

KELER KSZF – 65/2018. számú leirat
Kiegyensúlyozói elszámolás és Kereskedelmi
Platform garanciarendszer

Hatálybalépés dátuma: 2018. november 1.

A KELER KSZF Zrt. Általános Üzletszabályzata alapján **2018. november 1-jei hatállyal a Kiegyensúlyozói elszámolás és 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. 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: kizárólag Kiegyensúlyozói elszámolás klíringtag esetén 10.000.000 Ft.
- Minimum: Kiegyensúlyozói és Kereskedelmi Platform klíringtag esetén 10.000.000 Ft.
- Maximum: rendszerirányítási engedélyes Kiegyensúlyozási elszámolási klíringtag esetében 750.000.000 Ft.

Limitfedezettség

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

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 : 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
- $S_{\text{Kelőzőhavi}}$: $(E + (T_V - T_E)) + E_{\text{korrekció}}$ 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, 2018. szeptember 28.

KELER KSZF Zrt.