

KELER KSZF - 11/2022. számú leirat
BÉT Hitelpapír szekció

Hatálybalépés dátuma: 2022. január 20.

A KELER KSZF Zrt. Általános Üzletszabályzata alapján a **BÉT Hitelpapír szekció** garanciarendszerét az alábbiak szerint határozza meg:

Alapbiztosíték beállítási paraméterek

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 0,0180, minimum 1 Ft/db
EUR	Névérték (EUR) X 6,80 minimum 1 Ft/db
USD	Névérték (USD) X 5,90 minimum 1 Ft/db

Jelzáloglevelek

A jelzáloglevelek esetében az alapbiztosíték nagyságát a névértékhez és a hátralévő futamidőhöz mérten az alábbi táblázat tartalmazza.

Jelzáloglevelek névértékének devizaneme	Hátralévő futamidő	A maximális árváltozáshoz tartozó alapbiztosíték (Ft/db)
HUF	< 3 év	Névérték (HUF) X 0,0130, minimum 1 Ft/db
HUF	> 3 év	Névérték (HUF) X 0,0300, minimum 1 Ft/db
EUR	< 3 év	Névérték (EUR) X 4,70, minimum 1 Ft/db

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

Kivétel:

- HUF vállalati kötvények: **18 %**
- EUR vállalati kötvények: **24 %**
- USD vállalati kötvények: **22 %**
- 3 év < hátralévő futamidejű HUF jelzáloglevelek: **19 %**

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.

Budapest, 2022. január 19.

KELER KSZF Zrt.