

KELER KSZF - 47/2018. számú leirat

Pénzügyi ügyletkör

Hatálybalépés dátuma: 2018. augusztus 14.

A KELER K SZF Zrt. Általános Üzletszabályzata alapján **2018. augusztus 14-i 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	HUF	1 000	80%	2,8
CHF/HUF	V/W15	X	X	X	m.l.	7	HUF	1 000	70%	4,2
CZK/HUF	V19	X			m.l.	0,4	HUF	100 000	70%	0,24
EUR/HUF	V/W16	X	X	X	m.l.	7,5	HUF	1 000	70%	4,5
GBP/HUF	V/W14	X	X		m.l.	12	HUF	1 000	80%	4,8
JPY/HUF	V17	X		X	m.l.	7,5	HUF	1 000	80%	3
NOK/HUF	V103	X			m.l.	1	HUF	10 000	70%	0,6
PLN/HUF	V41	X			m.l.	2,2	HUF	10 000	70%	1,32
TRY/HUF	V/W43	X	X	X	m.l.	4,77	HUF	1 000	70%	2,862
USD/HUF	V/W12	X	X	X	m.l.	9	HUF	1 000	80%	3,6
AUD/USD	V/W48	X	X	X	m.l.	0,027	USD	1 000	80%	0,0108
AUD/JPY	V/W95	X	X		m.l.	2,5	JPY	1 000	80%	1
AUD/CAD	V/W97	X	X		m.l.	0,03	CAD	1 000	80%	0,012
AUD/CHF	V/W98	X	X		m.l.	0,025	CHF	1 000	80%	0,01
CAD/CHF	V/W102	X	X		m.l.	0,025	CHF	1 000	80%	0,01
CAD/JPY	V51	X		X	m.l.	3	JPY	1 000	80%	1,2
CHF/JPY	V30	X			m.l.	3,5	JPY	1 000	80%	1,4
CHF/PLN	V/W80	X	X		m.l.	0,14	PLN	1 000	60%	0,112
EUR/AUD	V/W100	X	X		m.l.	0,045	AUD	1 000	80%	0,018
EUR/CAD	V/W101	X	X		m.l.	0,045	CAD	1 000	80%	0,018
EUR/CHF	V/W23	X	X	X	m.l.	0,055	CHF	1 000	70%	0,033
EUR/CZK	V34	X		X	m.l.	0,8	CZK	1 000	40%	0,96
EUR/GBP	V/W24	X	X		m.l.	0,03	GBP	1 000	80%	0,012
EUR/HRK	V52	X			m.l.	0,25	HRK	1 000	0%	0,5
EUR/JPY	V/W22	X	X	X	m.l.	4	JPY	1 000	80%	1,6
EUR/NOK	V32	X			m.l.	0,3	NOK	1 000	70%	0,18
EUR/PLN	V/W33	X	X	X	m.l.	0,14	PLN	1 000	50%	0,14
EUR/RON	V44	X		X	m.l.	0,14	RON	1 000	0%	0,28

Termék név	SPAN azonosító	Határidős termék	Egyhetes termék	Opció termék	Lejárat(ok)	Árváltozás tartomány (+/-)		Kontraktusméret	Lejáratok közötti spread kedvezmény mértéke	Lejáratok közötti spread paraméterek
EUR/RSD	V94	X			m.l.	3,8	RSD	1 000	0%	7,6
EUR/RUB	V54	X			m.l.	7	RUB	1 000	50%	7
EUR/SEK	V31	X			m.l.	0,3	SEK	1 000	80%	0,12
EUR/TRY	V/W45	X	X	X	m.l.	0,69	TRY	1 000	50%	0,69
EUR/USD	V/W21	X	X	X	m.l.	0,035	USD	1 000	80%	0,014
GBP/AUD	V/W81	X	X		m.l.	0,06	AUD	1 000	80%	0,024
GBP/CAD	V/W99	X	X		m.l.	0,06	CAD	1 000	70%	0,036
GBP/CHF	V/W29	X	X	X	m.l.	0,065	CHF	1 000	80%	0,026
GBP/JPY	V/W28	X	X	X	m.l.	5	JPY	1 000	80%	2
GBP/PLN	V/W82	X	X		m.l.	0,15	PLN	1 000	80%	0,06
GBP/SEK	V39	X			m.l.	0,4	SEK	1 000	80%	0,16
GBP/TRY	V/W105	X	X		m.l.	0,76	TRY	1 000	60%	0,608
GBP/USD	V/W27	X	X	X	m.l.	0,04	USD	1 000	80%	0,016
NZD/JPY	V96	X			m.l.	2,5	JPY	1 000	80%	1
USD/BRL	V56	X			m.l.	0,2	BRL	1 000	0%	0,4
USD/CAD	V/W49	X	X	X	m.l.	0,043	CAD	1 000	80%	0,0172
USD/CHF	V/W25	X	X	X	m.l.	0,045	CHF	1 000	80%	0,018
USD/CZK	V38	X			m.l.	0,7	CZK	1 000	80%	0,28
USD/JPY	V/W26	X	X	X	m.l.	3,5	JPY	1 000	80%	1,4
USD/MXN	V57	X			m.l.	0,7	MXN	1 000	80%	0,28
USD/NOK	V36	X			m.l.	0,27	NOK	1 000	80%	0,108
USD/PLN	V/W37	X	X		m.l.	0,13	PLN	1 000	70%	0,078
USD/RUB	V55	X			m.l.	5,3	RUB	1 000	50%	5,3
USD/SEK	V35	X			m.l.	0,3	SEK	1 000	80%	0,12
USD/TRY	V/W47	X	X	X	m.l.	0,66	TRY	1 000	60%	0,528
USD/UAH	V59	X			m.l.	1	UAH	1 000	0%	2

Az alapbiztosíték számítás során alkalmazott forintosítási árfolyamok:

Deviza	Árfolyam
AUD	210
BRL	73
CAD	215

Deviza	Árfolyam
CHF	280
CZK	13
EUR	330
GBP	370
HRK	44
JPY	2,5
MXN	15
NOK	35
PLN	75
RON	70
RSD	3
RUB	5
SEK	32
TRY	50
USD	280
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:

Kírt 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, 2018. augusztus 13.

KELER KSZF Zrt.