

8-01 KELER KSZF Kondíciós lista

Értékpapír- és deviza befogadás kondíciói

Hatályba lépés dátuma: 2023. február 15.

A KELER KSZF Zrt. Általános Üzletszabályzata alapján pénzügyi garanciaként a következőkben felsorolt értékpapírokat és devizákat fogadja el. Továbbá a táblázatokban megtalálhatóak az egyes értékpapírokra alkalmazott befogadási kondíciók (értékelés alapjául szolgáló árak, haircut-ok és a KELER KSZF által az eszköz vonatkozásában alkalmazott koncentrációs limitek).

1. Multinet, BÉT derivatív piacok esetében

Kollaterál eszköz		Értékelés alapjául szolgáló ár	Haircut	Limit
Magyar államkötvények ¹	<1 év	ÁKK referencia hozamokból számított ár	2%	Korlátlan
	1-3 év		5%	Korlátlan
	3-10 év		13%	Korlátlan
	>10 év		15%	Korlátlan
ÁKK által kibocsátott HUF-ban denominált diszkontkincstárjegyek				2%
Részvények	OTP	legutolsó tőzsdei ár	24%	5,5 Mrd Ft
	MOL		20%	2,5 Mrd Ft
	RICHTER		15%	2 Mrd Ft
	MTELEKOM		15%	0,3 Mrd Ft
Deviza	HUF	Névleges érték	0%	Korlátlan
	CHF	MNB középfolyam	8%	Korlátlan
	EUR		7%	Korlátlan
	GBP		7%	Korlátlan
	USD		9%	Korlátlan

¹ Kizárólag az MTS Hungary-re bevezetett, illetve az MTS S.p.A (Italy) és az ÁKK Zrt. között létrejött megállapodás szerint az MTS Hungary-re bevezetendő HUF-ban denominált magyar államkötvények.

2. CEEGEX/HUDEX, Kiegyensúlyozó és KP-gáz piacok esetében

Kollaterál eszköz		Értékelés alapjául szolgáló ár	Haircut	Limit
Deviza	EUR	Névleges érték	0%	Korlátlan

3. Energiapiaci jogcím esetében

Kollaterál eszköz		Értékelés alapjául szolgáló ár	Haircut	Limit
Deviza	EUR	Névleges érték	0%	Korlátlan

A KELER K SZF a nem European Commodity Clearing AG (ECC) által meghatározott biztosítéki igények teljesítésre a közzétett leiratainak megfelelően GBP-t is elfogad kollaterál eszközként.

Magyar kötvények és diszkontkincstárjegyek befogadhatóságának korlátja:

2 nappal a lejárat előtt a KELER K SZF Zrt. nem fogadja be biztosítékeszközként a felsorolt eszközöket.

Külföldi devizákban denominált értékpapírok:

A KELER K SZF Zrt. ilyen pénzügyi eszközt nem fogad be.

Befogadható eszközök értékelése:

A pénzügyi garanciaként befogadott értékpapírokat és devizákat a KELER K SZF Zrt. naponta, az elszámolási nap végén értékeli, miután értékpapíronként és devizánként megállapította a következő elszámolási napon alkalmazásra kerülő napi újraértékelési, és az ezzel megegyező, következő elszámolási napra vonatkozó zárolási árfolyamot (befogadási árfolyam).

A befogadási árfolyam számítása:

A befogadási árfolyam számítása értékpapírok és devizák esetében az alábbiak szerint történik:

$$\text{Befogadási árfolyam} = \text{Értékelés alapjául szolgáló ár} * (100\% - \text{haircut}\%)$$

Az értékelés alapjául szolgáló ár: az értékpapír vagy deviza piaci értékét tükröző ár, amelyet a piaci információk alapján a KELER K SZF Zrt. értékpapíronként és devizánként naponta határoz meg.

Haircut:

A haircut az adott eszköz kockázatát tükröző, százalékos formában meghatározott érték.

Limitkezelés:

Jelen kondíciók szerint bizonyos eszközök befogadhatósága limithez kötött, így a zárolás alkalmával

egyres eszköök befogadását a KELER KSZF Zrt. visszautasíthatja.

A befogadási árfolyamok nyilvánossága:

Az egyes értékpapírokra és devizákra vonatkozó aktuális befogadási árfolyamok a napi értékelést követően a KID rendszerben kérdezhettek le. A közzétett befogadási árfolyamok minden esetben a soron következő értékelésig érvényesek.

Saját kibocsátású papírokra vonatkozó korlátozások:

A KELER KSZF Zrt. értékpapírban elhelyezett pénzügyi garanciaként nem fogadja el a klíringtagjaitól a klíringtagok vagy azokhoz közvetett vagy közvetlen tulajdonlás útján kapcsolódó társult vállalkozások által kibocsátott értékpapírokat. Az előbbiekből kivételt képeznek a központi bankok vagy állam által kibocsátott értékpapírok.

Rendkívüli eljárás:

A KELER KSZF Zrt. fenntartja a jogot arra, hogy amennyiben a piaci körülmények azt indokolják, akár azonnali hatállyal, napon belüli átértékeléssel is megváltoztassa befogadási kondícióit a biztosítékként elfogadott értékpapírok és devizák értékelése tekintetében.

A KELER KSZF Zrt. a befogadási feltételek változásáról a ügyfeleit honlapján (www.kelerkszf.hu), a Tőkepiaci közzétételi rendszer honlapján (www.kozzetetelek.hu) és a KID-en értesíti.

Budapest, 2023. február 15.

KELER KSZF Zrt.