

KELER KSZF – 13/2020. számú leirat

MTS Piac

Hatálybalépés dátuma: 2020. január 27.

A KELER KSF Zrt. Általános Üzletszabályzata alapján 2020. január 27-ei hatállyal az MTS piac garanciarendszerét az alábbiak szerint határozza meg:

Alapbiztosíték beállítási paraméterek

Államkötvények

Az államkötvények esetében az alapbiztosíték nagyságát a névértékhez és a hátralévő futamidőhöz mérten az alábbi táblázat tartalmazza.

Államkötvények hátralévő futamideje	A maximális árváltozáshoz tartozó alapbiztosíték (Ft/db)
< 3 év	Névérték (HUF) X 0,006, minimum 1 Ft/db
3 év <> 5 év	Névérték (HUF) X 0,012, minimum 1 Ft/db
> 5 év	Névérték (HUF) X 0,035, minimum 1 Ft/db

Diszkontkincstárjegyek

A diszkontkincstárjegyek esetében az alapbiztosíték nagyságát a névértékhez mérten az alábbi táblázat tartalmazza.

A diszkontkincstárjegyek maximális árváltozáshoz tartozó alapbiztosíték (Ft/db)
Névérték (HUF) X 0,001, minimum 1 Ft/db

Diákhitel központ kötvények

A diákhitel kötvények esetében az alapbiztosíték nagyságát a névértékhez mérten az alábbi táblázat tartalmazza.

Diákhitel kötvények névértékének devizaneme	A maximális árváltozáshoz tartozó alapbiztosíték (Ft/db)
HUF	Névérték (HUF) X 0,02, minimum 1 Ft/db

Vállalati kötvények

A vállalati kötvények esetében az alapbiztosíték nagyságát a névértékhez mérten az alábbi táblázat tartalmazza.

Vállalati kötvények névértékének devizaneme	A maximális árváltozáshoz tartozó alapbiztosíték (Ft/db)
HUF	Névérték (HUF) X 0,02, minimum 1 Ft/db
EUR	Névérték (EUR) X 6,5, minimum 1 Ft/db

Egyéb megjegyzések:

- A margin számításnál a SD-1 napon lévő pozíciók nem kerülnek figyelembe vételre.
- Az árkülönbözet meghatározásánál a különböző elszámolási napok között 100%-os spread kerül alkalmazásra azonos termékek esetében.
- Az árkülönbözet meghatározásánál a különböző termékek között 0%-os spread kerül alkalmazásra.

Budapest, 2020. január 23.

KELER KSZF Zrt.