

Ügyfél-tájékoztató

A CEEGEX euró alapú kereskedelemre történő átállásáról

2017. augusztus 07.

Tisztelt Ügyfeleink!

A CEEGEX Közép-Kelet-Európai Szervezett Földgázpiac döntése szerint 2017. október 1-i gáznap szállítás nappal át kíván állni a jelenlegi forint alapú kereskedésről az **euróban történő kereskedésre**. Ezzel összhangban valamennyi kapcsolódó elszámolási, teljesítési és kockázatkezelési vonatkozású folyamat is euróban fog megvalósulni az átállást követően. A KELER Csoport kapcsolódó díjainak megállapítása, valamint az azokhoz köthető díjszámlák kiállítása viszont továbbra is forintban történik majd.

Elszámolás és teljesítés

Az euróban történő teljesítés érdekében szükséges, hogy valamennyi Ügyfelünk rendelkezzen a KELER Zrt.-nél megnyitott és folyamatosan fenntartott EUR pénzeszámlával. Ennek biztosítása érdekében - azon Ügyfelek tekintetében, akik még nem rendelkeznek EUR pénzeszámlával a KELER Zrt.-ben - a KELER K SZF Zrt. kezdeményezni fogja a KELER Zrt.-nél a számlák megnyitását, melyhez kapcsolódóan a szükséges számlaszerződések kiküldésre kerülnek aláírásra és visszaküldésre.

Kereskedés

A CEEGEX-szel folytatott egyeztetések alapján az átállás a lenti forgatókönyvek szerint fog megvalósulni.

1. táblázat: Spot szegmens

Dátum	Naptári nap	Kereskedési idő	Kereskedési deviza	Termékek	Megjegyzés	Klíring dátum	Teljesítési dátum	Teljesítési deviza
2017.09.28	Csütörtök	Folyamatos	HUF	Mind	Normál kereskedés/elszámolás	2017.09.28	2017.09.29	HUF
2017.09.29	Péntek	16:00-ig	HUF	Korlátozott	09.29 (ID), 09.30 (SA)	2017.09.29	2017.10.02	HUF
2017.09.30	Szombat	08:30-tól	EUR	Korlátozott	10.01 (SU), ID nem elérhető	2017.10.02	2017.10.03	EUR
2017.10.01	Vasárnap	02:00-tól	EUR	Korlátozott	ID elérhető, DA 08:30-tól			
2017.10.02	Hétfő	Folyamatos	EUR	Mind	Normál kereskedés/elszámolás	2017.10.03	2017.10.04	EUR
2017.10.03	Kedd	Folyamatos	EUR	Mind	Normál kereskedés/elszámolás			

2. táblázat: PhF szegmens

Dátum	Naptári nap	Kereskedési idő	Kereskedési deviza	Termékek	Megjegyzés	Klíring dátum	Teljesítési dátum	Teljesítési deviza
2017.09.28	Csütörtök	8:30-16:30	HUF	Mind	Normál kereskedés/elszámolás	2017.09.28	2017.09.29	HUF
2017.09.29	Péntek	8:30-16:30	HUF	Mind	Normál kereskedés/elszámolás	2017.09.29	2017.10.02	HUF
2017.10.02	Hétfő	8:30-16:30	EUR	Mind	Normál kereskedés/elszámolás	2017.10.02	2017.10.03	EUR

A bemutatott forgatókönyvek alapján látható, hogy 2017.09.30-a 8:30 órát követően a kereskedés már euróban történik, melynek megfelelően a 2017.10.01-i szállítási napra vonatkozó ügyletek is euróban kerülnek elszámolásra és teljesítésre. A 2017.09.28-án lejárató októberi havi szállítási PhF ügyletek a **2017.09.29-i hivatalos MNB devizaárfolyamon** átváltásra kerülnek HUF-ról EUR-ra az első pénzügyi teljesítési nap **2017.10.03** lesz (együtt a 10.01-10.02-i szállítási napokkal). A nyitott pozíciók árkülönbözetei 2017.10.02-án még HUF-ban, azt követően EUR-ban kerülnek rendezésre.

Kockázatkezelés

A kereskedési deviza változása önmagában nem eredményez változtatást a kockázatkezelési módszertanban, azonban a biztosítékként elfogadott eszközök kezelése változik. A kereskedési és a teljesítési deviza összhangjának megteremtése érdekében a **HUF-ban megképzett számlapénz biztosítékok és bankgarancia tekintetében 2017.09.29-től a KELER KSZF levonást (haircut-ot) alkalmaz**, míg az EUR-ban megképzett biztosítékok esetében a jelenlegi levonás (haircut) megszűnik 2017.10.02-től.

További változás, hogy a jelenleg HUF-ban megképzett **CEEGEX Kollektív Garancia Alap (CGKA) hozzájárulást EUR-ban kell teljesíteni**. A CGKA havonkénti esedékes újraszámítása 2017.10.02-án záráskor fog először EUR-ban megtörténni, melynek teljesítési határideje **legkésőbb 2017.10.04-e 8:15 óra**. Az átállás során az EUR-ban történő teljesítést követően, a KELER KSZF haladéktalanul intézkedik a HUF-ban teljesített garancia alap hozzájárulás visszarendezéséről.

Tisztelettel:
KELER KSZF Zrt.