

KELER KSZF-25-2015. számú leirat

Pénzügyi ügyletkör

Hatályos: 2015. június 18.

A KELER KSZF Zrt. Általános Üzletszabályzata alapján **2015. június 18-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	0%	34 000
1 BUBOR	X			minden lejáratban	0,68	%	5 700	0%	11 400
6 BUBOR	X			minden lejáratban	0,68	%	34 000	0%	68 000
CAD/HUF	X			minden lejáratban	7	Ft	7 000	80%	2 800
CHF/HUF	X	X	X	minden lejáratban	12,5	Ft	12 500	70%	7 500
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	7 560	70%	4 536
AUD/JPY	X	X		minden lejáratban	3,6	JPY	8 280	70%	4 968
AUD/CAD	X	X		minden lejáratban	0,035	CAD	8 050	70%	4 830
AUD/CHF	X	X		minden lejáratban	0,035	CHF	10 500	70%	6 300
CAD/CHF	X	X		minden lejáratban	0,035	CHF	10 500	70%	6 300
CAD/JPY	X		X	minden lejáratban	3,6	JPY	8 280	70%	4 968
CHF/JPY	X			minden lejáratban	4,8	JPY	11 040	70%	6 624
CHF/PLN	X	X		minden lejáratban	0,16	PLN	12 160	60%	9 728
EUR/AUD	X	X		minden lejáratban	0,045	AUD	9 900	70%	5 940
EUR/CAD	X	X		minden lejáratban	0,045	CAD	10 350	70%	6 210
EUR/CHF	X	X	X	minden lejáratban	0,05	CHF	15 000	70%	9 000
EUR/RSD	X			minden lejáratban	4	RSD	10 400	0%	20 800
EUR/CZK	X		X	minden lejáratban	0,9	CZK	10 800	70%	6 480
EUR/GBP	X	X		minden lejáratban	0,023	GBP	9 890	70%	5 934
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	70%	5 550
EUR/PLN	X	X	X	minden lejáratban	0,14	PLN	10 640	50%	10 640
EUR/RON	X		X	minden lejáratban	0,14	RON	9 800	0%	19 600

Termék név	Határidős termék	Egyhetes termék	Opációs termék	Lejárat(ok)	Árváltozás tartomány (+/-)		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	70%	7 140
EUR/TRY	X	X	X	minden lejáratban	0,1	TRY	10 500	50%	10 500
EUR/USD	X	X	X	minden lejáratban	0,03	USD	8 400	80%	3 360
GBP/AUD	X	X		minden lejáratban	0,06	AUD	13 200	70%	7 920
GBP/CAD	X	X		minden lejáratban	0,05	CAD	11 500	70%	6 900
GBP/CHF	X	X	X	minden lejáratban	0,07	CHF	21 000	70%	12 600
GBP/JPY	X	X	X	minden lejáratban	6,5	JPY	14 950	70%	8 970
GBP/PLN	X	X		minden lejáratban	0,2	PLN	15 200	70%	9 120
GBP/SEK	X			minden lejáratban	0,4	SEK	13 600	70%	8 160
GBP/TRY	X	X		minden lejáratban	0,13	TRY	13 650	60%	10 920
GBP/USD	X	X	X	minden lejáratban	0,05	USD	14 000	80%	5 600
NZD/JPY	X			minden lejáratban	3,5	JPY	8 050	70%	4 830
USD/BRL	X			minden lejáratban	0,1	BRL	10 000	0%	20 000
USD/CAD	X	X	X	minden lejáratban	0,035	CAD	8 050	70%	4 830
USD/CHF	X	X	X	minden lejáratban	0,04	CHF	12 000	70%	7 200
USD/CZK	X			minden lejáratban	0,75	CZK	9 000	70%	5 400
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	70%	5 940
USD/NOK	X			minden lejáratban	0,25	NOK	9 250	70%	5 550
USD/PLN	X	X		minden lejáratban	0,13	PLN	9 880	70%	5 928
USD/RUB	X			minden lejáratban	4	RUB	20 000	50%	20 000
USD/SEK	X			minden lejáratban	0,3	SEK	10 200	70%	6 120
USD/TRY	X	X	X	minden lejáratban	0,09	TRY	9 450	60%	7 560
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, EUR/RSD, EUR/RON, EUR/HRK USD/BRL és USD/UAH termékeknél 0%; CAD/HUF, GBP/HUF, JPY/HUF, USD/HUF, EUR/JPY, EUR/USD, GBP/USD és USD/JPY esetében 80%; EUR/TRY, EUR/RUB és USD/RUB esetében 50%; CHF/PLN és USD/TRY esetében 60%; minden más esetben 70%.

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	40 %

Budapest, 2015. június 11.

KELER KSZF Zrt.