

# **9-05 KELER KSZF leirat**

## Pénzügyi ügyletkör

**Hatálybalépés dátuma: 2023. március 21.**

A KELER K SZF 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 (+/-)		Kontraktusméret	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.	24,000	HUF	1 000	80%	9,600
CZK/HUF	V19	X			m.l.	0,710	HUF	100 000	0%	1,420
EUR/HUF	V/W16	X	X	X	m.l.	23,000	HUF	1 000	80%	9,200
GBP/HUF	V/W14	X	X		m.l.	27,000	HUF	1 000	80%	10,800
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.	2,445	HUF	10 000	0%	4,89
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.	27,000	HUF	1 000	80%	10,800
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.	5,540	JPY	1 000	0%	11,08
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.	0,024	CHF	1 000	0%	0,048
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/JPY	V/W22	X	X	X	m.l.	4,815	JPY	1 000	0%	9,630
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.	0,049	RON	1 000	0%	0,098
EUR/RSD	V94	X			m.l.	1,200	RSD	1 000	0%	2,4

Termék név	SPAN azonosító	Határidős termék	Egyhetes termék	Opció termék	Lejárat(ok)	Árváltozás tartomány (+/-)		Kontraktsméret	Lejáratok közötti spread kedvezmény mértéke	Lejáratok közötti spread paraméterek
<b>EUR/RUB</b>	<b>V54</b>	<b>X</b>			<b>m.l.</b>	<b>11,206</b>	<b>RUB</b>	<b>1 000</b>	<b>0%</b>	<b>22,412</b>
EUR/SEK	V31	X			m.l.	0,345	SEK	1 000	0%	0,69
EUR/TRY	V/W45	X	X	X	m.l.	2,074	TRY	1 000	0%	4,148
EUR/USD	V/W21	X	X	X	m.l.	0,036	USD	1 000	80%	0,015
GBP/AUD	V/W81	X	X		m.l.	0,065	AUD	1 000	0%	0,13
GBP/CAD	V/W99	X	X		m.l.	0,061	CAD	1 000	0%	0,122
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.	6,890	JPY	1 000	0%	13,78
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.	2,384	TRY	1 000	0%	4,768
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.	0,042	CHF	1 000	0%	0,084
USD/CZK	V38	X			m.l.	1,000	CZK	1 000	0%	2,000
USD/JPY	V/W26	X	X	X	m.l.	7,650	JPY	1 000	0%	15,3
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
<b>USD/RUB</b>	<b>V55</b>	<b>X</b>			<b>m.l.</b>	<b>10,645</b>	<b>RUB</b>	<b>1 000</b>	<b>0%</b>	<b>21,29</b>
USD/SEK	V35	X			m.l.	0,500	SEK	1 000	0%	1,000
USD/TRY	V/W47	X	X	X	m.l.	1,994	TRY	1 000	0%	3,988
USD/UAH	V59	X			m.l.	7,223	UAH	1 000	0%	14,446

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

**Az alapbiztosíték számítás során alkalmazott árfolyamok:**

Deviza	Árfolyam
AUD	245
BRL	70
CAD	265
CHF	390
CZK	17
EUR	385
GBP	435
JPY	2,7
MXN	20
NOK	35
PLN	81
RON	78
RSD	4
RUB	5
SEK	35
TRY	19
USD	360
UAH	10

**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!**

### **Egyéb rendelkezések**

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

Budapest, 2023. március 17.

KELER KSZF Zrt.