

IX-BÉT-40-2008 EL számú Elszámolóházi leirat

PÉNZÜGYI ÜGYLETKÖR

A KELER Zrt. „Általános Üzletszabályzata” alapján **2008. december 18-i hatállyal** a BÉT Pénzügyi ügyletkör garanciarendszerét az alábbiak szerint határozza meg:

Alapbiztosíték beállítási paraméterek

| Termék név | Forint elszámolású termék | Forint elszámolású egyhetes termék | Forint elszámolású opciós termék | Lejárat(ok) | Árváltás tartomány (+/-) | | A maximális árváltáshoz tartozó alapbiztosíték a határidős termékek esetében | Lejáratok közötti spread mértéke | Lejáratok közötti spread paraméterek |
|----------------|---------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|--------------------------|------------|--|----------------------------------|--------------------------------------|
| | | | | | (Ft/kontraktus) | % | (Ft/spread) | | |
| 3 BUBOR | X | | | minden lejáratban | 0,68 | % | 17 000 | 50% | 17 000 |
| 1 BUBOR | X | | | minden lejáratban | 0,68 | % | 5 700 | 50% | 5 700 |
| 5 REF.ÁK. | X | | | minden lejáratban | 2,0 | % | 20 000 | 50% | 20 000 |
| 6 BUBOR | X | | | minden lejáratban | 0,68 | % | 34 000 | 50% | 34 000 |
| CHF/HUF | X | | X | minden lejáratban | 7 | Ft | 7 000 | 80% | 2 800 |
| CZK/HUF | X | | | minden lejáratban | 0,5 | Ft | 50 000 | 70% | 30 000 |
| EUR/HUF | X | X | X | minden lejáratban | 11 | Ft | 11 000 | 80% | 4 400 |
| GBP/HUF | X | X | | minden lejáratban | 15 | Ft | 15 000 | 70% | 9 000 |
| JPY/HUF | X | | X | minden lejáratban | 11 | Ft | 11 000 | 70% | 6 600 |
| PLN/HUF | X | | | minden lejáratban | 3,4 | Ft | 34 000 | 70% | 20 400 |
| TRY/HUF | X | | X | minden lejáratban | 8 | Ft | 8 000 | 70% | 4 800 |
| USD/HUF | X | X | X | minden lejáratban | 8,5 | Ft | 8 500 | 80% | 3 400 |
| AUD/USD | X | X | | minden lejáratban | 0,025 | USD | 5 000 | 50% | 5 000 |
| CAD/JPY | X | | X | minden lejáratban | 3,5 | JPY | 5 250 | 50% | 5 250 |
| CHF/JPY | X | | | minden lejáratban | 2,8 | JPY | 4 200 | 50% | 4 200 |
| EUR/CHF | X | | | minden lejáratban | 0,038 | CHF | 5 700 | 50% | 5 700 |
| EUR/CZK | X | | X | minden lejáratban | 0,8 | CZK | 7 200 | 50% | 7 200 |
| EUR/GBP | X | X | | minden lejáratban | 0,02 | GBP | 7 000 | 50% | 7 000 |
| EUR/HRK | X | | | minden lejáratban | 0,28 | HRK | 9 800 | 50% | 9 800 |
| EUR/JPY | X | X | X | minden lejáratban | 5,4 | JPY | 8 100 | 50% | 8 100 |
| EUR/NOK | X | | | minden lejáratban | 0,2 | NOK | 6 000 | 50% | 6 000 |
| EUR/PLN | X | X | X | minden lejáratban | 0,11 | PLN | 7 700 | 50% | 7 700 |
| EUR/RON | X | | | minden lejáratban | 0,15 | RON | 10 500 | 50% | 10 500 |
| EUR/RUB | X | | | minden lejáratban | 1,8 | RUB | 12 600 | 50% | 12 600 |
| EUR/SEK | X | | | minden lejáratban | 0,24 | SEK | 6 000 | 50% | 6 000 |

| | | | | | | | | | |
|---------|---|---|---|-------------------|-------|-----|--------|-----|--------|
| EUR/TRY | X | | X | minden lejáratban | 0,09 | TRY | 12 600 | 50% | 12 600 |
| EUR/USD | X | X | X | minden lejáratban | 0,045 | USD | 9 000 | 50% | 9 000 |
| GBP/CHF | X | X | X | minden lejáratban | 0,058 | CHF | 8 700 | 50% | 8 700 |
| GBP/JPY | X | X | X | minden lejáratban | 6,4 | JPY | 9 600 | 50% | 9 600 |
| GBP/SEK | X | | | minden lejáratban | 0,34 | SEK | 8 500 | 50% | 8 500 |
| GBP/USD | X | X | | minden lejáratban | 0,052 | USD | 10 400 | 50% | 10 400 |
| USD/BRL | X | | | minden lejáratban | 0,10 | BRL | 10 000 | 50% | 10 000 |
| USD/CAD | X | X | X | minden lejáratban | 0,04 | CAD | 6 400 | 50% | 6 400 |
| USD/CHF | X | X | X | minden lejáratban | 0,04 | CHF | 6 000 | 50% | 6 000 |
| USD/CZK | X | | | minden lejáratban | 0,7 | CZK | 6 300 | 50% | 6 300 |
| USD/JPY | X | X | X | minden lejáratban | 4 | JPY | 6 000 | 50% | 6 000 |
| USD/MXN | X | | | minden lejáratban | 0,58 | MXN | 8 700 | 50% | 8 700 |
| USD/NOK | X | | | minden lejáratban | 0,19 | NOK | 5 700 | 50% | 5 700 |
| USD/PLN | X | | | minden lejáratban | 0,1 | PLN | 7 000 | 50% | 7 000 |
| USD/RUB | X | | | minden lejáratban | 1,3 | RUB | 9 100 | 50% | 9 100 |
| USD/SEK | X | | | minden lejáratban | 0,22 | SEK | 5 500 | 50% | 5 500 |
| USD/TRY | X | | X | minden lejáratban | 0,075 | TRY | 10 500 | 50% | 10 500 |
| USD/UAH | X | | | minden lejáratban | 0,27 | UAH | 9 400 | 50% | 9 400 |
| EUR/CSD | X | | | minden lejáratban | 3,5 | CSD | 10 500 | 50% | 10 500 |
| AUD/JPY | X | | | minden lejáratban | 3,6 | JPY | 5 500 | 50% | 5 500 |
| NZD/JPY | X | | | minden lejáratban | 3,2 | JPY | 4 800 | 50% | 4 800 |

Megjegyzés:

Kiírt opció után számított minimum fedezet minden opciós termék esetében 10%-a az alaptőzingszámításnak.

Volatilitás változás tartomány minden opciós termék esetében (+/-) 2%.

Biztosíték számítás módszere: **nettó elv**

Lejáratok közötti spread biztosíték

A lejáratok közötti spread kedvezmények EUR, USD, CHF termékeknél 80%, GBP, JPY, CZK, PLN, TRY, termékeknél 70%, a kamat és keresztkontraktusok esetében 50%.

Szállítási (delivery) hónap kiegészítő biztosíték: Nincs!

Termékek közötti spread kedvezmény:

| Sorszám | Spreadet alkotó termékek | Arány | A kedvezmény mértéke % |
|---------|--------------------------|-------|------------------------|
| 1 | EUR/USD | 4:6 | 60 % |
| 2 | USD/JPY | 1:1 | 60 % |
| 3 | EUR/CHF | 2:3 | 60 % |
| 4 | USD/CHF | 1:1 | 60 % |

Budapest, 2008. december 10.

KELER Zrt.