

KELER KSZF – 79/2020. számú leirat

Pénzügyi ügyletkör

Hatálybalépés dátuma: 2020. augusztus 18.

A KELER KSZF Zrt. Általános Üzletszabályzata alapján **2020. augusztus 18-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.	8,000	HUF	1 000	0%	16,000
CZK/HUF	V19	X			m.l.	0,370	HUF	100 000	0%	0,74
EUR/HUF	V/W16	X	X	X	m.l.	8,000	HUF	1 000	0%	16,000
GBP/HUF	V/W14	X	X		m.l.	11,000	HUF	1 000	0%	22,000
JPY/HUF	V17	X		X	m.l.	10,370	HUF	1 000	0%	20,740
NOK/HUF	V103	X			m.l.	2,500	HUF	10 000	0%	5,000
PLN/HUF	V41	X			m.l.	1,820	HUF	10 000	0%	3,640
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.	11,000	HUF	1 000	0%	22,000
AUD/USD	V/W48	X	X	X	m.l.	0,030	USD	1 000	0%	0,060
AUD/JPY	V/W95	X	X		m.l.	3,800	JPY	1 000	0%	7,600
AUD/CAD	V/W97	X	X		m.l.	0,035	CAD	1 000	0%	0,07
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.	4,000	JPY	1 000	0%	8,000
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.	0,066	AUD	1 000	0%	0,132
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.	0,074	HRK	1 000	0%	0,148
EUR/JPY	V/W22	X	X	X	m.l.	2,650	JPY	1 000	0%	5,300
EUR/NOK	V32	X			m.l.	1,000	NOK	1 000	0%	2,000
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.	9,000	RUB	1 000	0%	18,000
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.	0,025	USD	1 000	0%	0,050
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.	0,05	CHF	1 000	0%	0,100
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%	0,120
NZD/JPY	V96	X			m.l.	3,262	JPY	1 000	0%	6,524
USD/BRL	V56	X			m.l.	0,318	BRL	1 000	0%	0,636
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.	1,000	CZK	1 000	0%	2,000
USD/JPY	V/W26	X	X	X	m.l.	3,900	JPY	1 000	0%	7,8
USD/MXN	V57	X			m.l.	1,500	MXN	1 000	0%	3,000
USD/NOK	V36	X			m.l.	1,000	NOK	1 000	0%	2,000
USD/PLN	V/W37	X	X		m.l.	0,196	PLN	1 000	0%	0,392
USD/RUB	V55	X			m.l.	7,000	RUB	1 000	0%	14,000
USD/SEK	V35	X			m.l.	0,500	SEK	1 000	0%	1,000
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 számítás során alkalmazott árfolyamok:

Deviza	Árfolyam
AUD	215
BRL	57
CAD	225

Deviza	Árfolyam
CHF	325
CZK	14
EUR	350
GBP	385
HRK	47
JPY	2,9
MXN	14
NOK	33
PLN	79
RON	72
RSD	3
RUB	5
SEK	34
TRY	43
USD	300
UAH	11

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. augusztus 14.

KELER KSZF Zrt.