

KELER KSZF – 57/2019. számú leirat

Pénzügyi ügyletkör

Hatálybalépés dátuma: 2019. augusztus 5.

A KELER KSZF Zrt. Általános Üzletszabályzata alapján **2019. augusztus 5-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 (+/-)		Kontraktsméret	Lejáratok közötti spread kedvezmény mértéke	Lejáratok közötti spread paraméterek
CAD/HUF	V104	X			minden lejáratban	5,500	HUF	1 000	0%	11
CHF/HUF	V/W15	X	X	X	m.l.	7,000	HUF	1 000	0%	14
CZK/HUF	V19	X			m.l.	0,200	HUF	100 000	0%	0,4
EUR/HUF	V/W16	X	X	X	m.l.	4,500	HUF	1 000	0%	9
GBP/HUF	V/W14	X	X		m.l.	11,000	HUF	1 000	0%	22
JPY/HUF	V17	X		X	m.l.	8,000	HUF	1 000	0%	16
NOK/HUF	V103	X			m.l.	0,620	HUF	10 000	0%	1,24
PLN/HUF	V41	X			m.l.	1,000	HUF	10 000	0%	2
TRY/HUF	V/W43	X	X	X	m.l.	4,500	HUF	1 000	0%	9
USD/HUF	V/W12	X	X	X	m.l.	8,000	HUF	1 000	0%	16
AUD/USD	V/W48	X	X	X	m.l.	0,027	USD	1 000	0%	0,054
AUD/JPY	V/W95	X	X		m.l.	2,500	JPY	1 000	0%	5
AUD/CAD	V/W97	X	X		m.l.	0,025	CAD	1 000	0%	0,05
AUD/CHF	V/W98	X	X		m.l.	0,020	CHF	1 000	0%	0,04
CAD/CHF	V/W102	X	X		m.l.	0,020	CHF	1 000	0%	0,04
CAD/JPY	V51	X		X	m.l.	2,000	JPY	1 000	0%	4
CHF/JPY	V30	X			m.l.	2,000	JPY	1 000	0%	4
CHF/PLN	V/W80	X	X		m.l.	0,100	PLN	1 000	0%	0,2
EUR/AUD	V/W100	X	X		m.l.	0,035	AUD	1 000	0%	0,07
EUR/CAD	V/W101	X	X		m.l.	0,035	CAD	1 000	0%	0,07
EUR/CHF	V/W23	X	X	X	m.l.	0,020	CHF	1 000	0%	0,04
EUR/CZK	V34	X		X	m.l.	0,250	CZK	1 000	0%	0,5
EUR/GBP	V/W24	X	X		m.l.	0,025	GBP	1 000	0%	0,05
EUR/HRK	V52	X			m.l.	0,050	HRK	1 000	0%	0,1
EUR/JPY	V/W22	X	X	X	m.l.	2,800	JPY	1 000	0%	5,6
EUR/NOK	V32	X			m.l.	0,160	NOK	1 000	0%	0,32
EUR/PLN	V/W33	X	X	X	m.l.	0,060	PLN	1 000	0%	0,12
EUR/RON	V44	X		X	m.l.	0,050	RON	1 000	0%	0,1

Termék név	SPAN azonosító	Határidős termék	Egyhetes termék	Opációs 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	0%	5,4
EUR/SEK	V31	X			m.l.	0,200	SEK	1 000	0%	0,4
EUR/TRY	V/W45	X	X	X	m.l.	0,550	TRY	1 000	0%	1,1
EUR/USD	V/W21	X	X	X	m.l.	0,025	USD	1 000	0%	0,05
GBP/AUD	V/W81	X	X		m.l.	0,060	AUD	1 000	0%	0,12
GBP/CAD	V/W99	X	X		m.l.	0,060	CAD	1 000	0%	0,12
GBP/CHF	V/W29	X	X	X	m.l.	0,045	CHF	1 000	0%	0,09
GBP/JPY	V/W28	X	X	X	m.l.	5,000	JPY	1 000	0%	10
GBP/PLN	V/W82	X	X		m.l.	0,150	PLN	1 000	0%	0,3
GBP/SEK	V39	X			m.l.	0,400	SEK	1 000	0%	0,8
GBP/TRY	V/W105	X	X		m.l.	1,000	TRY	1 000	0%	2
GBP/USD	V/W27	X	X	X	m.l.	0,040	USD	1 000	0%	0,08
NZD/JPY	V96	X			m.l.	2,000	JPY	1 000	0%	4
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	0%	0,06
USD/CHF	V/W25	X	X	X	m.l.	0,030	CHF	1 000	0%	0,06
USD/CZK	V38	X			m.l.	0,600	CZK	1 000	0%	1,2
USD/JPY	V/W26	X	X	X	m.l.	2,000	JPY	1 000	0%	4
USD/MXN	V57	X			m.l.	0,800	MXN	1 000	0%	1,6
USD/NOK	V36	X			m.l.	0,270	NOK	1 000	0%	0,54
USD/PLN	V/W37	X	X		m.l.	0,100	PLN	1 000	0%	0,2
USD/RUB	V55	X			m.l.	2,400	RUB	1 000	0%	4,8
USD/SEK	V35	X			m.l.	0,300	SEK	1 000	0%	0,6
USD/TRY	V/W47	X	X	X	m.l.	0,550	TRY	1 000	0%	1,1
USD/UAH	V59	X			m.l.	0,550	UAH	1 000	0%	1,1

Az alapszámítások számítás során alkalmazott forintosítási árfolyamok:

Deviza	Árfolyam
AUD	205
BRL	77
CAD	225

Deviza	Árfolyam
CHF	295
CZK	13
EUR	330
GBP	365
HRK	44
JPY	2,7
MXN	16
NOK	34
PLN	77
RON	69
RSD	3
RUB	5
SEK	31
TRY	51
USD	290
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. július 31.

KELER KSZF Zrt.