző elszámolási ciklusból származó korrekciós nettó pénzügyi eredmény
- i = tárgy gázhavi napok száma

Budapest, 2015. március 23.

KELER KSZF Zrt.