

# **9-07 KELER KSZF leirat**

## **MTS Piac**

**Hatálybalépés dátuma: 2023. február 23.**

A KELER KSFZ Zrt. Általános Üzletszabályzata alapján az **MTS piac garanciarendszerét** az alábbiak szerint határozza meg:

## Alapbiztosíték beállítási paraméterek

### Államkötvények

Az államkötvények esetében az alapbiztosíték nagyságát a névértékhez és a hátralévő futamidőhöz mérten az alábbi táblázat tartalmazza.

Államkötvények hátralévő futamideje	A maximális árváltozáshoz tartozó alapbiztosíték (Ft/db)
< 3 év	Névérték (HUF) X 0,0416, minimum 1 Ft/db
3-5 év	Névérték (HUF) X 0,0617, minimum 1 Ft/db
5-10 év	Névérték (HUF) X 0,0798, minimum 1 Ft/db
10-15 év	Névérték (HUF) X 0,0659, minimum 1 Ft/db
15 év <	Névérték (HUF) X 0,0591, minimum 1 Ft/db

### Diszkontkincstárjegyek

A diszkontkincstárjegyek esetében az alapbiztosíték nagyságát a névértékhez mérten az alábbi táblázat tartalmazza.

A diszkontkincstárjegyek maximális árváltozáshoz tartozó alapbiztosíték (Ft/db)
Névérték (HUF) X 0,0150, minimum 1 Ft/db

### Diákhitel központ kötvények

A diákhitel kötvények esetében az alapbiztosíték nagyságát a névértékhez mérten az alábbi táblázat tartalmazza.

Diákhitel kötvények névértékének devizaneme	A maximális árváltozáshoz tartozó alapbiztosíték (Ft/db)
HUF	Névérték (HUF) X 0,02, minimum 1 Ft/db

## Vállalati kötvények

A vállalati kötvények esetében az alapbiztosíték nagyságát a névértékhez mérten az alábbi táblázat tartalmazza.

Vállalati kötvények névértékének devizaneme	A maximális árváltozáshoz tartozó alapbiztosíték (Ft/db)
HUF	Névérték (HUF) X 0,0759, minimum 1 Ft/db
EUR	Névérték (EUR) X 30,82, minimum 1 Ft/db
USD	Névérték (USD) X 28,73, minimum 1 Ft/db

*A fent megnevezett termékek alapbiztosítéka 25%-os prociklikussági puffert tartalmaz, kivéve:*

- *Államkötvény < 3 év: 4%*
- *Államkötvény 3-5 év: 9%*
- *Vállalati HUF: 21%*
- *Vállalati EUR: 24%*
- *Vállalati USD: 22%*

Egyéb megjegyzések:

- A margin számításnál a SD-1 napon lévő pozíciók nem kerülnek figyelembe vételre.
- Az árkülönbözet meghatározásánál a különböző elszámolási napok között 100%-os spread kerül alkalmazásra azonos termékek esetében.
- Az árkülönbözet meghatározásánál a különböző termékek között 0%-os spread kerül alkalmazásra.

## Egyéb rendelkezések

Jelen Leiratot a KELER K SZF jogosult azonnali hatállyal módosítani és a módosított Leiratot honlapján közzéteszi.

Budapest, 2023. február 21.

KELER K SZF Zrt.