

KELER KSZF-64-2016. számú leirat

Pénzügyi ügyletkör

Hatályos: 2016. december 29.

A KELER KSZF Zrt. Általános Üzletszabályzata alapján 2016. december 29-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 kedvezmény 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

Termék név	SPAN azonosító	Határidős termék	Egyhetes termék	Opció termék	Lejárat(ok)	Árváltozás tartomány (+/-)		Kontraktusméret	Lejáratok közötti spread kedvezmény mértéke	Lejáratok közötti spread paraméterek
CAD/HUF	V104	X			minden lejáratban	7	HUF	1 000	80%	2,8
CHF/HUF	V/W15	X	X	X	minden lejáratban	10	HUF	1 000	70%	6
CZK/HUF	V19	X			minden lejáratban	1	HUF	100 000	70%	0,6
EUR/HUF	V/W16	X	X	X	minden lejáratban	10	HUF	1 000	70%	6
GBP/HUF	V/W14	X	X		minden lejáratban	13	HUF	1 000	80%	5,2
JPY/HUF	V17	X		X	minden lejáratban	8	HUF	1 000	80%	3,2
NOK/HUF	V103	X			minden lejáratban	1,2	HUF	10 000	70%	0,72
PLN/HUF	V41	X			minden lejáratban	2,5	HUF	10 000	70%	1,5
TRY/HUF	V/W43	X	X	X	minden lejáratban	3	HUF	1 000	70%	1,8
USD/HUF	V/W12	X	X	X	minden lejáratban	10,5	HUF	1 000	80%	4,2
AUD/USD	V/W48	X	X	X	minden lejáratban	0,027	USD	1 000	80%	0,0108
AUD/JPY	V/W95	X	X		minden lejáratban	3,6	JPY	1 000	80%	1,44
AUD/CAD	V/W97	X	X		minden lejáratban	0,035	CAD	1 000	80%	0,014
AUD/CHF	V/W98	X	X		minden lejáratban	0,03	CHF	1 000	80%	0,012
CAD/CHF	V/W102	X	X		minden lejáratban	0,03	CHF	1 000	80%	0,012
CAD/JPY	V51	X		X	minden lejáratban	3,6	JPY	1 000	80%	1,44
CHF/JPY	V30	X			minden lejáratban	4	JPY	1 000	80%	1,6
CHF/PLN	V/W80	X	X		minden lejáratban	0,12	PLN	1 000	60%	0,096
EUR/AUD	V/W100	X	X		minden lejáratban	0,045	AUD	1 000	80%	0,018

Termék név	SPAN azonosító	Határidős termék	Egyhetes termék	Opció termék	Lejárat(ok)	Árváltozás tartomány (+/-)		Kontraktsméret	Lejáratok közötti spread kedvezmény mértéke	Lejáratok közötti spread paraméterek
EUR/CAD	V/W101	X	X		minden lejáratban	0,045	CAD	1 000	80%	0,018
EUR/CHF	V/W23	X	X	X	minden lejáratban	0,04	CHF	1 000	70%	0,024
EUR/CZK	V34	X		X	minden lejáratban	2,5	CZK	1 000	50%	2,5
EUR/GBP	V/W24	X	X		minden lejáratban	0,03	GBP	1 000	80%	0,012
EUR/HRK	V52	X			minden lejáratban	0,28	HRK	1 000	0%	0,56
EUR/JPY	V/W22	X	X	X	minden lejáratban	5,2	JPY	1 000	80%	2,08
EUR/NOK	V32	X			minden lejáratban	0,25	NOK	1 000	70%	0,15
EUR/PLN	V/W33	X	X	X	minden lejáratban	0,14	PLN	1 000	50%	0,14
EUR/RON	V44	X		X	minden lejáratban	0,14	RON	1 000	0%	0,28
EUR/RSD	V94	X			minden lejáratban	4	RSD	1 000	0%	8
EUR/RUB	V54	X			minden lejáratban	5	RUB	1 000	50%	5
EUR/SEK	V31	X			minden lejáratban	0,35	SEK	1 000	80%	0,14
EUR/TRY	V/W45	X	X	X	minden lejáratban	0,14	TRY	1 000	50%	0,14
EUR/USD	V/W21	X	X	X	minden lejáratban	0,045	USD	1 000	80%	0,018
GBP/AUD	V/W81	X	X		minden lejáratban	0,06	AUD	1 000	80%	0,024
GBP/CAD	V/W99	X	X		minden lejáratban	0,06	CAD	1 000	70%	0,036
GBP/CHF	V/W29	X	X	X	minden lejáratban	0,06	CHF	1 000	80%	0,024
GBP/JPY	V/W28	X	X	X	minden lejáratban	7	JPY	1 000	80%	2,8
GBP/PLN	V/W82	X	X		minden lejáratban	0,2	PLN	1 000	80%	0,08
GBP/SEK	V39	X			minden lejáratban	0,4	SEK	1 000	80%	0,16
GBP/TRY	V/W105	X	X		minden lejáratban	0,16	TRY	1 000	60%	0,128
GBP/USD	V/W27	X	X	X	minden lejáratban	0,05	USD	1 000	80%	0,02
NZD/JPY	V96	X			minden lejáratban	3,5	JPY	1 000	80%	1,4
USD/BRL	V56	X			minden lejáratban	0,2	BRL	1 000	0%	0,4
USD/CAD	V/W49	X	X	X	minden lejáratban	0,04	CAD	1 000	80%	0,016
USD/CHF	V/W25	X	X	X	minden lejáratban	0,04	CHF	1 000	80%	0,016
USD/CZK	V38	X			minden lejáratban	2,2	CZK	1 000	80%	0,88
USD/JPY	V/W26	X	X	X	minden lejáratban	4,1	JPY	1 000	80%	1,64
USD/MXN	V57	X			minden lejáratban	0,6	MXN	1 000	80%	0,24
USD/NOK	V36	X			minden lejáratban	0,25	NOK	1 000	80%	0,1
USD/PLN	V/W37	X	X		minden lejáratban	0,13	PLN	1 000	70%	0,078
USD/RUB	V55	X			minden lejáratban	4,5	RUB	1 000	50%	4,5
USD/SEK	V35	X			minden lejáratban	0,3	SEK	1 000	80%	0,12
USD/TRY	V/W47	X	X	X	minden lejáratban	0,1	TRY	1 000	60%	0,08
USD/UAH	V59	X			minden lejáratban	1	UAH	1 000	0%	2

Az alapbiztosíték számítás során alkalmazott forintosítási árfolyamok:

Deviza	Árfolyam
AUD	220
BRL	87
CAD	225
CHF	295
CZK	12
EUR	315
GBP	370
HRK	42
JPY	2,6
MXN	15
NOK	35
PLN	71
RON	70
RSD	3
RUB	5
SEK	32
TRY	86
USD	295
UAH	12

Egy határidős kötéshez kapcsolódó forintos alapbiztosíték igény meghatározása:

*Árváltozás tartomány * kontraktusméret * forintosítási árfolyam*

Két, spread kedvezményt tartalmazó határidős kötéshez kapcsolódó forintos alapbiztosíték igény meghatározása:

*2 * Árváltozás tartomány * kontraktusméret * forintosítási árfolyam * (1 - spread kedvezmény mértéke[%])*

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 módszere: **nettó elv**

Szállítási (delivery) hónap kiegészítő biztosíték: Nincs!

Termékek közötti spread kedvezmény: Nincs!

Budapest, 2016. december 27.

KELER KSZF Zrt.