

KELER KSZF – 27/2021. számú leirat

Pénzügyi ügyletkör

Hatálybalépés dátuma: 2021. március 31.

A KELER KSZF Zrt. Általános Üzletszabályzata alapján 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.	10,000	HUF	1 000	80%	4,000
CZK/HUF	V19	X			m.l.	0,370	HUF	100 000	0%	0,74
EUR/HUF	V/W16	X	X	X	m.l.	9,000	HUF	1 000	80%	3,600
GBP/HUF	V/W14	X	X		m.l.	15,000	HUF	1 000	80%	6,000
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.	12,000	HUF	1 000	80%	4,800
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.	2,350	JPY	1 000	0%	4,700
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.	2,750	JPY	1 000	0%	5,500
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.	0,640	TRY	1 000	0%	1,280
EUR/USD	V/W21	X	X	X	m.l.	0,026	USD	1 000	80%	0,0104
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.	0,170	PLN	1 000	0%	0,34
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.	0,340	BRL	1 000	0%	0,680
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.	0,540	TRY	1 000	0%	1,08
USD/UAH	V59	X			m.l.	1,031	UAH	1 000	0%	2,062

Az alapszámítások számítás során alkalmazott árfolyamok:

Deviza	Árfolyam
AUD	240
BRL	55
CAD	245

Deviza	Árfolyam
CHF	335
CZK	14
EUR	370
GBP	430
HRK	48
JPY	2,9
MXN	15
NOK	36
PLN	80
RON	75
RSD	4
RUB	5
SEK	37
TRY	41
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 az opciós termékek esetében:

- CHF/HUF: (+/-) 14,13 %
- EUR/HUF: (+/-) 1,42 %
- EUR/USD: (+/-) 1,34 %
- USD/HUF: (+/-) 1,88 %
- minden egyéb opciós termékre: (+/-) 10 %

Biztosíték számítás metódusa: **nettó elv.**

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

Termékek közötti spread kedvezmény: **Nincs!**

Budapest, 2021. március 29.

KELER KSZF Zrt.