

KELER KSZF-02-2015. számú leirat

Pénzügyi ügyletkör

Hatályos: 2015. január 27.

A KELER KSZF Zrt. Általános Üzletszabályzata alapján 2015. január 27-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	7	Ft	7 000	80%	2 800
CHF/HUF	X	X	X	minden lejáratban	10	Ft	10 000	70%	6 000
CZK/HUF	X			minden lejáratban	0,4	Ft	40 000	70%	24 000
EUR/HUF	X	X	X	minden lejáratban	10	Ft	10 000	70%	6 000
GBP/HUF	X	X		minden lejáratban	12	Ft	12 000	80%	4 800
JPY/HUF	X		X	minden lejáratban	8	Ft	8 000	80%	3 200
NOK/HUF	X			minden lejáratban	1,2	Ft	12 000	70%	7 200
PLN/HUF	X			minden lejáratban	2,5	Ft	25 000	70%	15 000
TRY/HUF	X	X	X	minden lejáratban	5	Ft	5 000	70%	3 000
USD/HUF	X	X	X	minden lejáratban	9,5	Ft	9 500	80%	3 800
AUD/USD	X	X	X	minden lejáratban	0,027	USD	7 290	60%	5 832
AUD/JPY	X	X		minden lejáratban	3,6	JPY	8 280	60%	6 624
AUD/CAD	X	X		minden lejáratban	0,035	CAD	7 875	60%	6 300
AUD/CHF	X	X		minden lejáratban	0,03	CHF	9 300	60%	7 440
CAD/CHF	X	X		minden lejáratban	0,03	CHF	9 300	60%	7 440
CAD/JPY	X		X	minden lejáratban	3,6	JPY	8 280	60%	6 624
CHF/JPY	X			minden lejáratban	4,3	JPY	9 890	60%	7 912
CHF/PLN	X	X		minden lejáratban	0,13	PLN	9 750	60%	7 800
EUR/AUD	X	X		minden lejáratban	0,045	AUD	10 125	60%	8 100
EUR/CAD	X	X		minden lejáratban	0,045	CAD	10 125	60%	8 100
EUR/CHF	X	X	X	minden lejáratban	0,044	CHF	13 640	70%	8 184
EUR/RSD	X			minden lejáratban	4	RSD	10 400	0%	20 800
EUR/CZK	X		X	minden lejáratban	0,9	CZK	9 900	60%	7 920
EUR/GBP	X	X		minden lejáratban	0,023	GBP	9 200	60%	7 360
EUR/HRK	X			minden lejáratban	0,28	HRK	11 480	0%	22 960
EUR/JPY	X	X	X	minden lejáratban	5,2	JPY	11 960	80%	4 784
EUR/NOK	X			minden lejáratban	0,25	NOK	9 250	60%	7 400
EUR/PLN	X	X	X	minden lejáratban	0,14	PLN	10 500	50%	10 500
EUR/RON	X		X	minden lejáratban	0,14	RON	9 800	20%	15 680

Termék név	Határidős termék	Egyhetes termék	Opációs termék	Lejárat(ok)	Árváltozás tartomány (+/-)		tartozó alapbiztosíték a határidős	Lejáratok közötti spread mértéke	Lejáratok közötti spread paraméterek
EUR/RUB	X			minden lejáratban	5	RUB	25 000	50%	25 000
EUR/SEK	X			minden lejáratban	0,35	SEK	11 900	60%	9 520
EUR/TRY	X	X	X	minden lejáratban	0,1	TRY	12 000	70%	7 200
EUR/USD	X	X	X	minden lejáratban	0,03	USD	8 100	80%	3 240
GBP/AUD	X	X		minden lejáratban	0,06	AUD	13 500	60%	10 800
GBP/CAD	X	X		minden lejáratban	0,05	CAD	11 250	60%	9 000
GBP/CHF	X	X	X	minden lejáratban	0,055	CHF	17 050	60%	13 640
GBP/JPY	X	X	X	minden lejáratban	6,5	JPY	14 950	60%	11 960
GBP/PLN	X	X		minden lejáratban	0,2	PLN	15 000	60%	12 000
GBP/SEK	X			minden lejáratban	0,38	SEK	12 920	60%	10 336
GBP/TRY	X	X		minden lejáratban	0,13	TRY	15 600	60%	12 480
GBP/USD	X	X	X	minden lejáratban	0,05	USD	13 500	80%	5 400
NZD/JPY	X			minden lejáratban	3,5	JPY	8 050	60%	6 440
USD/BRL	X			minden lejáratban	0,1	BRL	10 000	50%	10 000
USD/CAD	X	X	X	minden lejáratban	0,03	CAD	6 750	60%	5 400
USD/CHF	X	X	X	minden lejáratban	0,035	CHF	10 850	60%	8 680
USD/CZK	X			minden lejáratban	0,75	CZK	8 250	60%	6 600
USD/JPY	X	X	X	minden lejáratban	4,1	JPY	9 430	80%	3 772
USD/MXN	X			minden lejáratban	0,55	MXN	9 900	60%	7 920
USD/NOK	X			minden lejáratban	0,25	NOK	9 250	60%	7 400
USD/PLN	X	X		minden lejáratban	0,13	PLN	9 750	60%	7 800
USD/RUB	X			minden lejáratban	4	RUB	20 000	50%	20 000
USD/SEK	X			minden lejáratban	0,3	SEK	10 200	60%	8 160
USD/TRY	X	X	X	minden lejáratban	0,08	TRY	9 600	60%	7 680
USD/UAH	X			minden lejáratban	1	UAH	18 000	0%	36 000

Megjegyzés:

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

Volatilitás változás tartomány minden opációs termék esetében (+/-) 10%.

Biztosíték számítás módszere: **nettó elv**

Lejáratok közötti spread biztosíték

A lejáratok közötti spread kedvezmények BUBOR termékeknél 40%; EUR/RSD, EUR/HRK és USD/UAH termékeknél 0%; EUR/RON terméknél 20%; CHF/HUF, CZK/HUF, EUR/HUF, NOK/HUF, PLN/HUF, TRY/HUF, EUR/CHF és EUR/TRY esetében 70%; CAD/HUF, GBP/HUF, JPY/HUF, USD/HUF, EUR/JPY, EUR/USD, GBP/USD és USD/JPY esetében 80%; minden más esetben 60%.

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, 2015. január 21.

KELER KSZF Zrt.