

KELER KSZF – 74/2017. számú leirat

Pénzügyi ügyletkör

Hatálybalépés dátuma: 2017. október 31.

A KELER KSZF Zrt. Általános Üzletszabályzata alapján **2017. október 31-i hatállyal a BÉT Pénzügyi ügyletkör** garanciarendszerét az alábbiak szerint határozza meg:

Alapbiztosíték beállítási paraméterek

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	7,5	HUF	1 000	70%	4,5
CZK/HUF	V19	X			minden lejáratban	0,45	HUF	100 000	70%	0,27
EUR/HUF	V/W16	X	X	X	minden lejáratban	8	HUF	1 000	70%	4,8
GBP/HUF	V/W14	X	X		minden lejáratban	12	HUF	1 000	80%	4,8
JPY/HUF	V17	X		X	minden lejáratban	8,5	HUF	1 000	80%	3,4
NOK/HUF	V103	X			minden lejáratban	1,1	HUF	10 000	70%	0,66
PLN/HUF	V41	X			minden lejáratban	2,4	HUF	10 000	70%	1,44
TRY/HUF	V/W43	X	X	X	minden lejáratban	3,3	HUF	1 000	70%	1,98
USD/HUF	V/W12	X	X	X	minden lejáratban	9	HUF	1 000	80%	3,6
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	3,4	JPY	1 000	80%	1,36
AUD/CAD	V/W97	X	X		minden lejáratban	0,035	CAD	1 000	80%	0,014
AUD/CHF	V/W98	X	X		minden lejáratban	0,025	CHF	1 000	80%	0,01
CAD/CHF	V/W102	X	X		minden lejáratban	0,025	CHF	1 000	80%	0,01
CAD/JPY	V51	X		X	minden lejáratban	3,3	JPY	1 000	80%	1,32
CHF/JPY	V30	X			minden lejáratban	4	JPY	1 000	80%	1,6
CHF/PLN	V/W80	X	X		minden lejáratban	0,14	PLN	1 000	60%	0,112
EUR/AUD	V/W100	X	X		minden lejáratban	0,045	AUD	1 000	80%	0,018
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	0,035	CHF	1 000	70%	0,021
EUR/CZK	V34	X		X	minden lejáratban	0,9	CZK	1 000	40%	1,08
EUR/GBP	V/W24	X	X		minden lejáratban	0,03	GBP	1 000	80%	0,012
EUR/HRK	V52	X			minden lejáratban	0,25	HRK	1 000	0%	0,5
EUR/JPY	V/W22	X	X	X	minden lejáratban	4,5	JPY	1 000	80%	1,8
EUR/NOK	V32	X			minden lejáratban	0,3	NOK	1 000	70%	0,18
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

Termék név	SPAN azonosító	Határidős termék	Egyhetes termék	Opció termék	Lejárat(ok)	Árváltozás tartomány (+/-)		Kontraktusméret	Lejáratok közötti spread kedvezmény mértéke	Lejáratok közötti spread paraméterek
EUR/RSD	V94	X			minden lejáratban	4	RSD	1 000	0%	8
EUR/RUB	V54	X			minden lejáratban	3	RUB	1 000	50%	3
EUR/SEK	V31	X			minden lejáratban	0,35	SEK	1 000	80%	0,14
EUR/TRY	V/W45	X	X	X	minden lejáratban	0,2	TRY	1 000	50%	0,2
EUR/USD	V/W21	X	X	X	minden lejáratban	0,035	USD	1 000	80%	0,014
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	0,05	CHF	1 000	80%	0,02
GBP/JPY	V/W28	X	X	X	minden lejáratban	6	JPY	1 000	80%	2,4
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	0,25	TRY	1 000	60%	0,2
GBP/USD	V/W27	X	X	X	minden lejáratban	0,05	USD	1 000	80%	0,02
NZD/JPY	V96	X			minden lejáratban	3	JPY	1 000	80%	1,2
USD/BRL	V56	X			minden lejáratban	0,15	BRL	1 000	0%	0,3
USD/CAD	V/W49	X	X	X	minden lejáratban	0,043	CAD	1 000	80%	0,0172
USD/CHF	V/W25	X	X	X	minden lejáratban	0,03	CHF	1 000	80%	0,012
USD/CZK	V38	X			minden lejáratban	0,8	CZK	1 000	80%	0,32
USD/JPY	V/W26	X	X	X	minden lejáratban	4,1	JPY	1 000	80%	1,64
USD/MXN	V57	X			minden lejáratban	0,9	MXN	1 000	80%	0,36
USD/NOK	V36	X			minden lejáratban	0,27	NOK	1 000	80%	0,108
USD/PLN	V/W37	X	X		minden lejáratban	0,13	PLN	1 000	70%	0,078
USD/RUB	V55	X			minden lejáratban	2,5	RUB	1 000	50%	2,5
USD/SEK	V35	X			minden lejáratban	0,3	SEK	1 000	80%	0,12
USD/TRY	V/W47	X	X	X	minden lejáratban	0,16	TRY	1 000	60%	0,128
USD/UAH	V59	X			minden lejáratban	1	UAH	1 000	0%	2

Az alapszámítások során alkalmazott forintosítási árfolyamok:

Deviza	Árfolyam
AUD	210
BRL	84
CAD	215

Deviza	Árfolyam
CHF	270
CZK	12
EUR	315
GBP	350
HRK	42
JPY	2,4
MXN	15
NOK	34
PLN	73
RON	68
RSD	3
RUB	5
SEK	33
TRY	73
USD	265
UAH	10

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 metódusa: **nettó elv.**

Szállítási (delivery) hónap kiegészítő biztosíték: **Nincs!**

Termékek közötti spread kedvezmény: **Nincs!**

Budapest, 2017. október 26.

KELER KSZF Zrt.