

KELER KSZF - 139/2021. számú leirat
MTS Piac

Hatálybalépés dátuma: 2021. december 22.

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) * 0,0140, minimum 1 Ft/db
3-5 év	Névérték (HUF) * 0,0190, minimum 1 Ft/db
5-10 év	Névérték (HUF) * 0,0324, minimum 1 Ft/db
10-15 év	Névérték (HUF) * 0,0419, minimum 1 Ft/db
15 év <	Névérték (HUF) * 0,0437, 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) * 0,0100, 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) * 0,0180, minimum 1 Ft/db
EUR	Névérték (EUR) * 6,80, minimum 1 Ft/db
USD	Névérték (USD) * 5,90, minimum 1 Ft/db

A fent megnevezett termékek alapbiztosítéka 25 %-os prociklikussági puffert tartalmaz. Kivétel: HUF vállalati kötvények esetében 23 %-os, USD vállalati kötvények esetében 22 %-os prociklikussági puffer került alkalmazásra.

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. december 20.

KELER KSZF Zrt.