

KELER KSZF – 71/2017. számú leirat
Alapszintű és kiegészítő pénzügyi fedezetek és
likviditási deviza óvadék

Hatálybalépés dátuma: 2017. október 13.

A KELER KSZF Zrt. 2017. október 13-tól az Alapszintű pénzügyi fedezetek, a Kiegészítő pénzügyi fedezet, és a Likviditási deviza óvadék mértékét az alábbiak szerint határozza meg és teszi közzé a megbízók nevesítésére vonatkozó limitet:

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	34.000 EUR
CEEGEX fizikai határidős piac	34.000 EUR

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

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 40.000 EUR teljesítése alól.

⁴ 2014. december 31. előtt EEX tagsággal gáztermékekben kereskedő ügyfelek mentesülnek a Powernex/PEGAS határidős piacra lépés esetén teljesítendő 40.000 EUR teljesítése alól.

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 20.000 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

XYZ alklíringtag alapszintű pénzügyi fedezet igénye: 120.000 EUR (=40.000 EUR +40.000 EUR +20.000 EUR + 20.000 EUR)

Példa 2: ABC alklíringtag az alábbi energia piacokra lép be, az alábbi alapszintű pénzügyi fedezet igényt kell teljesíteni a KELER KSZF 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 + 60.000 EUR (=40.000 GBP + 40.000 EUR + 20.000 EUR)

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

- EPEX SPOT GBP elszámolású termékek
- NOREXCO
- EPEX SPOT EUR elszámolású termékek

ABC alklíringtag alapszintű pénzügyi fedezet igénye: 40.000 GBP + 50.000 USD + 20.000 EUR

Kiegészítő pénzügyi fedezet

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

10.000.000 Ft

CEEGEX gázpiaci klíringtagok esetében az egyszeri kiegészítő pénzügyi fedezet mértéke 34.000 EUR.

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

A KELER KSZF 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

CEEGEX gázpiaci klíringtagok esetében az egyszeri kiegészítő pénzügyi fedezet mértéke 34.000 EUR.

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

Fentiek alapján, de attól eltérően - Szerbiában bejegyzett energiapiaci alklíringtagra kivetett kiegészítő pénzügyi fedezetek esetében azok mértéke:

34.000 EUR /jogcímenként/

Likviditási Deviza Óvadék

Nem alkalmazott!

Megbízók nevesítésére alkalmazott limit

A KELER KSZF Zrt. az Üzletszabályzat 3.6.2. pontjának értelmében a megbízók nevesítésére alkalmazott limitet az alábbi mértékben határozza meg: 30.000.000 Ft

Budapest, 2017.október 9.

KELER KSZF Zrt.