

KELER KSZF – 96/2022. számú leirat

Pénzügyi ügyletkör

Hatálybalépés dátuma: 2022. június 17.

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 (+/-)		Kontraktsméret	Lejáratok közötti spread kedvezmény mértéke	Lejáratok közötti spread paraméterek
CAD/HUF	V104	X			minden lejáratban	17,360	HUF	1 000	0%	34,720
CHF/HUF	V/W15	X	X	X	m.l.	25,000	HUF	1 000	80%	10,000
CZK/HUF	V19	X			m.l.	0,710	HUF	100 000	0%	1,420
EUR/HUF	V/W16	X	X	X	m.l.	20,000	HUF	1 000	80%	8,000
GBP/HUF	V/W14	X	X		m.l.	26,000	HUF	1 000	80%	10,400
JPY/HUF	V17	X		X	m.l.	23,040	HUF	1 000	0%	46,080
NOK/HUF	V103	X			m.l.	2,500	HUF	10 000	0%	5,000
PLN/HUF	V41	X			m.l.	2,160	HUF	10 000	0%	4,320
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.	26,000	HUF	1 000	80%	10,400
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.	2,905	JPY	1 000	0%	5,810
CHF/PLN	V/W80	X	X		m.l.	0,244	PLN	1 000	0%	0,488
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.	0,022	CHF	1 000	0%	0,044
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.	4,130	JPY	1 000	0%	8,260
EUR/NOK	V32	X			m.l.	1,000	NOK	1 000	0%	2,000
EUR/PLN	V/W33	X	X	X	m.l.	0,173	PLN	1 000	0%	0,346
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 (+/-)		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.	31,092	RUB	1 000	0%	62,184
EUR/SEK	V31	X			m.l.	0,345	SEK	1 000	0%	0,69
EUR/TRY	V/W45	X	X	X	m.l.	1,978	TRY	1 000	0%	3,956
EUR/USD	V/W21	X	X	X	m.l.	0,023	USD	1 000	80%	0,009
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.	0,235	PLN	1 000	0%	0,470
GBP/SEK	V39	X			m.l.	0,400	SEK	1 000	0%	0,8
GBP/TRY	V/W105	X	X		m.l.	2,311	TRY	1 000	0%	4,622
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.	0,248	PLN	1 000	0%	0,496
USD/RUB	V55	X			m.l.	30,812	RUB	1 000	0%	61,624
USD/SEK	V35	X			m.l.	0,500	SEK	1 000	0%	1,000
USD/TRY	V/W47	X	X	X	m.l.	1,859	TRY	1 000	0%	3,718
USD/UAH	V59	X			m.l.	1,031	UAH	1 000	0%	2,062

A fent megnevezett termékek alapszükségletként 25%-os prociklikussági puffert tartalmaz.

Kivétel:

- CHF/HUF: 2%
- GBP/HUF: 2%
- EUR/HUF: 0%
- EUR/USD: 20%

- USD/HUF: 3%

Az alapbiztosíték számítás során alkalmazott árfolyamok:

Deviza	Árfolyam
AUD	265
BRL	76
CAD	290
CHF	380
CZK	16
EUR	395
GBP	460
HRK	52
JPY	2,9
MXN	19
NOK	39
PLN	85
RON	79
RSD	4
RUB	7
SEK	38
TRY	23
USD	370
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 az opciós termékek esetében:

- CHF/HUF: (+/-) 11,30%

- EUR/HUF: (+/-) 1,14%
- EUR/USD: (+/-) 1,34%
- USD/HUF: (+/-) 1,51%
- minden egyéb opciós termékre: (+/-) 10%.

Biztosíték számítás metódusa: **nettó elv.**

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

Termékek közötti spread kedvezmény: **Nincs!**

Budapest, 2022. június 15.

KELER KSZF Zrt.