

A KELER Csoport gázpiaci elszámolási szolgáltatása

Matuszka Kristóf – KELER Zrt. üzletfejlesztési osztályvezető

**2010. április 21., Budapest
NFKP Konferencia
Hilton Budapest WestEnd**



Az előadás tartalma

- Gázpiaci elszámolási modell
- Elszámolási szolgáltatás
- Felkészülési lépések



A KELER Csoport szerepvállalása

1. NFKP-n végrehajtott ügyletek klíringje, elszámolása
2. Gáznapi egyensúlytalanságok klíringje, elszámolása

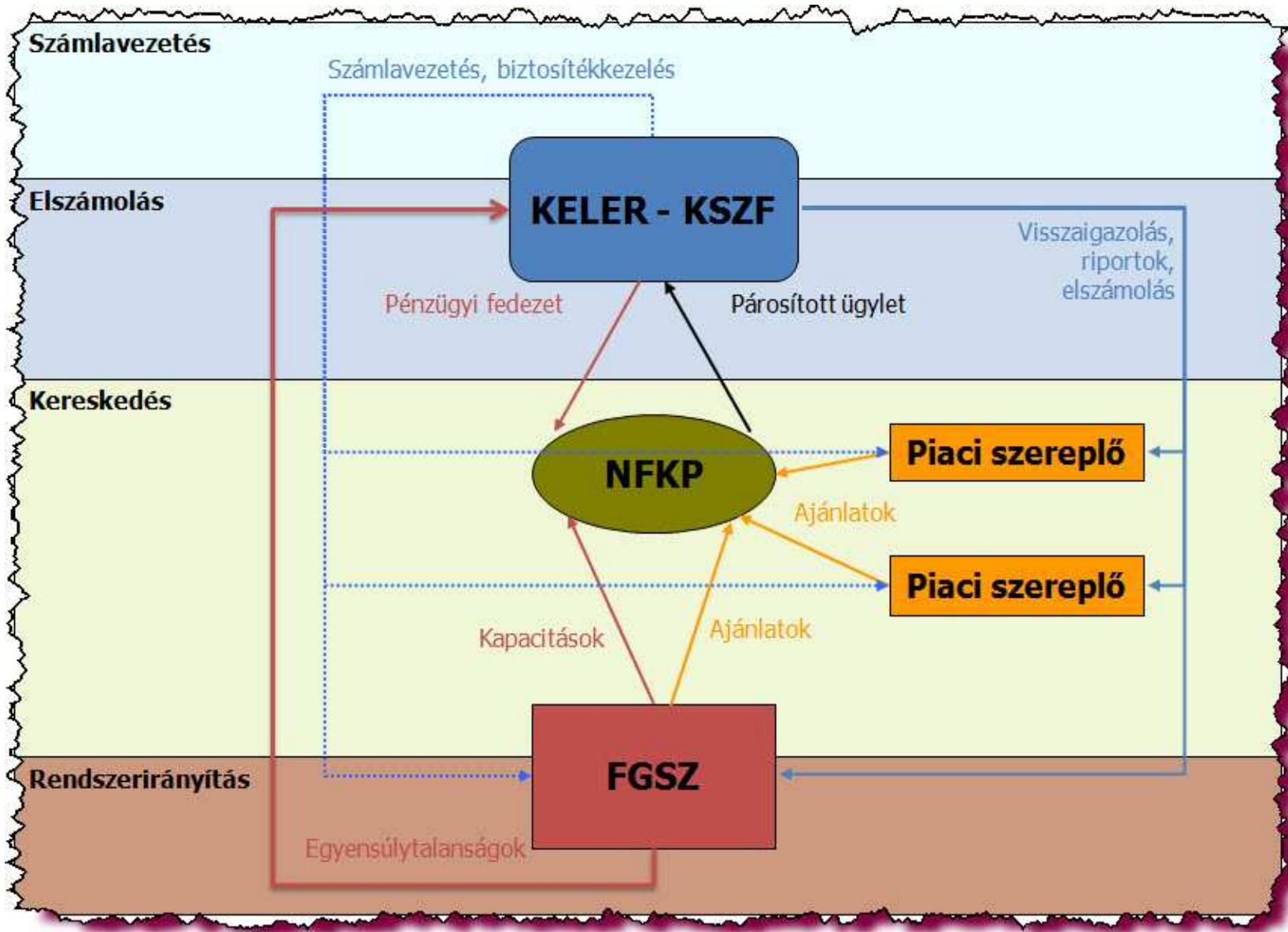
Ennek keretében:

- Pozícióvezetés
- Garanciavállalás
- Biztosíték számítás
- Pénzügyi teljesítés, nemteljesítés kezelés

Kapcsolódó „általános” banki szolgáltatások:

- Pénz- és értékpapírszámla-vezetés
- Biztosíték eszközök nyilvántartása és -kezelése





- Gázpiaci elszámolási modell
- **Elszámolási szolgáltatás**
- Felkészülési lépések

- *Előfeltételek*
- *Elszámolási folyamat*
- *Nemteljesítés kezelés*
- *Díjak*



Szerződéskötések, klíringtagság

FGSZ

- KFSZRI, stb.

KELER

- Szolgáltatási szerződés (gázpiaci pozícióvezetés és elszámolás, illetve pénzforgalmi számla és értékpapírszámla megnyitása)
- KID (KELER Interface Device = „internet banking”) használati szerződés

KELER KSZF

- Klíringtagsági szerződés (gázpiaci klíringtagság, központi szerződő fél garanciavállalása)
- Saját tőke követelmény a „KELER-minimum”: 10 MFt



Elektronikus banki szolgáltatások

Céljuk:

- Pénzügyi elszámolás háttérének biztosítása (átutalás, inkasszó)
- Biztosítékok / fedezetek megteremtése (zárolás)

NFKP tagok számára elérhető szolgáltatások:

- Forintszámla vezetés
- Devizaszámla vezetés
- Értékpapír számlavezetés
- Biztosíték / fedezet információk



KID - KELER Interface Device

GAZ3434 FGSZ Földgázszállító Zrt | KID v5.02-91 | (C) Cardinal Kft, 1996-2009

 Forintelszámolás (PVR)

 Értékpapír elsz. (EÉR)

 Bruttó-DVP elsz. (OTC)

 Ép. kölcsönzés

 Derivatív elsz. (DER)

KELER Zrt. BUDAPEST

KID

 Cross Border

 Deviza elsz. (DNR)

 Társasági esem.

 Információ

 Technikai adatok

 Kollaterál

 Spot kereskedés



Biztosítékok rendszere

Célja:

- Piac és az elszámolás biztonságának szavatolása (garanciavállalás)

Biztosíték követelmény (igény)

Biztosíték eszköz (fedezet)

biztosíték elem	típusa	célja	számítási mód	újrászámítás gyakorisága	elfogadott biztosíték eszköz	újraértékelés gyakorisága
Alapszintű pénzügyi fedezet (APÜF)	egyéni	piacra lépés feltétele	10 MFt	na.	HUF, bankgarancia	na.
Forgalmi biztosíték (FBIZ)	egyéni	nyitva szállítás kockázatának kezelése, kockázat arányosan	az aktuális gázhónapot megelőző 12 gázhónap forgalmának 10%-a, min.10 MFt	havonta	HUF, deviza, bankgarancia, értékpapírok	naponta (szükség esetén napon belül)
Kiegészítő pénzügyi fedezet (KPÜF)	egyéni	eseti szankcionálás	fix összeg, vagy FBIZ %-ában kifejezett összeg, max. FBIZ 500%-a	naponta	HUF, deviza, bankgarancia, értékpapírok	naponta (szükség esetén napon belül)
Gázpiaci kollektív garanciaalap (GKGA)	kollektív	rendszerkockázatok kezelése, azonnali felhasználhatóság	az aktuális gázhónapot megelőző 3 gázhónap átlagos FBIZ 30%-a, min. 5 MFt és max. 250 MFt	havonta	HUF	na.

Induláskori értékek: historikus egyensúlytalansági adatok alapján



Pénzügyi limitek

Céljuk:

- pénzügyi „kapacitás korlát”
- piac védelme

Limit

Szankció

limit típusa	célja	mit limitál	mértéke / számtási mód	ellenőrzés gyakorisága	átlépés szankciója
gázpiaci pozíciós limit (limitfedezettség)	pénzügyi "kapacitás korlát"	bevihető vételi ajánlat értéke	egyéni célú biztosíték eszköz \pm ügyletek pénzügyileg nem rendezett eredménye	folyamatosan (FGSZ)	KPÜF kivetés, klíringjog felfüggesztése
gázpiaci pénzügyi pozíciós limit	piac védelme	egyéni biztosíték eszközzel nem fedezett pénzügyi kötelezettség	mindekori GKGA 25%-a	naponta	KPÜF kivetés, klíringtagsági szerződés felmondása



- Gázpiaci elszámolási modell
- Elszámolás lépéseinek bemutatása
- Következő lépések

- *Előfeltételek*
- *Elszámolási folyamat*
- *Nemteljesítés kezelés*
- *Díjak*



Ügyletek kezelése I.

- **NFKP kereskedés / egyensúlyozás:** gáznapon
- **Klíring / elszámolás:** banki napokon, fizetési rendszerek nyitva tartásakor

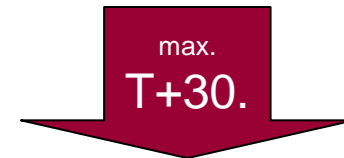
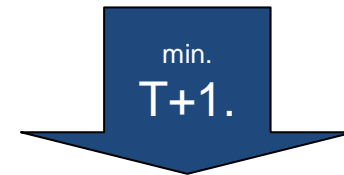
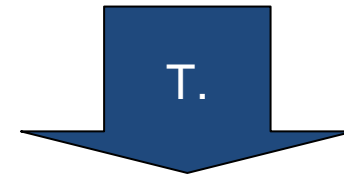
Kereskedést követő (post-trade) folyamatok:

- Napi klíring: gáznapot követő banki munkanapon, az előző gáznapra
- Havi elszámolás: minden hó első banki munkanapján, az előző gázhónapra
- Havi korrekciós elszámolás: minden hó 15-dikét követő első banki munkanapján, az előző gázhónapra



Ügyletek kezelése II.

- Gáznapi NFKP kereskedés (MGP, HEG, KAP)
- Előfeltétel: biztosíték képzés, ajánlatbevételnél pénzügyi limit ellenőrzés
- Gáznapi egyensúlytalansági pozíciók (MGPEGY)
- Napi klíring
- Havi elszámolás, biztosíték igény újraszámítás, havi számlázás
- Havi elszámolás pénzügyi rendezése
- Havi korrekciós elszámolás, korrekciós számlázás
- Havi korrekció pénzügyi rendezése



Napi klíring

Gáznapi klíring feltétele:

- Gáznapra vonatkozó NFKP ügylet adatok megérkeztek FGSZ-től
- Egyensúlytalansági pozíciók és elszámolóár megérkeztek FGSZ-től

Gáznapi klíring tartalma:

- Gáznapi NFKP ügyletek feldolgozása
- KELER KSZF által speciális egyensúlytalansági ügyletek létrehozása
- Gáznapi pénzügyi követelések, kötelezettségek számítása
- Gázhónapra kumulált követelések, kötelezettségek számítása
- Limitfedezettség kalkuláció

Napi elszámolási riport minden partner számára:

- Gáznapi ügyletek visszaigazolása, pozíciók, pénzügyi információk
- PDF formátum, NFKP-n érhető el, a klíring napján 14:00 órát követően



Havi elszámolás és számlázás

Havi elszámolás feltétele:

- Elérkezik a következő gázhónap első banki munkanapja

Havi elszámolás tartalma:

- Partnerenkénti pénzügyi pozíciók meghatározása az előző gázhónap összes gáznapijének adatai alapján
- Pénzügyi tranzakciók előkészítése értéknaposan (terhelések, jóváírások)
- Kimenő számlák nyomtatása, kiküldése
- Bejövő számlák érkeztetése (partner megbízása alapján KELER állítja ki – pl. FGSZ)
- Később: pénzügyi tranzakciók végrehajtása a számlavezető rendszerben

Havi elszámolási riport:

- Pozíciók, pénzügyi információk
- PDF formátum, NFKP-n érhető el, a havi elszámolás napján 14:00 órát követően



Havi korrigált elszámolás és számlázás

Havi korrigált elszámolás feltétele:

- Elérkezik a következő gázhónap 15-dikét követő első banki napja
- Korrekciós egyensúlytalansági adatok megérkeznek FGSZ-től

Havi korrigált elszámolás tartalma:

- Eredeti és korrekciós értékek eltérése alapján korrigált egyensúlytalansági ügyletek képzése
- Korrekciós pénzügyi tranzakciók előkészítése (terhelések, jóváírások)
- Engedmény-felár „korrekció”
- Kimenő helyesbítő számlák nyomtatása, kiküldése
- Helyesbítő bejövő számlák érkeztetése (partner megbízása alapján KELER állítja ki – pl. FGSZ)
- Később: pénzügyi tranzakciók végrehajtása a számlavezető rendszerben

Korrigált elszámolási riport:

- pozíciók, engedmény-felár, pénzügyi információk
- PDF formátum, NFKP-n érhető el, az elszámolási napon 14:00 óra után



- Gázpiaci elszámolási modell
- Elszámolás lépéseinek bemutatása
- Következő lépések

- *Előfeltételek*
- *Elszámolási folyamat*
- *Nemteljesítés kezelés*
- *Díjak*



Alkalmazható KELER KSZF szankciók

Céljuk:

- Klíringtagsági követelmények / feltételek megszegése esetén, a megnövekedett kockázatok kezelése

KELER KSZF által alkalmazható szankciók:

- Kiegészítő pénzügyi fedezet (KPÜF) kivetése
- Helyszíni vizsgálat vagy MEH vizsgálat kezdeményezése
- Klíringjog felfüggesztése
- Klíringtagsági szerződés felmondása



Klíringjog felfüggesztése

Következményei:

- KELER KSZF csak pénzügyi pozíciót javító ügyleteket fogad be (eladás)
- Napi egyensúlytalanságok befogadását nem érinti

Főbb esetei:

- MEH/FGSZ oldali felfüggesztés
- Klíringtagság feltételét képező szerződés megszűnése
- Biztosíték fedezetlenség
- Pénzügyi teljesítés elmulasztása (pénzügyi fedezetlenség havi / korrekciós elszámoláskor, díjfizetéskor)



Kényszerintézkedések

Céljuk:

- Pénzügyi teljesítés biztosítása minden körülmények között

Intézkedések havi elszámolás pénzügyi nemteljesítése esetén:

- Klíringtagi egyéni biztosíték eszközök elvonása / kényszerértékesítése
- Klíringtag szabad rendeltetésű saját eszközeinek elvonása
- GKGA klíringtagi saját hozzájárulás felhasználása
- Teljes GKGA felhasználása
- KELER KSZF saját eszközeinek felhasználása
- KELER készfizető kezességének igénybe vétele



- Gázpiaci elszámolási modell
- Elszámolás lépéseinek bemutatása
- Következő lépések

- *Előfeltételek*
- *Elszámolási folyamat*
- *Nemteljesítés kezelés*
- *Díjak*



Szolgáltatási díjak

Gázpiaci elszámolási díjak:

- Egyszeri belépési díj: 1 MFt / belépéskor
- Havi számlázási díj: 200 eFt / hó
- Klíringdíj: 0,0027 Ft / MJ

Egyéb felszámított díjak (minden KELER partner számára egységesen):

- Számlavezetési díjak (pénzforgalmi, deviza, értékpapír): 10 eFt / hó, értékpapír letétkezelési, és tranzakciós díjtételek, asap.
- KID csatlakozási díj: 250 eFt, felhasználói díj: 15 eFt/hó
- Settlement díj: 600 Ft / tranzakció
- Nemteljesítési alapdíj: 300 eFt / alkalom (GKGA-t illeti), késedelmi díj: 100 eFt / alkalom



- Gázpiaci elszámolási modell
- Elszámolási szolgáltatás
- Felkészülési lépések



Ügyfelek felkészítése / felkészülése

2010. április 21. – FGSZ-KELER konferencia

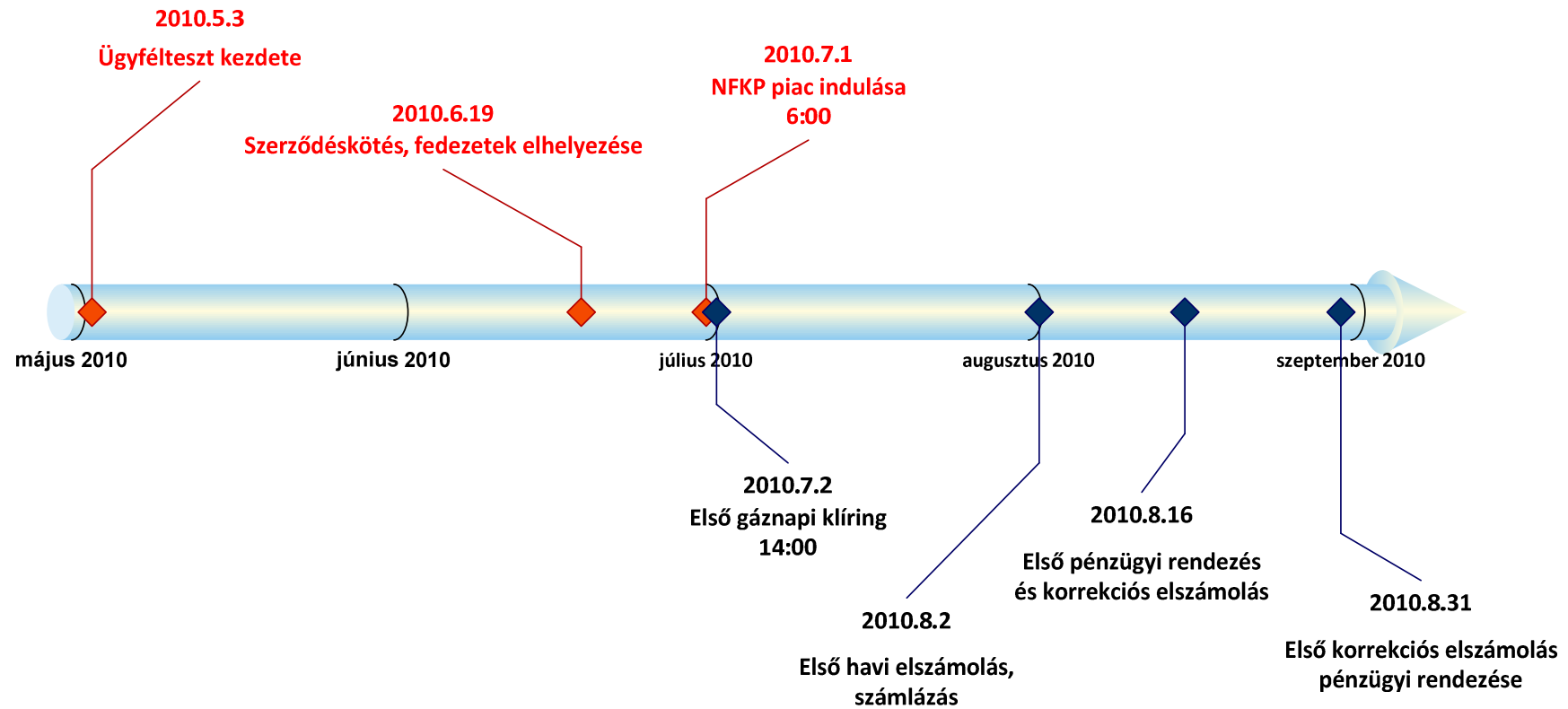
2010. április 26. – KELER tájékoztató WS (Carat Hotel, Budapest)

2010. április 27-től – FGSZ WS-ok, oktatások
– KELER telepítések-oktatások

- Ügyfélteszt / próbaüzem (kereskedés-elszámolás és "bankolás")
- Szerződéskötések (FGSZ, KELER, KELER KSZF)
- Pénzügyi fedezetek megteremtése a piac indulását megelőzően



Ütemezés



Összefoglalás

- Mai folyamatokat figyelembe vevő, ügyfélbarát elszámolási modell
- Biztonságos, a nemzetközi normáknak megfelelő elszámolás
- Egyszerű implementálhatóság, költséghatékonyság
- Nagy hangsúly az ügyfelek felkészítésén



Köszönöm a figyelmet!

matuszka.kristof@keler.hu

