

# **KELER KSZF - 8/2020. számú leirat**

## **ECC limitrendszer**

**Hatálybalépés dátuma: 2020. január 24.**

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 hétfégi időszakra, illetve esetleges ECC munkarend szerinti hosszúhétfévékre.

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 [limits@kelerkszf.hu](mailto:limits@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 K SZF 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 számlaszám: 14105877 (EUR)

Kedvezményezett neve: KELER K SZF Zrt.

GBP-ben teljesítendő energiapiaci alapszintű pénzügyi fedezetet a KELER K SZF 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 számlaszám: 14105885 (GBP)

Kedvezményezett neve: KELER K SZF Zrt.

Szerbiában bejegyzett energiapiaci alklíringtagok számára EUR-ban teljesítendő energiapiaci alapszintű pénzügyi fedezet az energiapiaci alklíringtag 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 K SZF Zrt.

3. Az utalandó összeg beérkezési határideje: 16:00 p.m. CET. A határidőt követően beérkező összeg automatikusan átvezetésre kerül az energiapiaci alklíringtag KELER Zrt.-nél vezetett megfelelő devizaszámlájára és a kereskedési limit nem kerül módosításra. Ilyen esetben a következő klíringnapon az alklíringtagnak kezdeményezni kell az átvezetést a fent megadott megfelelő számlaszámok valamelyikére, az összeget nem fogja a KELER K SZF Zrt. az alklíringtag KELER Zrt.-nél vezetett számlájáról átvezetni.
  
4. Amennyiben az összeg megérkezik a megfelelő számlára 16:00 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 16:00 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 K SZF fenntartja a jogot, hogy a felülvizsgálat napján a kereskedési limitek változtatására nincs lehetőség.

A felülvizsgálat eredményéről a KELER K SZF 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, 2020. január 20.

KELER K SZF Zrt.