

KELER KSZF – 40/2019. számú leirat

Pénzügyi ügyletkör

Hatálybalépés dátuma: 2019. május 31.

A KELER KSZF Zrt. Általános Üzletszabályzata alapján 2019. május 31-ei 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 (+/-)		Kontraktsméret	Lejáratok közötti spread kedvezmény mértéke	Lejáratok közötti spread paraméterek
CAD/HUF	V104	X			minden lejáratban	5,500	HUF	1 000	80%	2,2
CHF/HUF	V/W15	X	X	X	m.l.	6,000	HUF	1 000	70%	3,6
CZK/HUF	V19	X			m.l.	0,200	HUF	100 000	70%	0,12
EUR/HUF	V/W16	X	X	X	m.l.	4,500	HUF	1 000	70%	2,7
GBP/HUF	V/W14	X	X		m.l.	11,000	HUF	1 000	80%	4,4
JPY/HUF	V17	X		X	m.l.	8,000	HUF	1 000	80%	3,2
NOK/HUF	V103	X			m.l.	0,600	HUF	10 000	70%	0,36
PLN/HUF	V41	X			m.l.	1,000	HUF	10 000	70%	0,6
TRY/HUF	V/W43	X	X	X	m.l.	4,500	HUF	1 000	70%	2,7
USD/HUF	V/W12	X	X	X	m.l.	8,000	HUF	1 000	80%	3,2
AUD/USD	V/W48	X	X	X	m.l.	0,027	USD	1 000	80%	0,0108
AUD/JPY	V/W95	X	X		m.l.	2,500	JPY	1 000	80%	1
AUD/CAD	V/W97	X	X		m.l.	0,025	CAD	1 000	80%	0,01
AUD/CHF	V/W98	X	X		m.l.	0,020	CHF	1 000	80%	0,008
CAD/CHF	V/W102	X	X		m.l.	0,020	CHF	1 000	80%	0,008
CAD/JPY	V51	X		X	m.l.	2,000	JPY	1 000	80%	0,8
CHF/JPY	V30	X			m.l.	2,000	JPY	1 000	80%	0,8
CHF/PLN	V/W80	X	X		m.l.	0,100	PLN	1 000	60%	0,08
EUR/AUD	V/W100	X	X		m.l.	0,035	AUD	1 000	80%	0,014
EUR/CAD	V/W101	X	X		m.l.	0,035	CAD	1 000	80%	0,014
EUR/CHF	V/W23	X	X	X	m.l.	0,020	CHF	1 000	70%	0,012
EUR/CZK	V34	X		X	m.l.	0,250	CZK	1 000	40%	0,3
EUR/GBP	V/W24	X	X		m.l.	0,025	GBP	1 000	80%	0,01
EUR/HRK	V52	X			m.l.	0,050	HRK	1 000	80%	0,02
EUR/JPY	V/W22	X	X	X	m.l.	2,800	JPY	1 000	80%	1,12
EUR/NOK	V32	X			m.l.	0,160	NOK	1 000	70%	0,096
EUR/PLN	V/W33	X	X	X	m.l.	0,060	PLN	1 000	50%	0,06
EUR/RON	V44	X		X	m.l.	0,050	RON	1 000	0%	0,1

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/RSD	V94	X			m.l.	1,200	RSD	1 000	0%	2,4
EUR/RUB	V54	X			m.l.	2,700	RUB	1 000	50%	2,7
EUR/SEK	V31	X			m.l.	0,200	SEK	1 000	80%	0,08
EUR/TRY	V/W45	X	X	X	m.l.	0,550	TRY	1 000	50%	0,55
EUR/USD	V/W21	X	X	X	m.l.	0,025	USD	1 000	80%	0,01
GBP/AUD	V/W81	X	X		m.l.	0,060	AUD	1 000	80%	0,024
GBP/CAD	V/W99	X	X		m.l.	0,060	CAD	1 000	70%	0,036
GBP/CHF	V/W29	X	X	X	m.l.	0,045	CHF	1 000	80%	0,018
GBP/JPY	V/W28	X	X	X	m.l.	5,000	JPY	1 000	80%	2
GBP/PLN	V/W82	X	X		m.l.	0,150	PLN	1 000	80%	0,06
GBP/SEK	V39	X			m.l.	0,400	SEK	1 000	80%	0,16
GBP/TRY	V/W105	X	X		m.l.	1,000	TRY	1 000	60%	0,8
GBP/USD	V/W27	X	X	X	m.l.	0,040	USD	1 000	80%	0,016
NZD/JPY	V96	X			m.l.	2,000	JPY	1 000	80%	0,8
USD/BRL	V56	X			m.l.	0,200	BRL	1 000	0%	0,4
USD/CAD	V/W49	X	X	X	m.l.	0,030	CAD	1 000	80%	0,012
USD/CHF	V/W25	X	X	X	m.l.	0,030	CHF	1 000	80%	0,012
USD/CZK	V38	X			m.l.	0,600	CZK	1 000	80%	0,24
USD/JPY	V/W26	X	X	X	m.l.	2,000	JPY	1 000	80%	0,8
USD/MXN	V57	X			m.l.	0,800	MXN	1 000	80%	0,32
USD/NOK	V36	X			m.l.	0,270	NOK	1 000	80%	0,108
USD/PLN	V/W37	X	X		m.l.	0,100	PLN	1 000	70%	0,06
USD/RUB	V55	X			m.l.	2,400	RUB	1 000	50%	2,4
USD/SEK	V35	X			m.l.	0,300	SEK	1 000	80%	0,12
USD/TRY	V/W47	X	X	X	m.l.	0,550	TRY	1 000	60%	0,44
USD/UAH	V59	X			m.l.	0,500	UAH	1 000	0%	1

Az alapbiztosíték számítás során alkalmazott forintosítási árfolyamok:

Deviza	Árfolyam
AUD	205
BRL	73
CAD	220

Deviza	Árfolyam
CHF	290
CZK	13
EUR	325
GBP	375
HRK	44
JPY	2,7
MXN	16
NOK	34
PLN	76
RON	69
RSD	3
RUB	5
SEK	31
TRY	48
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 metódusa: **nettó elv.**

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

Termékek közötti spread kedvezmény: **Nincs!**

Budapest, 2019. május 29.

KELER KSZF Zrt.