

KELER KSZF – 61/2019. számú leirat

ECC limitrendszer

Hatálybalépés dátuma: 2019. augusztus 6.

A KELER K SZF Zrt. az Általános Üzletszabályzata alapján az ECC kereskedési limitrendszert az alábbiak szerint határozza meg.

Kereskedési limitek

Az ECC által elszámolt azonnali és határidős piacokon az ECC lehetővé teszi kereskedési limitek alkalmazását. A KELER K SZF minden energiapiaci alklíringtag számára meghatároz egy kereskedési limitet, amely a beállítást követően minimum negyedévente felülvizsgálatra kerül, és amelyről a KELER K SZF értesíti az érintett alklíringtagokat elektronikus e-mail formájában. A kereskedési limit kizárólag pénzügyi limit, mennyiségi limitek nem kerülnek alkalmazásra.

A kereskedési limitek a KELER K SZF belső módszertana alapján kerülnek meghatározásra, az alábbi komponensek alapján:

- alklíringtagi minősítés: a KELER K SZF évente minősíti energiapiaci alklíringtagjait objektív pénzügyi és egyéb szubjektív szempontok alapján (Know Your Customer kérdőív), melynek eredménye befolyásolhatja a végső limitet,
- az elhelyezett alapszintű pénzügyi fedezetek összege,
- az ECC által számított alapbiztosíték igény átlagos alakulása az elmúlt negyedévben,
- kiegészítő pénzügyi fedezet összege (amennyiben rendelkezésre áll)

A meghatározott kereskedési limitet a KELER K SZF alklíringtagjai saját maguk allokálhatják az azonnali és határidős piacok között, szükségletüknek megfelelően. Az azonnali piacokon pre-trade limitek beállítására van lehetőség, az aukciós és folyamatos kereskedésű piacokra egyaránt. Az aukciós kereskedésű piacokon a kereskedési limit kereskedési napra szól, és naponta visszaáll a maximumra, míg a folyamatos kereskedésű piacokon a kereskedési limit elszámolási ciklushoz kötött, ezért mértékének elégségesnek kell lenni a hétvégi időszakra, illetve esetleges ECC munkarend szerinti hosszúhétfvégekre.

Határidős piaci tagsággal is rendelkező alklíringtagoknak egy post-trade TMR (Total Margin Requirement) margin limit kerül beállításra. A post-trade margin limit lényege, hogy az alklíringtagok összes (azonnali és határidős piacot is beleértve), ECC által számított margin igénye nem haladja meg a beállított TMR értéket.

Kereskedési limitek változtatása

Az energiapiaci alklíringtagoknak lehetősége van a kereskedési limitek növelésére (csökkentésére), önkéntes alapszintű pénzügyi fedezet elhelyezésével (visszakérésével), figyelembe véve a megfelelő szorzókat, a megfelelő piacoknál. A kereskedési limitek változtatásának menete a következő:

1. A változtatási igényt minden esetben a kockazatkezeles@kelerkszf.hu email címre kérjük jelezni, megjelölve a növelésre (csökkentésre) szánt összeget és az érintett piacokat.
2. Az önkéntesen elhelyezendő alapszintű pénzügyi fedezet összegét az alábbi számlákra szükséges elutalni. A megjegyzés rovatba kérjük feltüntetni a cég nevét, vagy kereskedési kódját (pl: ABCEX) és az utalás célját (pl: limit emelés).

EUR-ban teljesítendő energiapiaci alapszintű pénzügyi fedezetet a **KELER KSHZ Zrt., a KELER Zrt.-nél vezetett energiapiaci technikai alapszintű pénzügyi fedezet számlájára** utalandó:

IBAN: HU46 1440 0025 7242 0607 0000 0000 (számlavezető: KELER Zrt.)

Levelező bank SWIFT: CITIGB2L

Levelező bank neve: Citibank, N.A. London Branch

Kedvezményezett szla.vezető bank SWIFT: KELRHUHB

Kedvezményezett szla.vezető bank neve: KELER Zrt. **EUR szla.szám: 14105877 (EUR)**

Kedvezményezett neve: KELER KSHZ Zrt.

GBP-ben teljesítendő energiapiaci alapszintű pénzügyi fedezetet a **KELER KSHZ Zrt., a KELER Zrt.-nél vezetett energiapiaci technikai alapszintű pénzügyi fedezet számlájára** utalandó:

IBAN: HU63 1440 0025 7242 0614 0000 0000 (számlavezető: KELER Zrt.)

Levelező bank SWIFT: CITIGB2L

Levelező bank neve: Citibank, N.A. London Branch

Kedvezményezett szla.vezető bank SWIFT: KELRHUHB

Kedvezményezett szla.vezető bank neve: KELER Zrt. **GBP szla.szám: 14105885 (GBP)**

Kedvezményezett neve: KELER KSHZ Zrt.

Szerbiában bejegyzett energiapiaci alkíringtagok számára **EUR-ban** teljesítendő energiapiaci alapszintű pénzügyi fedezet az energiapiaci alkíringtag saját, OTP Szerbiánál (OTP Banka Srbija) vezetett energiapiaci számlájára utalandó:

IBAN: a számla nyitásakor az OTP Szerbia által megadott számlaszám

Kedvezményezett szla.vezető bank SWIFT: OTPVRS22

Kedvezményezett szla.vezető bank neve: OTP Banka

Kedvezményezett neve: KELER KSHZ Zrt.

- Az utalandó összeg beérkezési határideje: 15:00 p.m. CET.** A határidőt követően beérkező összeg automatikusan átvezetésre kerül az energiapiaci alkíringtag KELER Zrt.-nél vezetett megfelelő devizaszámlájára és a kereskedési limit nem kerül módosításra. Ilyen esetben a következő klíringnapon az alkíringtagnak kezdeményezni kell az átvezetést a fent megadott megfelelő számlaszámok valamelyikére, az összeget nem fogja a KELER KSHZ Zrt. az alkíringtag KELER Zrt.-nél vezetett számlájáról átvezetni.
- Amennyiben az összeg megérkezik a megfelelő számlára 15:00 p.m. CET határidőig úgy a kereskedési limit aznap megemelésre kerül, legkésőbb az aznapi klíringnap végéig. Amennyiben az összeg nem érkezik meg a megfelelő számlára 15:00 p.m. CET határidőig, akkor már csak a következő klíringnap nyílik lehetőség ismételt az emelésre.

Kereskedési limitek változtatása felülvizsgálati időszakban

Az energiapiaci alklíringtagok kereskedési limitei legalább negyedévente felülvizsgálatra kerülnek. A felülvizsgálat, a negyedévet követő hónapban zajlik, amelynek eredményéről az energiapiaci alklíringtag elektronikus e-mail útján értesítést kap.

A KELER KSZF fenntartja a jogot, hogy a felülvizsgálat napján a kereskedési limitek változtatására nincs lehetőség.

A felülvizsgálat eredményéről a KELER KSZF minden esetben értesíti energiapiaci alklíringtagjait, beleértve azon határidőt is, meddig az energiapiaci alklíringtagoknak lehetőségük van a változtatásra. A közölt határidőt követően a kereskedési limit változtatásra nincs lehetőség.

Budapest, 2019. augusztus 6.

KELER KSZF Zrt.