

KELER KSZF-35-2015. számú leirat

Pénzügyi ügyletkör

Hatályos: 2015. augusztus 27.

A KELER KSZF Zrt. Általános Üzletszabályzata alapján **2015. augusztus 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	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	14	Ft	14 000	70%	8 400
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	7 695	70%	4 617
AUD/JPY	X	X		minden lejáratban	3,6	JPY	8 280	70%	4 968
AUD/CAD	X	X		minden lejáratban	0,035	CAD	7 700	70%	4 620
AUD/CHF	X	X		minden lejáratban	0,037	CHF	10 915	70%	6 549
CAD/CHF	X	X		minden lejáratban	0,037	CHF	10 915	70%	6 549
CAD/JPY	X		X	minden lejáratban	3,6	JPY	8 280	70%	4 968
CHF/JPY	X			minden lejáratban	5,4	JPY	12 420	70%	7 452
CHF/PLN	X	X		minden lejáratban	0,18	PLN	13 500	60%	10 800
EUR/AUD	X	X		minden lejáratban	0,045	AUD	9 450	70%	5 670
EUR/CAD	X	X		minden lejáratban	0,045	CAD	9 900	70%	5 940
EUR/CHF	X	X	X	minden lejáratban	0,06	CHF	17 700	70%	10 620
EUR/RSD	X			minden lejáratban	4	RSD	12 000	0%	24 000
EUR/CZK	X		X	minden lejáratban	0,9	CZK	10 800	70%	6 480
EUR/GBP	X	X		minden lejáratban	0,023	GBP	10 120	70%	6 072
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	8 750	70%	5 250
EUR/PLN	X	X	X	minden lejáratban	0,14	PLN	10 500	50%	10 500
EUR/RON	X		X	minden lejáratban	0,14	RON	9 940	0%	19 880

Termék név	Határidős termék	Egyhetes termék	Opciós 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	11 550	70%	6 930
EUR/TRY	X	X	X	minden lejáratban	0,1	TRY	10 300	50%	10 300
EUR/USD	X	X	X	minden lejáratban	0,03	USD	8 550	80%	3 420
GBP/AUD	X	X		minden lejáratban	0,06	AUD	12 600	70%	7 560
GBP/CAD	X	X		minden lejáratban	0,05	CAD	11 000	70%	6 600
GBP/CHF	X	X	X	minden lejáratban	0,085	CHF	25 075	70%	15 045
GBP/JPY	X	X	X	minden lejáratban	6,5	JPY	14 950	70%	8 970
GBP/PLN	X	X		minden lejáratban	0,2	PLN	15 000	70%	9 000
GBP/SEK	X			minden lejáratban	0,4	SEK	13 200	70%	7 920
GBP/TRY	X	X		minden lejáratban	0,13	TRY	13 390	60%	10 712
GBP/USD	X	X	X	minden lejáratban	0,05	USD	14 250	80%	5 700
NZD/JPY	X			minden lejáratban	3,5	JPY	8 050	70%	4 830
USD/BRL	X			minden lejáratban	0,1	BRL	8 400	0%	16 800
USD/CAD	X	X	X	minden lejáratban	0,035	CAD	7 700	70%	4 620
USD/CHF	X	X	X	minden lejáratban	0,055	CHF	16 225	70%	9 735
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	8 750	70%	5 250
USD/PLN	X	X		minden lejáratban	0,13	PLN	9 750	70%	5 850
USD/RUB	X			minden lejáratban	4	RUB	20 000	50%	20 000
USD/SEK	X			minden lejáratban	0,3	SEK	9 900	70%	5 940
USD/TRY	X	X	X	minden lejáratban	0,09	TRY	9 270	60%	7 416
USD/UAH	X			minden lejáratban	1	UAH	13 000	0%	26 000

Megjegyzés:

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

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

Biztosíték számítás metódusa: **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. augusztus 18.

KELER KSZF Zrt.