

9-07 KELER KSZF leirat

MTS Piac

Hatálybalépés dátuma: 2022. október 19.

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 0,0187, minimum 1 Ft/db
3-5 év	Névérték (HUF) X 0,0283, minimum 1 Ft/db
5-10 év	Névérték (HUF) X 0,0428, 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 0,0312, minimum 1 Ft/db
EUR	Névérték (EUR) X 13,4, minimum 1 Ft/db
USD	Névérték (USD) X 13,86, minimum 1 Ft/db

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

- *DKJ: 8%*
- *Államkötvény < 3 év: 1%*
- *Államkötvény 3-5 év: 5%*
- *Államkötvény 5-10 év: 20%*
- *Vállalati HUF: 5%*
- *Vállalati EUR: 2%*
- *Vállalati USD: 1%*

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. október 15.

KELER KSZF Zrt.