

KELER KSZF - 08/2021. számú leirat

Pénzügyi ügyletkör

Hatálybalépés dátuma: 2021. január 25.

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 | 7,600 | HUF | 1 000 | 0% | 15,2 |
| CHF/HUF | V/W15 | X | X | X | m.l. | 8,500 | HUF | 1 000 | 80% | 3,400 |
| 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. | 11,500 | HUF | 1 000 | 80% | 4,600 |
| 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 |
| EUR/USD | V/W21 | X | X | X | m.l. | 0,025 | USD | 1 000 | 80% | 0,010 |
| 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. | 0,170 | PLN | 1 000 | 0% | 0,34 |
| 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 | 230 |
| BRL | 57 |
| CAD | 235 |

| Deviza | Árfolyam |
|--------|----------|
| CHF | 335 |
| CZK | 14 |
| EUR | 365 |
| GBP | 405 |
| HRK | 48 |
| JPY | 2,9 |
| MXN | 15 |
| NOK | 35 |
| PLN | 80 |
| RON | 75 |
| RSD | 4 |
| RUB | 4 |
| SEK | 36 |
| TRY | 40 |
| 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, 2021. január 21.

KELER K SZF Zrt.