

K&amp;H Bank Zrt.

1095 Budapest, Lechner Ödön fasor 9.  
 telefon: (06 1/20/30/70) 335 3355  
 fax: (06 1) 328 9696  
 Budapest 1851  
 www.kh.hu • bank@kh.hu



## Havi portfólió egyeztető mezők részletezése

### Ügyletek általános adatai:

<b>EMIR rel.</b>	Az EMIR rendelet hatálya alá tartozó ügyletek jelölése	
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• YES – EMIR érintett ügylet</li> <li>• NO – Nem EMIR érintett ügylet</li> </ul>	
<b>Tr. Szám</b>	Az ügylet azonosításához használt tranzakciós szám (pl: MX 123456)	
<b>Tr. Irány</b>	A tranzakció iránya a Bank szempontjából a fődeviza összegére (Nyersanyagpiaci ügyleteknél a Fix árra) nézve	
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Vesz - Bank vesz</li> <li>• Elad - Bank elad</li> <li>• Eladási jog - a Banknak eladási joga van</li> <li>• Eladási kötelezettség - a Banknak eladási kötelezettsége van</li> <li>• Vételi jog - a Banknak vételi joga van</li> <li>• Vételi kötelezettség - a Banknak vételi kötelezettsége van</li> <li>• Fizet - a Bank fizeti Kamatláb 1-et, Nyersanyagpiaci ügyleteknél Bank fizeti a Fix árat</li> <li>• Kap - a Bank kapja Kamatláb 1-et, Nyersanyagpiaci ügyleteknél Bank kapja a Fix árat</li> </ul>	
<b>Fődeviza neve</b>	Fődeviza neve	
<b>Fődeviza összege</b>	Fődeviza összege (CS, IRS és CF esetén fennálló tőkeösszeg)	
<b>Mellékdeviza neve</b>	Mellékdeviza neve	
<b>Mellékdeviza összege</b>	Mellékdeviza összege	
<b>Kötési árfolyam</b>	A megállapodás szerinti árfolyam; a tőkekonverzióhoz használt árfolyam CS esetén	
<b>Lejárat</b>	A tranzakció lejárat dátuma, devizaopció esetében az árfolyamfigyelés napja a kötési árfolyamra vonatkozó feltétel tekintetében (a pontos napon belüli időpont piaci konvenciók alapján kerül meghatározásra)	
<b>Swaption lejáratok:</b>		
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Opció lejárat</li> </ul>	Swaption (Kamatcsere opció) opciós részének lejárat
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• IRS indulása</li> </ul>	Swaption-ba (Kamatcsere opcióba) ágyazott IRS ügylet induló dátuma
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• IRS lejárat</li> </ul>	Swaption-ba (Kamatcsere opcióba) ágyazott IRS ügylet lejárat dátuma
<b>Elszámolás</b>	A tranzakció elszámolási dátuma (pénzügyi teljesítés napja)	
<b>Tranzakció csoport</b>	A Bankkal bonyolított tranzakció besorolása	
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• FXD Devizakonverzió</li> <li>• OPT Devizaopció</li> </ul>	

	<ul style="list-style-type: none"> <li>• CS Kétdevizás kamatlábcseré ügylet</li> </ul>	
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• IRS Kamatlábcseré ügylet, Nyersanyagpiaci csereügylet</li> </ul>	
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• CF Kamatopciós ügylet, Nyersanyagpiaci opciós ügylet</li> </ul>	
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• SW Swaption: Kamatcsere opció</li> </ul>	
<b>Tranzakció típus</b>	A tranzakció csoporton belüli további besorolása	
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• XSW Devizacsere ügylet (swap)</li> </ul>	
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• SMP Egyszerű devizaopció</li> </ul>	
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• BAR Limitáras (barrier) devizaopció</li> </ul>	
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• C Cap (Kamatplafon) opció, Nyersanyagpiaci vételi opció</li> </ul>	
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• F Floor (Kamatküszöb) opció, Nyersanyagpiaci eladási opció</li> </ul>	
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• BC Barrier Cap opció: Limitáras Kamatplafon opció</li> </ul>	
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• BF Barrier Floor opció: Limitáras Kamatküszöb opció</li> </ul>	
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• PSW Payer Swaption: Fix kamatfizetést generáló kamatcsere opció</li> </ul>	
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• RSW Receiver Swaption: Változó kamatfizetést generáló kamatcsere opció</li> </ul>	
<b>Elszámolás típusa</b>	Delivery Elszámolás leszállítással	
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Cash, ECB</li> </ul>	Elszámolás nettó módon az ECB fixing árfolyammal szemben
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Cash, MNB</li> </ul>	Elszámolás nettó módon az MNB fixing árfolyammal szemben
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Cash, SW</li> </ul>	Elszámolás nettó módon swaption esetén
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• IRS SW</li> </ul>	Mögöttes IRS ügylet megkezdése swaption esetén
<b>Limitár szintje</b>	Limitár árfolyama vagy kamatszintje	
<b>Limitár megfigyelése</b>	Limitár megfigyelési ideje (Egy dátum egy adott napot, két dátum a megfigyelési idő kezdőnapját és utolsó napját jelenti. A napon belüli pontos időpontok a piaci konvencióknak megfelelően alakulnak.)	
<b>Limitár iránya</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Down and In -</li> </ul>	a Limitár szintje vagy az alatti szint esetén az opció életbe lép
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Down and Out -</li> </ul>	a Limitár szintje vagy az alatti szint esetén az opció megszűnik
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Up and In -</li> </ul>	a Limitár szintje vagy afeletti szint esetén az opció életbe lép
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Up and Out -</li> </ul>	a Limitár szintje vagy afeletti szint esetén az opció megszűnik
<b>Kamatláb 1.</b>	IRS-nél a Bank által fizetett/kapott kamatláb, CS-nél a Bank által fizetett/kapott Fődeviza kamatláb, Cap/Floor opciónál a rögzített (fix) opciós kamatláb, p.a.% ;	
	Swaption-nál a swaption kötési árfolyama, a fix kamatláb, p.a.%	
<b>Kamatláb 2.</b>	IRS-nél az Ügyfél által fizetett/kapott kamatláb, CS-nél az Ügyfél által fizetett/kapott Mellékdeviza kamatláb, Cap/Floor opciónál a változó kamatláb, p.a.% ; Swaption-nál a változó kamatláb, p.a.%	
<b>Kamatperiódus eleje</b>	A kamatperiódus első napja	
<b>Kamatperiódus vége</b>	A kamatperiódus utolsó napja	
<b>Kamatkonvenció</b>	A kamatperiódusokra eső kamat számításának módja (a kamatperiódusra vonatkozó hivatalos fixing kamatláb meghatározásának dátuma a piaci	

	konvencióknak megfelelően alakul)
<b>Fődeviza fennálló névérték</b>	A fennálló névérték a fődeviza nemében kifejezve az adott kamatperiódusra vonatkozóan
<b>Mellékdeviza fennálló névérték</b>	A fennálló névérték a mellékdeviza nemében kifejezve az adott kamatperiódusra vonatkozóan
<b>Piaci érték</b>	A tranzakciók vonatkozási dátumon érvényes piaci árfolyamokon számított diszkontált értéke (jelenértéke) a treasury limit devizanemében. A tranzakciók jelenértékének limitdevizanemére való konverziója a vonatkozási dátumon érvényes MNB deviza középárfolyamon történik, amely értéke egész száma kerekítve van feltüntetve.

**Profitmaximalizált határidős ügyletek adatai:**

<b>Lejáratok száma üzletkötéskor</b>	Összesen hány lejáratral rendelkezik az ügylet a kötés pillanatában
<b>Hátralévő lejáratok száma</b>	Hány lejárat van még hátra a riport pillanatában
<b>Változó árfolyam</b>	A különböző lejáratok esetében egyforma vagy különböző az árfolyam
<b>Változó Fődeviza összeg</b>	A különböző lejáratok esetében egyforma vagy különböző a kötési összeg a fődeviza nemében kifejezve
<b>Profitmaximum üzletkötéskor (mellékdeviza/egys. fődeviza)</b>	Az a nyereségmaximum, amelynek elérésekor az ügylet megszűnik
<b>Elérhető profitmaximum (mellékdeviza/egys. fődeviza)</b>	Az a nyereségmaximum, ami még elérhető az ügyletben
<b>Elszám. devizanem</b>	Az elszámolás devizaneme
<b>Profitmax. kalk.</b>	A nyereségmaximum kalkulálásának módja: <ul style="list-style-type: none"> <li>• P&amp;L leveraged - a nyereség és veszteség kumulálása tőkeáttétellel</li> <li>• P&amp;L unleveraged - a nyereség és veszteség kumulálása tőkeáttétel nélkül</li> <li>• Profit only - csak a nyereség kerül kumulálásra</li> </ul>
<b>Típus</b>	EXACT TARN: Pontos nyereségmaximumos profitmaximalizált határidős ügylet
	TARGET KO FWD: Normál nyereségmaximumos profitmaximalizált határidős ügylet
	TARGET INCL KO FWD: Profitmaximalizált határidős ügylet teljes kifizetésű utolsó lejáratral
	TGT KO FWD w GUARANTIE: Profitmaximalizált határidős ügylet garanciával
	DIGI TGT PROFIT DEAL: Digitális profitmaximalizált határidős ügylet
	TARGET KO FWD w ERKI: Profitmaximalizált határidős ügylet belépési szinttel
<b>Garantált elszám.</b>	Garantált elszámolások száma (csak a "TGT KO FWD w GUARANTIE" esetében)
<b>Digitális elszám.</b>	Nyereséges elszámolások maximális száma (csak a "DIGI TGT PROFIT DEAL" esetében)

**Nyersanyagpiaci ügyletek adatai:**

<b>Nyersanyag megnevezése</b>	A nyersanyag megnevezése
<b>Nyersanyag kontraktus</b>	A nyersanyag banki kódja, a kontraktus mértékegysége és devizaneme
<b>Nyersanyag mennyiség</b>	A kontraktus mennyisége a kontraktus mértékegységében kifejezve
<b>Kontraktus teljes értéke</b>	A nyersanyag mennyiségének és a fix árnak a szorzata
<b>Fix ár</b>	A kötési ár
<b>Referencia index</b>	A referenciaár (változó ár) meghatározásához szükséges tőzsdei index
<b>Referencia ár</b>	A referencia ár (változó ár) meghatározásának szabálya
<b>Kerekítési szabály</b>	Referencia ár kerekítési szabálya
<b>Referencia periódus eleje</b>	A referencia ár (változó ár) vizsgálati periódusának első napja
<b>Referencia periódus vége</b>	A referencia ár (változó ár) vizsgálati periódusának utolsó napja

<b>A teljes portfólió piaci értéke</b>	Az összes tranzakció piaci értékének összessége
<b>EMIR érintett ügyletek piaci értéke összesen</b>	Azon tranzakciók piaci értékének összessége, melyek az EMIR rendelet hatálya alá tartoznak

A piaci érték a Bank által egy adott időpillanatban elérhető piaci adatforrások közlései alapján, középárfolyamok és banki belső modellek figyelembe vételével került kiszámításra és **a Bank irányából nézve kerül kimutatásra**. Ez egy indikatív érték, amely azt jelenti, hogy amennyiben ez az érték pozitív, akkor az Ügyfélnek kell nagyságrendileg ekkora összeget fizetnie a Bank számára, ha a pozíciók a riport elkészítésének pillanatában középárfolyamokon, a Bank által alkalmazott modellek alapján számítva lezárásra és azonnali elszámolásra kerülnének. Ha ez az érték negatív, akkor a Banknak kell nagyságrendileg ekkora összeget fizetnie az Ügyfél számára, ha a pozíciók a kimutatás készítésének pillanatában középárfolyamokon, a Bank által alkalmazott modellek alapján számítva lezárásra és azonnali elszámolásra kerülnének. A Bank által alkalmazotttól eltérő árfolyam és/vagy algoritmusok alkalmazása más jelenérték adatokat eredményezhet. Az utolsó oszlop a tranzakciók jelenértékét tételesen mutatja. Felhívjuk a figyelmét, hogy a pozíciók tényleges lezárása és azonnali elszámolása esetén az Ügyfél által fizetett/kapott összeg a Bank által közölt indikatív értéktől jelentősen eltérhet, mivel azt lezárás esetén a tényleges piaci viszonyok alapján kialakuló vételi-eladási árak határozzák meg. Amennyiben további információra lenne szüksége, a K&H Piaci Igazgatóság munkatársa örömmel áll rendelkezésére. Kérjük, hogy a portfólió egyeztetőben lévő adatok helyességét ellenőrizni szíveskedjen. Amennyiben eltérést észlel, kérjük juttassa el észrevételeit a következő elérhetőségre: K&H Bank Zrt, Piaci Igazgatóság, 1095 Budapest, Lechner Ödön fasor 9. E-mail: TreasurySales@kh.hu