

KELER KSZF – 39/2020. számú leirat

Pénzügyi ügyletkör

Hatálybalépés dátuma: 2020. március 30.

A KELER KSZF Zrt. Általános Üzletszabályzata alapján 2020. március 30-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	7,600	HUF	1 000	0%	15,2
CHF/HUF	V/W15	X	X	X	m.l.	11,000	HUF	1 000	0%	22
CZK/HUF	V19	X			m.l.	0,340	HUF	100 000	0%	0,68
EUR/HUF	V/W16	X	X	X	m.l.	10,500	HUF	1 000	0%	21
GBP/HUF	V/W14	X	X		m.l.	11,350	HUF	1 000	0%	22,7
JPY/HUF	V17	X		X	m.l.	9,860	HUF	1 000	0%	19,72
NOK/HUF	V103	X			m.l.	2,750	HUF	10 000	0%	5,5
PLN/HUF	V41	X			m.l.	1,150	HUF	10 000	0%	2,3
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.	14,000	HUF	1 000	0%	28
AUD/USD	V/W48	X	X	X	m.l.	0,035	USD	1 000	0%	0,070
AUD/JPY	V/W95	X	X		m.l.	3,500	JPY	1 000	0%	7
AUD/CAD	V/W97	X	X		m.l.	0,027	CAD	1 000	0%	0,054
AUD/CHF	V/W98	X	X		m.l.	0,030	CHF	1 000	0%	0,06
CAD/CHF	V/W102	X	X		m.l.	0,03	CHF	1 000	0%	0,06
CAD/JPY	V51	X		X	m.l.	4,400	JPY	1 000	0%	8,8
CHF/JPY	V30	X			m.l.	2,200	JPY	1 000	0%	4,4
CHF/PLN	V/W80	X	X		m.l.	0,117	PLN	1 000	0%	0,234
EUR/AUD	V/W100	X	X		m.l.	0,065	AUD	1 000	0%	0,13
EUR/CAD	V/W101	X	X		m.l.	0,060	CAD	1 000	0%	0,12
EUR/CHF	V/W23	X	X	X	m.l.	0,020	CHF	1 000	0%	0,04
EUR/CZK	V34	X		X	m.l.	1,103	CZK	1 000	0%	2,206
EUR/GBP	V/W24	X	X		m.l.	0,03	GBP	1 000	0%	0,06
EUR/HRK	V52	X			m.l.	0,053	HRK	1 000	0%	0,106
EUR/JPY	V/W22	X	X	X	m.l.	2,400	JPY	1 000	0%	4,8
EUR/NOK	V32	X			m.l.	1,515	NOK	1 000	0%	3,03
EUR/PLN	V/W33	X	X	X	m.l.	0,127	PLN	1 000	0%	0,254
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.	10,100	RUB	1 000	0%	20,2
EUR/SEK	V31	X			m.l.	0,345	SEK	1 000	0%	0,69
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.	0,040	USD	1 000	0%	0,08
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.	0,065	USD	1 000	0%	0,13
NZD/JPY	V96	X			m.l.	2,800	JPY	1 000	0%	5,6
USD/BRL	V56	X			m.l.	0,209	BRL	1 000	0%	0,418
USD/CAD	V/W49	X	X	X	m.l.	0,049	CAD	1 000	0%	0,098
USD/CHF	V/W25	X	X	X	m.l.	0,030	CHF	1 000	0%	0,06
USD/CZK	V38	X			m.l.	1,144	CZK	1 000	0%	2,288
USD/JPY	V/W26	X	X	X	m.l.	3,900	JPY	1 000	0%	7,8
USD/MXN	V57	X			m.l.	1,700	MXN	1 000	0%	3,4
USD/NOK	V36	X			m.l.	1,657	NOK	1 000	0%	3,314
USD/PLN	V/W37	X	X		m.l.	0,196	PLN	1 000	0%	0,392
USD/RUB	V55	X			m.l.	7,600	RUB	1 000	0%	15,2
USD/SEK	V35	X			m.l.	0,565	SEK	1 000	0%	1,13
USD/TRY	V/W47	X	X	X	m.l.	0,500	TRY	1 000	0%	1
USD/UAH	V59	X			m.l.	1,031	UAH	1 000	0%	2,062

Az alapszámítások során alkalmazott forintosítási árfolyamok:

Deviza	Árfolyam
AUD	196
BRL	66
CAD	225

Deviza	Árfolyam
CHF	325
CZK	14
EUR	345
GBP	390
HRK	46
JPY	2,9
MXN	15
NOK	32
PLN	78
RON	71
RSD	3
RUB	5
SEK	32
TRY	50
USD	310
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, 2020. március 26.

KELER KSZF Zrt.