

KELER KSZF – 119/2022. számú leirat

MTS Piac

Hatálybalépés dátuma: 2022. július 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) X 0,0168, minimum 1 Ft/db
3-5 év	Névérték (HUF) X 0,0240, minimum 1 Ft/db
5-10 év	Névérték (HUF) X 0,0400, minimum 1 Ft/db
10-15 év	Névérték (HUF) X 0,0480, minimum 1 Ft/db
15 év <	Névérték (HUF) X 0,0500, 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 0,0150, 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 0,0264, minimum 1 Ft/db
EUR	Névérték (EUR) X 11,15, minimum 1 Ft/db
USD	Névérték (USD) X 11,24, minimum 1 Ft/db

A fent megnevezett termékek alapbiztosítéka 25%-os prociklikussági puffert tartalmaz, kivéve:

- *Államkötvény < 3 év: 1%*
- *Államkötvény 3-5 év: 2%*
- *Államkötvény 5-10 év: 18%*
- *Vállalati HUF: 2%*
- *Vállalati EUR: 5%*
- *Vállalati USD: 6%*

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, 2022. július 20.

KELER KSZF Zrt.