

KELER KSZF-39-2015. számú leirat

Pénzügyi ügyletkör

Hatályos: 2015. szeptember 30.

A KELER KSZF Zrt. Általános Üzletszabályzata alapján 2015. 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	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	15,2	Ft	15 200	70%	9 120
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	7 525	70%	4 515
AUD/CHF	X	X		minden lejáratban	0,038	CHF	11 020	70%	6 612
CAD/CHF	X	X		minden lejáratban	0,039	CHF	11 310	70%	6 786
CAD/JPY	X		X	minden lejáratban	3,6	JPY	8 280	70%	4 968
CHF/JPY	X			minden lejáratban	5,7	JPY	13 110	70%	7 866
CHF/PLN	X	X		minden lejáratban	0,19	PLN	14 250	60%	11 400
EUR/AUD	X	X		minden lejáratban	0,045	AUD	8 910	70%	5 346
EUR/CAD	X	X		minden lejáratban	0,045	CAD	9 675	70%	5 805
EUR/CHF	X	X	X	minden lejáratban	0,06	CHF	17 400	70%	10 440
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	9 890	70%	5 934
EUR/HRK	X			minden lejáratban	0,28	HRK	11 760	0%	23 520
EUR/JPY	X	X	X	minden lejáratban	5,2	JPY	11 960	80%	4 784
EUR/NOK	X			minden lejáratban	0,25	NOK	8 500	70%	5 100
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	7,2	RUB	36 000	50%	36 000
EUR/SEK	X			minden lejáratban	0,35	SEK	11 900	70%	7 140
EUR/TRY	X	X	X	minden lejáratban	0,14	TRY	13 160	50%	13 160
EUR/USD	X	X	X	minden lejáratban	0,03	USD	8 400	80%	3 360
GBP/AUD	X	X		minden lejáratban	0,06	AUD	11 880	70%	7 128
GBP/CAD	X	X		minden lejáratban	0,05	CAD	10 750	70%	6 450
GBP/CHF	X	X	X	minden lejáratban	0,09	CHF	26 100	70%	15 660
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	13 600	70%	8 160
GBP/TRY	X	X		minden lejáratban	0,16	TRY	15 040	60%	12 032
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	0,2	BRL	14 800	0%	29 600
USD/CAD	X	X	X	minden lejáratban	0,035	CAD	7 525	70%	4 515
USD/CHF	X	X	X	minden lejáratban	0,055	CHF	15 950	70%	9 570
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	9 350	70%	5 610
USD/NOK	X			minden lejáratban	0,25	NOK	8 500	70%	5 100
USD/PLN	X	X		minden lejáratban	0,13	PLN	9 750	70%	5 850
USD/RUB	X			minden lejáratban	6	RUB	30 000	50%	30 000
USD/SEK	X			minden lejáratban	0,3	SEK	10 200	70%	6 120
USD/TRY	X	X	X	minden lejáratban	0,1	TRY	9 400	60%	7 520
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. szeptember 25.

KELER KSZF Zrt.