

# **KELER KSZF - 113/2020. számú leirat**

## **Pénzügyi ügyletkör**

**Hatálybalépés dátuma: 2020. december 23.**

A KELER K SZF Zrt. Általános Üzletszabályzata alapján 2020. december 23-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 (+/-)		Kontraktusméret	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	80%	3,200
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	80%	3,200
GBP/HUF	V/W14	X	X		m.l.	11,000	HUF	1 000	80%	4,400
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	80%	4,400
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.	2,350	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 (+/-)		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.	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.	0,501	TRY	1 000	0%	1,002
<b>EUR/USD</b>	<b>V/W21</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>X</b>	<b>m.l.</b>	<b>0,025</b>	<b>USD</b>	<b>1 000</b>	<b>80%</b>	<b>0,010</b>
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 alapbiztosíték számítás során alkalmazott árfolyamok:**

Deviza	Árfolyam
AUD	225
<b>BRL</b>	<b>58</b>
CAD	235

Deviza	Árfolyam
CHF	335
CZK	14
EUR	360
GBP	400
HRK	48
JPY	2,9
MXN	15
NOK	34
PLN	81
RON	74
RSD	4
RUB	4
SEK	36
TRY	38
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. december 21.

KELER KSZF Zrt.