

KELER KSZF – 37/2021. számú leirat

MTS Piac

Hatálybalépés dátuma: 2021. április 28.

A KELER KSZF Zrt. Általános Üzletszabályzata alapján 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) * 0,0112, minimum 1 Ft/db
3 év < 5 év	Névérték (HUF) * 0,0188, minimum 1 Ft/db
> 5 év	Névérték (HUF) * 0,0591, 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) * 0,0038, 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) * 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) * 0,0187, minimum 1 Ft/db
EUR	Névérték (EUR) * 6,97, minimum 1 Ft/db
USD	Névérték (USD) * 5,90, minimum 1 Ft/db

A fent megnevezett termékek alapbiztosítéka 25 %-os prociklikussági puffert tartalmaz.

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, 2021. április 26.

KELER KSZF Zrt.