

KELER KSZF-33-2014. számú leirat

Pénzügyi ügyletkör

Hatályos: 2014. szeptember 30.

A KELER KSZF Zrt. Általános Üzletszabályzata alapján **2014. szeptember 30-i hatállyal** a BÉT Pénzügyi ügyletkör garanciarendszerét az alábbiak szerint határozza meg:

Alapbiztosíték beállítási paraméterek

Termék név	Határidős termék	Egyhetes termék	Opció termék	Lejárat(ok)	Árváltozás tartomány (+/-)		A maximális Árváltozáshoz tartozó alapbiztosíték a határidős termékek esetében	Lejáratok közötti spread mértéke	Lejáratok közötti spread paraméterek
3 BUBOR	X			minden lejáratban	0,68	%	17 000	40%	20 400
1 BUBOR	X			minden lejáratban	0,68	%	5 700	40%	6 840
6 BUBOR	X			minden lejáratban	0,68	%	34 000	40%	40 800
CAD/HUF	X			minden lejáratban	10	Ft	10 000	70%	6 000
CHF/HUF	X	X	X	minden lejáratban	10	Ft	10 000	70%	6 000
CZK/HUF	X			minden lejáratban	0,5	Ft	50 000	70%	30 000
EUR/HUF	X	X	X	minden lejáratban	12	Ft	12 000	70%	7 200
GBP/HUF	X	X		minden lejáratban	15	Ft	15 000	70%	9 000
JPY/HUF	X		X	minden lejáratban	12	Ft	12 000	70%	7 200
NOK/HUF	X			minden lejáratban	1,7	Ft	17 000	70%	10 200
PLN/HUF	X			minden lejáratban	3	Ft	30 000	70%	18 000
TRY/HUF	X	X	X	minden lejáratban	6	Ft	6 000	70%	3 600
USD/HUF	X	X	X	minden lejáratban	11	Ft	11 000	70%	6 600
AUD/USD	X	X	X	minden lejáratban	0,035	USD	7 700	50%	7 700
AUD/JPY	X	X		minden lejáratban	4,1	JPY	10 250	50%	10 250
AUD/CAD	X	X		minden lejáratban	0,035	CAD	7 700	50%	7 700
AUD/CHF	X	X		minden lejáratban	0,035	CHF	8 400	50%	8 400
CAD/CHF	X	X		minden lejáratban	0,04	CHF	9 600	50%	9 600
CAD/JPY	X		X	minden lejáratban	4,1	JPY	10 250	50%	10 250
CHF/JPY	X			minden lejáratban	5,2	JPY	13 000	50%	13 000
CHF/PLN	X	X		minden lejáratban	0,2	PLN	14 000	50%	14 000
EUR/AUD	X	X		minden lejáratban	0,045	AUD	10 350	50%	10 350
EUR/CAD	X	X		minden lejáratban	0,045	CAD	9 900	50%	9 900
EUR/CHF	X	X	X	minden lejáratban	0,044	CHF	10 560	70%	6 336
EUR/RSD	X			minden lejáratban	3,5	RSD	10 500	20%	16 800
EUR/CZK	X		X	minden lejáratban	0,9	CZK	9 900	50%	9 900
EUR/GBP	X	X		minden lejáratban	0,023	GBP	7 820	50%	7 820
EUR/HRK	X			minden lejáratban	0,28	HRK	11 200	0%	22 400
EUR/JPY	X	X	X	minden lejáratban	5,8	JPY	14 500	70%	8 700
EUR/NOK	X			minden lejáratban	0,25	NOK	8 750	50%	8 750
EUR/PLN	X	X	X	minden lejáratban	0,14	PLN	9 800	50%	9 800
EUR/RON	X		X	minden lejáratban	0,14	RON	9 100	20%	14 560

Termék név	Határidős termék	Egyhetes termék	Opciós termék	Lejárat(ok)	Árváltozás tartomány (+/-)	Alapbiztosíték a határidős	Lejáratok közötti spread mértéke	Lejáratok közötti spread paraméterek
EUR/RUB	X			minden lejáratban	1,8 RUB	12 600	50%	12 600
EUR/SEK	X			minden lejáratban	0,35 SEK	10 500	50%	10 500
EUR/TRY	X	X	X	minden lejáratban	0,1 TRY	12 000	70%	7 200
EUR/USD	X	X	X	minden lejáratban	0,038 USD	8 360	70%	5 016
GBP/AUD	X	X		minden lejáratban	0,06 AUD	13 800	50%	13 800
GBP/CAD	X	X		minden lejáratban	0,05 CAD	11 000	50%	11 000
GBP/CHF	X	X	X	minden lejáratban	0,055 CHF	13 200	50%	13 200
GBP/JPY	X	X	X	minden lejáratban	7 JPY	17 500	50%	17 500
GBP/PLN	X	X		minden lejáratban	0,2 PLN	14 000	50%	14 000
GBP/SEK	X			minden lejáratban	0,32 SEK	9 600	50%	9 600
GBP/TRY	X	X		minden lejáratban	0,13 TRY	15 600	50%	15 600
GBP/USD	X	X	X	minden lejáratban	0,05 USD	11 000	70%	6 600
NZD/JPY	X			minden lejáratban	4 JPY	10 000	50%	10 000
USD/BRL	X			minden lejáratban	0,1 BRL	13 000	50%	13 000
USD/CAD	X	X	X	minden lejáratban	0,03 CAD	6 600	50%	6 600
USD/CHF	X	X	X	minden lejáratban	0,035 CHF	8 400	50%	8 400
USD/CZK	X			minden lejáratban	0,75 CZK	8 250	50%	8 250
USD/JPY	X	X	X	minden lejáratban	4,1 JPY	10 250	70%	6 150
USD/MXN	X			minden lejáratban	0,6 MXN	9 000	50%	9 000
USD/NOK	X			minden lejáratban	0,19 NOK	6 650	50%	6 650
USD/PLN	X	X		minden lejáratban	0,13 PLN	9 100	50%	9 100
USD/RUB	X			minden lejáratban	1,3 RUB	9 100	50%	9 100
USD/SEK	X			minden lejáratban	0,2 SEK	6 000	50%	6 000
USD/TRY	X	X	X	minden lejáratban	0,08 TRY	9 600	50%	9 600
USD/UAH	X			minden lejáratban	1 UAH	25 000	0%	50 000

Megjegyzés:

Kiírt opció után számított minimum fedezet minden opciós termék esetében 10%-a az alapbiztosítéknak.

Volatilitás változás tartomány minden opciós termék esetében (+/-) 4%.

Biztosíték számítás metódusa: **nettó elv**

Lejáratok közötti spread biztosíték

A lejáratok közötti spread kedvezmények EUR/HUF, USD/HUF, CHF/HUF, GBP/HUF, JPY/HUF, CZK/HUF, PLN/HUF, TRY/HUF, CAD/HUF, NOK/HUF, EUR/JPY, USD/JPY, EUR/USD, EUR/CHF, EUR/TRY, GBP/USD termékeknél 70%, a kamat és keresztkontraktusok esetében 0%-50%.

Szállítási (delivery) hónap kiegészítő biztosíték: **Nincs!**

Termékek közötti spread kedvezmény:

Sorszám	Spreadet alkotó termékek	Arány	A kedvezmény mértéke %
1	EUR/HUF és USD/HUF	3:4	60 %
2	EUR/HUF és CHF/HUF	4:5	60 %

Budapest, 2014. szeptember 25.

KELER KSZF Zrt.