

KELER KSZF-01-2017. számú leirat

Alapszintű és kiegészítő pénzügyi fedezetek és likviditási deviza óvadék

Hatályos: 2017. január 1.

A KELER KSZF Zrt. 2017. január 1-től az Alapszintű pénzügyi fedezetek, a Kiegészítő pénzügyi fedezet, és a Likviditási deviza óvadék mértékét az alábbiak szerint határozza meg:

ALAPSZINTŰ PÉNZÜGYI FEDEZET:**Derivatív piac**

BÉT Részvény alapú ügyletkör:	10.000.000 Ft
BÉT Pénzügyi ügyletkör:	10.000.000 Ft
BÉT Áru szekció:	10.000.000 Ft

Azonnali piac

BÉT Részvény szekció és BÉT MTF piac ¹	10.000.000 Ft
BÉT Hitelpapír szekció és MTS piac ²	10.000.000 Ft

Gázpiac

Kereskedési Platform	10.000.000 Ft
CEEGEX azonnali piac	10.000.000 Ft
CEEGEX fizikai határidős piac	10.000.000 Ft

Energia piac

EEX határidős piacok	50.000 EUR
EEX spot piac	50.000 EUR
EPEX SPOT piac	
• EUR elszámolású termékek	50.000 EUR
• GBP elszámolású termékek	40.000 GBP
EPEX SPOT Belgium spot piac	50.000 EUR
HUPX fizikai határidős piac	50.000 EUR
HUPX spot piac	50.000 EUR
Powernext/PEGAS spot piac ³	50.000 EUR
Powernext/PEGAS határidős piac ⁴	50.000 EUR
PXE határidős piac	50.000 EUR
PXE spot piac	50.000 EUR
SEEPEX spot piac	50.000 EUR
NOREXECO határidős piac	50.000 USD

Amennyiben az energia piaci alklíringtag a fent felsorolt energia piacok közül kettőnél több piacra lép be, a harmadik energia piacra való belépéstől az alapszintű pénzügyi fedezet 25.000 EUR piaconként.

Példa 1: XYZ alklíringtag az alábbi energia piacokra lép be, az alábbi alapszintű pénzügyi fedezet igényt kell teljesíteni a KELER KSZF Zrt. felé:

- HUPX spot piac
- HUPX határidős piac
- EEX spot piac
- PXE spot piac

¹ A BÉT Részvény szekció és BÉT MTF piaci tagság külön-külön, vagy együttes megléte esetén alkalmazott érték.

² A BÉT Hitelpapír szekció és az MTS piaci tagság külön-külön, vagy együttes megléte esetén alkalmazott érték.

³ 2014. december 31. előtt EEX tagsággal gáztermékekben kereskedő ügyfelek mentesülnek a Powernex/PEGAS spot piacra lépés esetén teljesítendő 50.000 EUR teljesítése alól.

⁴ 2014. december 31. előtt EEX tagsággal gáztermékekben kereskedő ügyfelek mentesülnek a Powernex/PEGAS határidős piacra lépés esetén teljesítendő 50.000 EUR teljesítése alól.

XYZ alklíringtag alapszintű pénzügyi fedezet igénye: 150.000 EUR (=50.000 EUR +50.000 EUR +25.000 EUR + 25.000 EUR)

Példa 2: ABC alklíringtag az alábbi energia piacokra lép be, az alábbi alapszintű pénzügyi fedezet igényt kell teljesíteni a KELER KSHF Zrt. felé:

- EPEX SPOT piac GBP elszámolású termékek
- EPEX SPOT piac EUR elszámolású termékek
- SEEPEX spot piac

ABC alklíringtag alapszintű pénzügyi fedezet igénye: 40.000 GBP + 75.000 EUR (=40.000 GBP + 50.000 EUR + 25.000 EUR)

Példa 3: ABC alklíringtag az alábbi energia piacokra lép be, az alábbi alapszintű pénzügyi fedezet igényt kell teljesíteni a KELER KSHF Zrt. felé:

- EPEX SPOT GBP elszámolású termékek
- NOREXECO
- EPEX SPOT EUR elszámolású termékek

ABC alklíringtag alapszintű pénzügyi fedezet igénye: 40.000 GBP + 50.000 USD + 25.000 EUR

KIEGÉSZÍTŐ PÉNZÜGYI FEDEZET:

A KELER KSHF Zrt. hatályos Üzletszabályzatával összhangban klíringtagsági és energiapiaci alklíringtagsági jogviszony keletkeztetésekor és az éves adatszolgáltatási kötelezettség keretében benyújtott pénzügyi beszámoló auditátlansága esetében az egyszeri kiegészítő pénzügyi fedezet mértéke:

10.000.000 Ft

Újonnan csatlakozó (al)klíringtag esetében, ha a kérelmező cégbejegyzésére a kérelem benyújtását megelőző hat hónapról nem régebben került sor, vagy a kérelmező a kérelem benyújtásának évében alakult, a KELER KSHF eltekint az auditált mérleg és eredmény-kimutatás megküldésétől

A KELER KSHF Zrt. hatályos Üzletszabályzatával összhangban, amennyiben az éves adatszolgáltatási kötelezettség keretében a kitöltött Risk Know Your Customer kérdőívet a beküldési határidőt követő tizenötödik napig sem nyújtják be, úgy a dokumentum beérkezéséig az egyszeri kiegészítő pénzügyi fedezet mértéke:

10.000.000 Ft

A kiegészítő pénzügyi fedezet a mindenkor hatályos értékpapír- és deviza befogadási kondíciós listában szereplő értékpapírokban, devizákban tehető le, valamint bankgaranciában a hatályos bankgarancia befogadási kondíciók alapján.

LIKVIDITÁSI DEVIZA ÓVADÉK: Nem alkalmazott!

Budapest, 2017. január 2.
KELER KSHF Zrt.