

KELER KSZF - 92/2019. számú leirat

Pénzügyi ügyletkör

Hatálybalépés dátuma: 2019. november 26

A KELER KSZF Zrt. Általános Üzletszabályzata alapján **2019. november 26-ai 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 (+/-)		Kontraktszám	Lejáratok közötti spread kedvezmény mértéke	Lejáratok közötti spread paraméterek
CAD/HUF	V104	X			minden lejáratban	5,000	HUF	1 000	0%	10
CHF/HUF	V/W15	X	X	X	m.l.	8,000	HUF	1 000	0%	16
CZK/HUF	V19	X			m.l.	0,200	HUF	100 000	0%	0,4
EUR/HUF	V/W16	X	X	X	m.l.	7,500	HUF	1 000	0%	15
GBP/HUF	V/W14	X	X		m.l.	11,000	HUF	1 000	0%	22
JPY/HUF	V17	X		X	m.l.	7,000	HUF	1 000	0%	14
NOK/HUF	V103	X			m.l.	0,620	HUF	10 000	0%	1,24
PLN/HUF	V41	X			m.l.	1,100	HUF	10 000	0%	2,2
TRY/HUF	V/W43	X	X	X	m.l.	4,000	HUF	1 000	0%	8
USD/HUF	V/W12	X	X	X	m.l.	9,400	HUF	1 000	0%	18,8
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.	3,200	JPY	1 000	0%	6,4
AUD/CAD	V/W97	X	X		m.l.	0,020	CAD	1 000	0%	0,04
AUD/CHF	V/W98	X	X		m.l.	0,030	CHF	1 000	0%	0,06
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.	1,800	JPY	1 000	0%	3,6
CHF/PLN	V/W80	X	X		m.l.	0,080	PLN	1 000	0%	0,16
EUR/AUD	V/W100	X	X		m.l.	0,04	AUD	1 000	0%	0,08
EUR/CAD	V/W101	X	X		m.l.	0,030	CAD	1 000	0%	0,06
EUR/CHF	V/W23	X	X	X	m.l.	0,020	CHF	1 000	0%	0,04
EUR/CZK	V34	X		X	m.l.	0,200	CZK	1 000	0%	0,4
EUR/GBP	V/W24	X	X		m.l.	0,03	GBP	1 000	0%	0,06
EUR/HRK	V52	X			m.l.	0,040	HRK	1 000	0%	0,08
EUR/JPY	V/W22	X	X	X	m.l.	2,300	JPY	1 000	0%	4,6
EUR/NOK	V32	X			m.l.	0,170	NOK	1 000	0%	0,34
EUR/PLN	V/W33	X	X	X	m.l.	0,070	PLN	1 000	0%	0,14
EUR/RON	V44	X		X	m.l.	0,040	RON	1 000	0%	0,08

Termék név	SPAN azonosító	Határidős termék	Egyhetes termék	Opció termék	Lejárat(ok)	Árváltozás tartomány (+/-)		Kontraktszám	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.	2,300	RUB	1 000	0%	4,6
EUR/SEK	V31	X			m.l.	0,180	SEK	1 000	0%	0,36
EUR/TRY	V/W45	X	X	X	m.l.	0,500	TRY	1 000	0%	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.	0,06	CHF	1 000	0%	0,12
GBP/JPY	V/W28	X	X	X	m.l.	6,500	JPY	1 000	0%	13
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.	0,060	USD	1 000	0%	0,12
NZD/JPY	V96	X			m.l.	2,600	JPY	1 000	0%	5,2
USD/BRL	V56	X			m.l.	0,180	BRL	1 000	0%	0,36
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.	0,500	CZK	1 000	0%	1
USD/JPY	V/W26	X	X	X	m.l.	2,200	JPY	1 000	0%	4,4
USD/MXN	V57	X			m.l.	0,800	MXN	1 000	0%	1,6
USD/NOK	V36	X			m.l.	0,230	NOK	1 000	0%	0,46
USD/PLN	V/W37	X	X		m.l.	0,100	PLN	1 000	0%	0,2
USD/RUB	V55	X			m.l.	2,000	RUB	1 000	0%	4
USD/SEK	V35	X			m.l.	0,300	SEK	1 000	0%	0,6
USD/TRY	V/W47	X	X	X	m.l.	0,500	TRY	1 000	0%	1
USD/UAH	V59	X			m.l.	0,850	UAH	1 000	0%	1,7

Az alapbiztosíték számítás során alkalmazott forintosítási árfolyamok:

Deviza	Árfolyam
AUD	210
BRL	74
CAD	230

Deviza	Árfolyam
CHF	305
CZK	13
EUR	335
GBP	390
HRK	45
JPY	2,8
MXN	16
NOK	33
PLN	78
RON	70
RSD	3
RUB	5
SEK	31
TRY	52
USD	300
UAH	13

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. november 21.

KELER KSZF Zrt.