



KIEGÉSZÍTŐ HIRDETMÉNY

az OTP Bank Nyrt. Regionális Treasury Igazgatóságának Értékesítési Üzletszabályzatához¹

**Az egyes Treasury Szolgáltatásoknál a biztosított követelés
ügyletkötés napi összegéről, illetve az alapbiztosíték mértékéről,
a fedezetbe foglalható Biztosítékok listájáról és azok befogadási
értékéről**

Hatályos: 2020. február 05. napjától

Közzétéve: 2020. február 05. napján

OTP Bank Nyrt.

Székhelye: 1051 Budapest, Nádor utca 16.

Nyilvántartásba vette a Fővárosi Törvényszék Cégbírósága a 01-10-041585. cégjegyzékszámom

LEI: 529900W3MOO00A18X956.

Központi postacím: 1876 Budapest

Honlap: <http://www.otpbank.hu>

¹A jelen Kiegészítő Hirdetmény módosítására az OTP Bank Nyrt. Regionális Treasury Igazgatóságának Értékesítési Üzletszabályzata A.II.16.6. pontja alapján az Üzletfél számára nem kedvezőtlen módon kerül sor. A jelen Kiegészítő Hirdetmény módosítását az Üzletszabályzat B.III.3. pontjában foglalt új szolgáltatás (deviza csereügylet) bevezetése indokolja.

I. Egyes tőzsdén kívüli származtatott ügyletek

I.A. Alapelvek

1. Az I.B. pontban felsorolt tőzsdén kívüli származtatott ügyleteknél – amennyiben az Üzletszabályzat, az Üzletféllel kötött Keretszerződés vagy Külön szerződés, Egyedi Szerződés, vagy az Egyedi Ügylet eltérően nem rendelkezik – az Üzletfél mindenkor köteles

- a. az Egyedi Ügylet OTP Bank Nyrt. által megválasztott módszertan szerinti értékelése alapján kalkulált értékét (biztosított követelés összege),
- b. az OTP Bank Nyrt. által elfogadott mértékben (óvadék mennyisége),
- c. az OTP Bank Nyrt. által elfogadott Biztosítókkal (óvadék fajtája)

fedezni.

Az 1.a. pont szerinti kalkulált érték azonos a Ptk. szerinti biztosított követeléssel („**Biztosított követelés**”). A Biztosított követelés ügyletkötés időpontjára megállapított összegét Treasury Szolgáltatásként az I.B. pont tartalmazza. Ennek az összegnek a devizaneme az Egyedi Ügylettől függ az I.B. pontban részletezett módon. Amennyiben a Biztosított követelés összege forint (HUF) devizanemtől eltérő devizanemben kerül megállapításra, a Biztosított követelés forintban (HUF) fennálló összege minden értékeléskor, azaz minden banki munkanapon, napon belüli értékelés esetében akár napon belül is, az aktuális OTP középárfolyam alapján kerül megállapításra, így az aktuális árfolyam alapján változik a forintban (HUF devizanemben) kifejezett összege. A Biztosított követelés összege továbbá naponta, de akár napon belül is változhat az Egyedi Ügylet értékelésének eredményétől, az aktuális devizaárfolyam alakulásától és az Üzletszabályzatban rögzített egyéb körülményektől függően az Üzletszabályzatban és „Az egyes tőzsdén kívüli származtatott Egyedi Ügyletek változó letét igény mértékének számításáról és a biztosított követelés összegének változását meghatározó feltételekről” szóló tájékoztató hirdetményben rögzítettek szerint. A Biztosított követelés összegének, továbbá forintban (HUF) kifejezett összegének változása esetén az OTP Bank Nyrt. – az ügyletkötés időpontját követően, de akár már az ügyletkötés napján – jogosult kiegészítő biztosítékot (változó letétet) bekérni az Üzletféltől, aki azt köteles nyújtani.

2. Az Üzletfél az 1.b. pontban rögzítettek alapján legalább a Biztosított követelés I. B. pont szerinti értékének 100%-át köteles Biztosítókkal fedezni kivéve, ha az I.B. pont eltérően rendelkezik.

3. Az Üzletfél az 1.c. pontban rögzítettek alapján az Üzletszabályzatban és az 1. számú mellékletben meghatározott Biztosítékot köteles a Biztosított Követelés fedezeteként biztosítani. A Biztosítékot a fedezettség megállapításánál az OTP Bank Nyrt. az 1. számú mellékletben meghatározott befogadási értéken veszi figyelembe. A devizafedezetek forintértékének meghatározásakor az OTP Bank Nyrt. az aktuális, utolsó OTP középárfolyammal számol.

Az Egyedi Ügyletek vonatkozásában az Egyedi Ügylet megkötésének időpontjában hatályos Kiegészítő hirdetmény rendelkezései irányadóak, továbbá alkalmazandók

a Kiegészítő hirdetmény rendelkezéseinek azon módosításai, melyek kiterjednek a már fennálló Egyedi Ügyletre is. A Kiegészítő hirdetmény korábbi hatályos dokumentumai elérhetőek a www.otpbank.hu honlap Treasury aloldalán az üzletszabályzatok menüpont alatt:

<https://www.otpbank.hu/portal/hu/Kondiciok/Vallalat/USZ>

I.B. A Tőzsdén kívüli származtatott ügyleteknél a Biztosított követelés ügyletkötés időpontjára megállapított összege és az alapbiztosíték mértéke

- Határidős Deviza Adásvételre** vonatkozó Egyedi Ügylet esetében a Biztosított követelés összege az ügyletkötés napján azonos az alapbiztosíték ügyletkötés időpontjára kalkulált mértékével. Az alapbiztosíték ügyletkötés időpontjára kalkulált mértéke egyenlő az Üzletfél OTP Bank felé teljesítendő, Egyedi Ügyletben megállapításra kerülő kötelezettsége Egyedi Ügyletben rögzített pénznemben (devizanemben) kifejezett összegének (a jelen Kiegészítő hirdetmény alkalmazásában: **Egyedi Ügylet Névértéke**) alábbi táblázat szerinti százalékkal:

FX FWD														
	EUR	CHF	GBP	DKK	NOK	SEK	AUD	CAD	USD	JPY	HUF	CZK	PLN	UAH
EUR														
CHF	6%													
GBP	14%	16%												
DKK	2%	6%	12%											
NOK	4.50%	6%	12%	5%										
SEK	4%	6%	12%	4%	4.50%									
AUD	5%	6%	14%	5%	5%	5.50%								
CAD	5%	6%	14%	6%	5%	5.50%	5%							
USD	6%	6%	14%	6%	6%	5.50%	5%	4.50%						
JPY	6%	6%	16%	6%	7%	7.50%	7.50%	7.50%	7.50%					
HUF	4%	6%	12%	4%	5%	4.50%	6%	6%	6%	6%				
CZK	3%	5%	12%	3%	4%	3.50%	5%	5%	5%	5%	3%			
PLN	4%	6%	12%	4%	5%	4.50%	6%	6%	6%	6%	3.25%	3%		
BGN	1%	6%	12%			4.00%			5%		3.25%			
HRK	3%	6%	12%						5%	6%	3%			
RON	4%	6%	12%						6%		4%			
RSD	3%	6%	12%						6%		3%			
RUB	11%	11%	22%						11%		11%			13%
UAH	11%	11%	30%						11%		11%			
BRL	20%	20%							20%	20%	20%			
CNY	6%								5%	6%	6%			
TRY	30%	30%				30%			30%	30%	30%		30%	
KRW									5.50%					
ILS							6.00%							
NZD	6%													
ALL	3%	6%	12%						6%		9%			

A Deviza Határidős Adásvételi Egyedi Ügyletek esetében az alapbiztosíték devizaneme az ügyletkötéskor megállapított ún. rögzített deviza (az a deviza, amelyre a másik deviza mennyiségét az árfolyam segítségével kiszámítjuk), amely lehet devizapár első vagy második devizája is.

Amennyiben a Deviza Határidős Adásvételi Egyedi Ügyletek esetében rögzített (fixált) pénznem nem a forint (HUF), az alapbiztosíték devizában kalkulált összegének forintban kifejezett értéke minden értékeléskor, azaz minden banki munkanapon, napon belüli értékelés esetében akár napon belül is, az aktuális OTP középárfolyam alapján kerül megállapításra, így az aktuális árfolyam alapján változik a forintban (HUF devizanemben) kifejezett összege.

Alapbiztosítéki igényt az OTP Bank Nyrt. – a fenti számítás alkalmazásával – a Deviza Határidős Adásvételi Egyedi Ügyletek összességére a következő módszerrel állapítja meg: alapbiztosítéki igény a nyitott pozíciót eredményező Deviza Határidős Adásvételi Egyedi Ügyletek, illetve az Egyedi Ügylet lezárt pozíciót nem eredményező része (részben nyitott pozíció) tekintetében keletkezik, a lezárt pozíciót eredményező Egyedi Ügyletnek, valamint az Egyedi Ügylet lezárt pozíciót eredményező részének (részben lezárt pozíció) nincs alapbiztosítéki igénye. Lezárt vagy részben lezárt pozíciót eredményező Egyedi Ügyletnek minősül az egy vagy több megkötött Egyedi Ügylettel ellentétes irányú, azonban a rögzített (fixált) devizát, a devizapárt és a lejáratot illetően megegyező Egyedi Ügylet, minden egyéb Egyedi Ügylet nyitott vagy részben nyitott pozíciót eredményez. Lezárt vagy részben lezárt pozíció **Határidős Deviza Adásvételre** és **Deviza Csereügyletre** (2. pont) vonatkozó Egyedi Ügyletek társításából is származhat, ha a fenti kritériumoknak megfelel.

2. **Deviza Csereügyletre** vonatkozó Egyedi Ügylet esetében a Biztosított követelés összege az ügyletkötés napján megegyezik az azonos paraméterekkel rendelkező **Határidős Deviza Adásvételi** ügyletre vonatkozó alapbiztosíték mértékével.
3. **Határidős Nemesfém (arany és ezüst) Adásvételre** vonatkozó, nem szállítási Egyedi Ügylet esetében a Biztosított követelés összege az ügyletkötés napján azonos az alapbiztosíték ügyletkötés időpontjára kalkulált mértékével. Az alapbiztosíték ügyletkötés időpontjára kalkulált mértéke egyenlő az Üzletfél OTP Bank felé teljesítendő, Egyedi Ügyletben megállapításra kerülő kötelezettsége Egyedi Ügyletben rögzített pénznemben (devizanemben) kifejezett összegének (a jelen Kiegészítő hirdetés alkalmazásában: **Egyedi Ügylet Névértéke**) alábbi táblázat szerinti százalékaival:

	NDF	
	USD	EUR
XAU	8%	8%
XAG	13%	13%

A Határidős Nemesfém (arany és ezüst) Adásvételi Egyedi Ügyletek esetében az alapbiztosíték devizaneme az ügyletben szereplő EUR vagy USD összege.

Mivel a Határidős Nemesfém (arany és ezüst) Adásvételi Egyedi Ügyletek esetében rögzített (fixált) pénznem nem a forint (HUF), az alapbiztosíték devizában kalkulált összegének forintban kifejezett értéke minden értékeléskor, azaz minden banki munkanapon, napon belüli értékelés esetében akár napon belül is, az aktuális OTP középárfolyam alapján kerül megállapításra, így az aktuális árfolyam alapján változik a forintban (HUF devizanemben) kifejezett összege.

4. Az **egydevizás Kamatcsere Ügyletre** (IRS) vonatkozó Egyedi Ügylet esetében a Biztosított követelés összege az ügyletkötés napján azonos az alapbiztosíték ügyletkötés időpontjára kalkulált mértékével, amely az Egyedi Ügylet Kötési Értékének (Névértékének) az alábbi táblázat szerinti százaléka:

	IRS
--	-----

Hátralévő futamidő (év)	HUF	USD	EUR	CHF	JPY	RUB	RON	Egyéb
<=1	0.30%	0.30%	0.20%	0.20%	0.20%	0.80%	0.50%	0.80%
1< <=3	1.40%	0.90%	0.40%	0.50%	0.20%	1.90%	1.30%	1.90%
3< <=5	2.10%	1.60%	0.90%	0.90%	0.50%	3.10%	2.20%	3.10%
5< <=10	3.00%	2.30%	2.10%	1.30%	0.70%	5.25%	3.50%	5.25%
10< <=15	4.70%	3.30%	3.50%	2.00%	1.10%	6.50%	5.60%	6.50%
15< <=20	9.00%	6.10%	5.30%	4.80%	2.50%			

Az egydevizás Kamatcsere Egyedi Ügyletek esetében az alapbiztosíték devizaneme az ügylet devizája.

Amennyiben az egydevizás Kamatcsere Egyedi Ügyletek esetében az alapbiztosíték devizaneme nem a forint (HUF), az alapbiztosíték devizában kalkulált összegének forintban kifejezett értéke minden értékeléskor, azaz minden banki munkanapon, napon belüli értékelés esetében akár napon belül is, az aktuális OTP középárfolyam alapján kerül megállapításra, így az aktuális árfolyam alapján változik a forintban (HUF devizanemben) kifejezett összege.

5. A **kétdevizás Kamatcsere Ügyletre** (CIRS) vonatkozó Egyedi Ügylet esetében a Biztosított követelés összege az ügyletkötés napján azonos az alapbiztosíték ügyletkötés időpontjára kalkulált mértékével, amely az Egyedi Ügylet második devizája Névértékének alábbi táblázat szerinti százaléka:

Hátralévő futamidő (év)	EURHUF			
	fixed to fixed	EUR fixed to HUF floating	EUR floating to HUF fixed	floating to floating
<=1	4.30%	4.20%	4.30%	4.20%
1< <3	5.40%	4.50%	5.50%	4.40%
3<= <5	6.30%	5.00%	6.40%	4.60%
5<= <7	7.80%	6.00%	7.50%	4.80%
7<= <12	10.20%	7.50%	9.20%	5.20%
12<= <20	17.00%	12.00%	14.00%	8.00%

Hátralévő futamidő (év)	EURUSD			
	fixed to fixed	EUR fixed to USD floating	EUR floating to USD fixed	floating to floating
<=1	6.30%	6.20%	6.30%	6.10%
1< <3	6.80%	6.50%	7.00%	6.30%
3<= <5	7.40%	7.10%	7.60%	6.40%
5<= <7	9.00%	7.70%	8.20%	6.50%
7<= <12	11.00%	8.70%	9.20%	6.70%
12<= <20	16.80%	13.20%	13.00%	9.00%

	USDHUF

Hátralévő futamidő (év)	fixed to fixed	USD fixed to HUF floating	USD floating to HUF fixed	floating to floating
<=1	6.40%	6.30%	6.40%	6.20%
1 < 3	7.50%	6.90%	7.60%	6.40%
3 <= 5	8.40%	7.50%	8.60%	6.50%
5 <= 7	9.30%	8.10%	9.60%	6.80%
7 <= 12	11.50%	9.10%	11.40%	7.30%
12 <= 20	18.00%	14.50%	17.00%	10.50%

Hátralévő futamidő (év)	USDRUB			
	fixed to fixed	USD fixed to RUB floating	USD floating to RUB fixed	floating to floating
<=1	13.00%	12.00%	13.00%	12.20%
1 < 3	16.00%	14.00%	15.00%	13.20%
3 <= 5	18.00%	15.00%	16.50%	13.50%
5 <= 7	21.00%	16.00%	19.00%	13.80%
7 <= 12	23.80%	17.00%	20.50%	14.00%
12 <= 20	32.50%	22.00%	29.00%	21.00%

A kétdevizás Kamatcsere Egyedi Ügyletek esetében az alapbiztosíték devizaneme az Egyedi Ügylet második devizája.

Amennyiben a kétdevizás Kamatcsere Egyedi Ügyletek esetében az alapbiztosíték devizaneme nem a forint (HUF), az alapbiztosíték devizában kalkulált összegének forintban kifejezett értéke minden értékeléskor, azaz minden banki munkanapon, napon belüli értékelés esetében akár napon belül is, az aktuális OTP középárfolyam alapján kerül megállapításra, így az aktuális árfolyam alapján változik a forintban (HUF devizanemben) kifejezett összege.

6. Kamat Opció Ügyletre vonatkozó Egyedi Ügylet esetében

- a Biztosított követelés ügyletkötés időpontjára kalkulált összege azonos az Egyedi Ügylet Kötési Értékével (Névértékével),
- az alapbiztosíték ügyletkötés időpontjára megállapított mértéke és a Biztosított követelésnek az a része, amelyet az Üzletfél az ügyletkötés időpontjában Biztosítékkal köteles fedezni egyedileg, az Üzletféllel megkötésre kerülő Egyedi Ügyletre vonatkozó szerződésben kerül megállapításra,
- a Kamatopciós Egyedi Ügyletek esetében az alapbiztosíték devizaneme az ügylet devizája,
- amennyiben a Kamatopciós Egyedi Ügyletek esetében az alapbiztosíték devizaneme nem a forint (HUF), az alapbiztosíték devizában kalkulált összegének forintban kifejezett értéke minden értékeléskor, azaz minden banki munkanapon, napon belüli értékelés esetében akár napon belül is, az aktuális OTP középárfolyam alapján kerül megállapításra, így az aktuális árfolyam alapján változik a forintban (HUF devizanemben) kifejezett összege.

7. Deviza Opció Ügyletre vonatkozó Egyedi Ügylet esetében

7/A. Európai típusú **Egyszerű (Plain Vanilla) Opció** kötésekor a Biztosított követelés összege az ügyletkötés napján azonos az alapbiztosíték ügyletkötés

időpontjára kalkulált mértékével, amely az Egyedi Ügylet kötési (strike) árfolyamon számolt Névértékének az alábbi táblázat szerinti százaléka:

	delta											
	delta < 5%		5% <= delta <= 15%		15% < delta <= 35%		35% < delta <= 65%		65% < delta <= 85%		85% < delta	
	call	put	call	put	call	put	call	put	call	put	call	put
AUDJPY												
T<=1W	4.20%	3.60%	4.60%	4.00%	5.30%	4.90%	5.80%	5.50%	5.90%	5.80%	5.90%	5.80%
1W<T<3M	4.20%	3.60%	4.60%	4.00%	5.40%	4.90%	6.05%	5.50%	6.60%	5.80%	6.95%	5.80%
3M<=T<6M	4.20%	3.60%	4.60%	4.00%	5.40%	4.90%	5.95%	5.50%	6.60%	5.80%	7.10%	5.80%
6M<=T<1Y	4.20%	3.60%	4.60%	4.00%	5.60%	5.00%	7.20%	6.20%	7.40%	6.70%	7.40%	6.60%
1Y<=T<2Y	4.20%	3.60%	4.60%	4.00%	6.40%	5.30%	7.40%	6.20%	7.40%	6.70%	7.40%	6.60%
2Y	4.20%	3.60%	4.60%	4.00%	6.40%	5.30%	7.40%	6.20%	7.40%	6.70%	7.40%	6.60%
AUDUSD												
T<=1W	1.50%	1.40%	1.70%	1.60%	2.20%	2.10%	2.70%	2.60%	2.90%	2.80%	2.90%	2.90%
1W<T<3M	2.45%	2.25%	3.05%	2.80%	4.00%	3.75%	4.80%	4.40%	4.90%	4.65%	4.90%	4.65%
3M<=T<6M	2.45%	2.25%	3.05%	2.80%	4.00%	3.75%	4.80%	4.40%	4.90%	4.65%	4.90%	4.65%
6M<=T<1Y	2.45%	2.25%	3.05%	2.80%	4.00%	3.75%	4.80%	4.40%	4.90%	4.65%	4.90%	4.65%
1Y<=T<2Y	2.45%	2.25%	3.05%	2.80%	4.00%	3.75%	4.80%	4.40%	4.90%	4.65%	4.90%	4.65%
2Y	2.45%	2.25%	3.05%	2.80%	4.00%	3.75%	4.80%	4.40%	4.90%	4.65%	4.90%	4.65%
CHFHUF												
T<=1W	2.30%	2.70%	2.60%	2.90%	3.30%	3.30%	3.80%	3.70%	3.90%	3.80%	3.90%	3.90%
1W<T<3M	3.05%	3.80%	3.70%	4.30%	4.95%	4.85%	5.70%	5.10%	5.90%	5.20%	5.90%	5.10%
3M<=T<6M	3.05%	3.80%	3.70%	4.30%	4.95%	4.85%	5.70%	5.10%	5.90%	5.20%	5.90%	5.10%
6M<=T<1Y	3.05%	3.80%	3.70%	4.30%	4.95%	4.85%	5.80%	5.10%	5.90%	5.30%	5.90%	5.20%
1Y<=T<2Y	3.05%	3.80%	3.70%	4.30%	4.95%	4.85%	5.90%	5.10%	5.90%	5.30%	5.90%	5.20%
2Y	3.05%	3.80%	3.70%	4.30%	4.95%	4.85%	5.90%	5.10%	5.90%	5.30%	5.90%	5.20%
CHFJPY												
T<=1W	2.60%	2.40%	2.90%	2.70%	3.50%	3.30%	3.80%	3.70%	3.90%	3.90%	3.90%	3.90%
1W<T<3M	3.00%	2.55%	3.55%	3.10%	4.45%	4.05%	5.05%	4.55%	5.35%	4.75%	5.55%	4.75%
3M<=T<6M	3.00%	2.55%	3.55%	3.10%	4.45%	4.05%	5.05%	4.55%	5.35%	4.75%	5.60%	4.75%
6M<=T<1Y	3.00%	2.55%	3.55%	3.10%	4.45%	4.05%	5.70%	5.10%	5.90%	5.40%	5.90%	5.40%
1Y<=T<2Y	3.00%	2.55%	3.55%	3.10%	4.45%	4.05%	5.90%	5.10%	5.90%	5.40%	5.90%	5.40%
2Y	3.00%	2.55%	3.55%	3.10%	4.45%	4.05%	5.90%	5.10%	5.90%	5.40%	5.90%	5.40%
EURAUD												
T<=1W	2.40%	2.40%	2.70%	2.70%	3.30%	3.20%	3.80%	3.60%	3.90%	3.80%	3.90%	3.90%
1W<T<3M	2.60%	2.75%	3.20%	3.30%	4.25%	4.10%	4.90%	4.50%	4.90%	4.70%	4.90%	4.65%
3M<=T<6M	2.60%	2.75%	3.20%	3.30%	4.25%	4.10%	4.90%	4.50%	4.90%	4.70%	4.90%	4.65%
6M<=T<1Y	2.60%	2.75%	3.20%	3.30%	4.25%	4.10%	4.90%	4.50%	4.90%	4.70%	4.90%	4.65%
1Y<=T<2Y	2.60%	2.75%	3.20%	3.30%	4.25%	4.10%	4.90%	4.50%	4.90%	4.70%	4.90%	4.65%
2Y	2.60%	2.75%	3.20%	3.30%	4.25%	4.10%	4.90%	4.50%	4.90%	4.70%	4.90%	4.65%
EURCAD												
T<=1W	2.60%	2.50%	2.90%	2.90%	3.40%	3.30%	3.80%	3.60%	3.90%	3.80%	3.90%	3.90%
1W<T<3M	2.70%	2.65%	3.25%	3.15%	4.20%	4.00%	4.90%	4.55%	4.90%	4.70%	4.90%	4.70%
3M<=T<6M	2.70%	2.65%	3.25%	3.15%	4.20%	4.00%	4.90%	4.55%	4.90%	4.70%	4.90%	4.70%
6M<=T<1Y	2.70%	2.65%	3.25%	3.15%	4.20%	4.00%	4.90%	4.55%	4.90%	4.70%	4.90%	4.70%
1Y<=T<2Y	2.70%	2.65%	3.25%	3.15%	4.20%	4.00%	4.90%	4.55%	4.90%	4.70%	4.90%	4.70%
2Y	2.70%	2.65%	3.25%	3.15%	4.20%	4.00%	4.90%	4.55%	4.90%	4.70%	4.90%	4.70%
EURCHF												
T<=1W	2.00%	1.70%	2.20%	2.00%	2.50%	2.40%	2.80%	2.70%	2.90%	2.90%	2.90%	2.90%
1W<T<3M	3.80%	3.15%	4.30%	3.65%	5.10%	4.60%	5.60%	5.15%	5.90%	5.30%	5.90%	5.25%
3M<=T<6M	3.80%	3.15%	4.30%	3.65%	5.10%	4.60%	5.60%	5.15%	5.90%	5.30%	5.90%	5.25%
6M<=T<1Y	3.80%	3.15%	4.30%	3.65%	5.10%	4.60%	5.70%	5.20%	5.90%	5.50%	5.90%	5.60%
1Y<=T<2Y	3.80%	3.15%	4.30%	3.65%	5.40%	4.60%	5.90%	5.30%	5.90%	5.50%	5.90%	5.60%
2Y	3.80%	3.15%	4.30%	3.65%	5.40%	4.60%	5.90%	5.30%	5.90%	5.50%	5.90%	5.60%

Jelmagyarázat: Y:year/év, M:month/hónap, W:week/hét, T:futamidő
1 hét=7 naptári nap, 1 hónap=30 naptári nap, 1 év=365 naptári nap

	delta												
	delta < 5%		5% <= delta <= 15%		15% < delta <= 35%		35% < delta <= 65%		65% < delta <= 85%		85% < delta		
	call	put	call	put	call	put	call	put	call	put	call	put	
EURCZK													
T<=1W	1.00%	1.10%	1.20%	1.20%	1.60%	1.60%	1.90%	1.80%	1.90%	1.90%	1.90%	1.90%	
1W<T<3M	1.00%	1.15%	1.20%	1.40%	1.85%	1.95%	2.35%	2.25%	2.55%	2.35%	2.60%	2.35%	
3M<=T<6M	1.00%	1.15%	1.20%	1.40%	1.85%	1.95%	2.35%	2.25%	2.55%	2.35%	2.60%	2.35%	
6M<=T<1Y	1.00%	1.15%	1.20%	1.40%	1.85%	1.95%	2.60%	2.50%	2.90%	2.70%	2.90%	2.70%	
1Y<=T<2Y	1.00%	1.15%	1.20%	1.40%	1.90%	2.00%	2.70%	2.50%	2.90%	2.70%	2.90%	2.70%	
2Y	1.00%	1.15%	1.20%	1.40%	1.90%	2.00%	2.70%	2.50%	2.90%	2.70%	2.90%	2.70%	
EURGBP													
T<=1W	6.50%	6.20%	6.90%	6.60%	7.70%	7.10%	7.90%	7.50%	7.90%	7.80%	7.90%	7.80%	
1W<T<3M	11.20%	10.90%	12.50%	11.70%	13.90%	12.75%	13.90%	13.15%	13.90%	13.05%	13.90%	12.80%	
3M<=T<6M	11.20%	10.90%	12.50%	11.70%	13.90%	12.75%	13.90%	13.15%	13.90%	13.05%	13.90%	12.80%	
6M<=T<1Y	11.20%	10.90%	12.50%	11.70%	13.90%	12.75%	13.90%	13.15%	13.90%	13.05%	13.90%	12.80%	
1Y<=T<2Y	11.20%	10.90%	12.50%	11.70%	13.90%	12.75%	13.90%	13.15%	13.90%	13.05%	13.90%	12.80%	
2Y	11.20%	10.90%	12.50%	11.70%	13.90%	12.75%	13.90%	13.15%	13.90%	13.05%	13.90%	12.80%	
EURHUF													
T<=1W	1.70%	2.00%	2.00%	2.20%	2.50%	2.50%	2.80%	2.70%	2.90%	2.90%	2.90%	2.90%	
1W<T<3M	1.70%	2.05%	2.05%	2.40%	2.90%	2.95%	3.45%	3.25%	3.70%	3.35%	3.75%	3.35%	
3M<=T<6M	1.70%	2.05%	2.05%	2.40%	2.90%	2.95%	3.45%	3.25%	3.70%	3.35%	3.80%	3.35%	
6M<=T<1Y	1.70%	2.05%	2.05%	2.40%	2.90%	2.95%	3.80%	3.40%	3.90%	3.60%	3.90%	3.60%	
1Y<=T<2Y	1.70%	2.05%	2.05%	2.40%	2.90%	2.95%	3.80%	3.40%	3.90%	3.60%	3.90%	3.60%	
2Y	1.70%	2.05%	2.05%	2.40%	2.90%	2.95%	3.80%	3.40%	3.90%	3.60%	3.90%	3.60%	
EURJPY													
T<=1W	2.50%	2.20%	2.80%	2.50%	3.40%	3.10%	3.80%	3.60%	3.90%	3.80%	3.90%	3.90%	
1W<T<3M	3.65%	2.90%	4.30%	3.60%	5.30%	4.75%	5.95%	5.45%	5.90%	5.70%	5.90%	5.65%	
3M<=T<6M	3.65%	2.90%	4.30%	3.60%	5.30%	4.75%	5.95%	5.45%	5.90%	5.70%	5.90%	5.65%	
6M<=T<1Y	3.65%	2.90%	4.30%	3.60%	5.30%	4.75%	5.95%	5.45%	5.90%	5.70%	5.90%	5.65%	
1Y<=T<2Y	3.65%	2.90%	4.30%	3.60%	5.40%	4.75%	5.90%	5.45%	5.90%	5.70%	5.90%	5.65%	
2Y	3.65%	2.90%	4.30%	3.60%	5.40%	4.75%	5.90%	5.45%	5.90%	5.70%	5.90%	5.65%	
EURNOK													
T<=1W	1.60%	1.70%	1.90%	1.90%	2.40%	2.30%	2.80%	2.70%	2.90%	2.90%	2.90%	2.90%	
1W<T<3M	2.05%	2.25%	2.55%	2.65%	3.40%	3.25%	3.95%	3.65%	4.25%	3.75%	4.35%	3.75%	
3M<=T<6M	2.05%	2.25%	2.55%	2.65%	3.40%	3.25%	3.95%	3.65%	4.25%	3.75%	4.40%	3.75%	
6M<=T<1Y	2.05%	2.25%	2.55%	2.65%	3.40%	3.25%	3.95%	3.65%	4.40%	3.90%	4.40%	4.00%	
1Y<=T<2Y	2.05%	2.25%	2.55%	2.65%	3.40%	3.25%	3.95%	3.65%	4.40%	3.90%	4.40%	4.00%	
2Y	2.05%	2.25%	2.55%	2.65%	3.40%	3.25%	3.95%	3.65%	4.40%	3.90%	4.40%	4.00%	
EURPLN													
T<=1W	1.80%	2.00%	2.10%	2.20%	2.60%	2.60%	2.90%	2.80%	2.90%	2.90%	2.90%	2.90%	
1W<T<3M	1.80%	2.00%	2.10%	2.25%	2.70%	2.80%	3.35%	3.15%	3.60%	3.30%	3.70%	3.30%	
3M<=T<6M	1.80%	2.00%	2.10%	2.25%	2.70%	2.80%	3.35%	3.15%	3.60%	3.30%	3.70%	3.30%	
6M<=T<1Y	1.80%	2.00%	2.10%	2.25%	2.70%	2.80%	3.50%	3.30%	3.90%	3.50%	3.90%	3.60%	
1Y<=T<2Y	1.80%	2.00%	2.10%	2.25%	2.70%	2.80%	3.50%	3.30%	3.90%	3.50%	3.90%	3.60%	
2Y	1.80%	2.00%	2.10%	2.25%	2.70%	2.80%	3.50%	3.30%	3.90%	3.50%	3.90%	3.60%	
EURRON													
T<=1W	1.70%	2.00%	1.90%	2.20%	2.40%	2.40%	2.60%	2.50%	2.60%	2.60%	2.60%	2.60%	
1W<T<3M	1.70%	2.00%	1.90%	2.20%	2.55%	2.55%	2.95%	2.80%	2.90%	2.85%	2.90%	2.90%	
3M<=T<6M	1.70%	2.00%	1.90%	2.20%	2.55%	2.55%	2.95%	2.80%	2.90%	2.85%	2.90%	2.90%	
6M<=T<1Y	1.70%	2.00%	1.90%	2.20%	2.55%	2.55%	2.95%	2.80%	2.90%	2.85%	2.90%	2.90%	
1Y<=T<2Y	1.70%	2.00%	1.90%	2.20%	2.55%	2.55%	2.95%	2.80%	2.90%	2.85%	2.90%	2.90%	
2Y	1.70%	2.00%	1.90%	2.20%	2.55%	2.55%	2.95%	2.80%	2.90%	2.85%	2.90%	2.90%	
EURRUB													
T<=1W	5.50%	5.90%	6.10%	6.30%	7.30%	6.90%	7.90%	7.40%	7.90%	7.70%	7.90%	7.70%	
1W<T<3M	5.75%	6.75%	6.90%	7.50%	9.15%	8.55%	10.70%	9.05%	10.90%	9.05%	10.90%	8.80%	
3M<=T<6M	5.75%	6.75%	6.90%	7.50%	9.15%	8.55%	10.70%	9.05%	10.90%	9.05%	10.90%	8.80%	
6M<=T<1Y	5.75%	6.75%	6.90%	7.50%	9.15%	8.55%	10.90%	9.10%	10.90%	9.05%	10.90%	8.80%	
1Y<=T<2Y	5.75%	6.75%	6.90%	7.50%	9.15%	8.55%	10.90%	9.10%	10.90%	9.05%	10.90%	8.80%	
2Y	5.75%	6.75%	6.90%	7.50%	9.15%	8.55%	10.90%	9.10%	10.90%	9.05%	10.90%	8.80%	

Jelmagyarázat: Y:year/év, M:month/hónap, W:week/hét, T:futamidő
1 hét=7 naptári nap, 1 hónap=30 naptári nap, 1 év=365 naptári nap

	delta											
	delta < 5%		5% <= delta <= 15%		15% < delta <= 35%		35% < delta <= 65%		65% < delta <= 85%		85% < delta	
	call	put	call	put	call	put	call	put	call	put	call	put
EURSEK												
T<=1W	1.60%	1.70%	1.90%	2.00%	2.40%	2.40%	2.80%	2.70%	2.90%	2.90%	2.90%	2.90%
1W<T<3M	1.70%	1.85%	2.10%	2.25%	2.90%	2.85%	3.40%	3.20%	3.70%	3.30%	3.80%	3.35%
3M<=T<6M	1.70%	1.85%	2.10%	2.25%	2.90%	2.85%	3.40%	3.20%	3.70%	3.30%	3.80%	3.35%
6M<=T<1Y	1.70%	1.85%	2.10%	2.25%	2.90%	2.85%	3.50%	3.20%	3.90%	3.60%	3.90%	3.60%
1Y<=T<2Y	1.70%	1.85%	2.10%	2.25%	2.90%	2.85%	3.50%	3.20%	3.90%	3.60%	3.90%	3.60%
2Y	1.70%	1.85%	2.10%	2.25%	2.90%	2.85%	3.50%	3.20%	3.90%	3.60%	3.90%	3.60%
EURTRY												
T<=1W	24.90%	21.70%	24.90%	22.30%	24.90%	23.10%	24.90%	23.60%	24.90%	23.70%	24.90%	23.50%
1W<T<3M	28.00%	25.55%	29.90%	26.20%	29.90%	26.55%	29.90%	25.95%	29.90%	24.70%	29.90%	23.50%
3M<=T<6M	28.00%	25.55%	29.90%	26.20%	29.90%	26.55%	29.90%	25.95%	29.90%	24.70%	29.90%	23.50%
6M<=T<1Y	28.00%	25.55%	29.90%	26.20%	29.90%	26.55%	29.90%	25.95%	29.90%	24.70%	29.90%	23.50%
1Y<=T<2Y	28.00%	25.55%	29.90%	26.20%	29.90%	26.55%	29.90%	25.95%	29.90%	24.70%	29.90%	23.50%
2Y	28.00%	25.55%	29.90%	26.20%	29.90%	26.55%	29.90%	25.95%	29.90%	24.70%	29.90%	23.50%
EURUSD												
T<=1W	2.70%	2.50%	3.00%	2.90%	3.40%	3.30%	3.80%	3.70%	3.90%	3.80%	3.90%	3.90%
1W<T<3M	2.90%	2.75%	3.50%	3.30%	4.50%	4.25%	5.30%	4.85%	5.75%	5.15%	5.90%	5.20%
3M<=T<6M	2.90%	2.75%	3.50%	3.30%	4.50%	4.25%	5.30%	4.85%	5.75%	5.15%	5.90%	5.20%
6M<=T<1Y	2.90%	2.75%	3.50%	3.30%	4.50%	4.25%	5.60%	5.00%	5.90%	5.30%	5.90%	5.30%
1Y<=T<2Y	2.90%	2.75%	3.50%	3.40%	5.20%	4.50%	5.90%	5.10%	5.90%	5.30%	5.90%	5.30%
2Y	2.90%	2.75%	3.50%	3.40%	5.20%	4.50%	5.90%	5.10%	5.90%	5.30%	5.90%	5.30%
GBPJPY												
T<=1W	10.90%	9.40%	11.40%	9.90%	11.90%	10.80%	11.90%	11.40%	11.90%	11.70%	11.90%	11.70%
1W<T<3M	14.75%	11.00%	15.55%	12.20%	15.90%	14.10%	15.90%	14.90%	15.90%	14.85%	15.90%	14.55%
3M<=T<6M	14.75%	11.00%	15.55%	12.20%	15.90%	14.10%	15.90%	14.90%	15.90%	14.85%	15.90%	14.55%
6M<=T<1Y	14.75%	11.00%	15.55%	12.20%	15.90%	14.10%	15.90%	14.90%	15.90%	14.85%	15.90%	14.55%
1Y<=T<2Y	14.75%	11.00%	15.55%	12.20%	15.90%	14.10%	15.90%	14.90%	15.90%	14.85%	15.90%	14.55%
2Y	14.75%	11.00%	15.55%	12.20%	15.90%	14.10%	15.90%	14.90%	15.90%	14.85%	15.90%	14.55%
GBPUSD												
T<=1W	8.60%	7.80%	9.10%	8.30%	9.90%	9.00%	9.90%	9.50%	9.90%	9.70%	9.90%	9.70%
1W<T<3M	11.50%	9.30%	12.80%	10.40%	13.95%	12.10%	13.90%	12.95%	13.90%	13.05%	13.90%	12.85%
3M<=T<6M	11.50%	9.30%	12.80%	10.40%	13.95%	12.10%	13.90%	12.95%	13.90%	13.05%	13.90%	12.85%
6M<=T<1Y	11.50%	9.30%	12.80%	10.40%	13.95%	12.10%	13.90%	12.95%	13.90%	13.05%	13.90%	12.85%
1Y<=T<2Y	11.50%	9.30%	12.80%	10.40%	13.95%	12.10%	13.90%	12.95%	13.90%	13.05%	13.90%	12.85%
2Y	11.50%	9.30%	12.80%	10.40%	13.95%	12.10%	13.90%	12.95%	13.90%	13.05%	13.90%	12.85%
NOKSEK												
T<=1W	1.70%	1.70%	2.00%	2.00%	2.40%	2.40%	2.80%	2.70%	2.90%	2.90%	2.90%	2.90%
1W<T<3M	2.55%	2.50%	3.00%	2.90%	3.70%	3.50%	4.10%	3.75%	4.30%	3.85%	4.35%	3.75%
3M<=T<6M	2.55%	2.50%	3.00%	2.90%	3.70%	3.50%	4.10%	3.75%	4.30%	3.85%	4.40%	3.75%
6M<=T<1Y	2.55%	2.50%	3.00%	2.90%	3.70%	3.50%	4.20%	3.80%	4.40%	4.10%	4.40%	4.10%
1Y<=T<2Y	2.55%	2.50%	3.00%	2.90%	3.70%	3.50%	4.20%	3.80%	4.40%	4.10%	4.40%	4.10%
2Y	2.55%	2.50%	3.00%	2.90%	3.70%	3.50%	4.30%	3.80%	4.40%	4.10%	4.40%	4.10%
USDCAD												
T<=1W	1.60%	1.70%	1.90%	1.90%	2.40%	2.30%	2.80%	2.70%	2.90%	2.90%	2.90%	2.90%
1W<T<3M	1.90%	2.05%	2.40%	2.50%	3.25%	3.15%	3.85%	3.60%	4.15%	3.75%	4.30%	3.75%
3M<=T<6M	1.90%	2.05%	2.40%	2.50%	3.25%	3.15%	3.85%	3.60%	4.15%	3.75%	4.30%	3.75%
6M<=T<1Y	1.90%	2.05%	2.40%	2.50%	3.25%	3.15%	3.90%	3.60%	4.40%	3.90%	4.40%	4.00%
1Y<=T<2Y	1.90%	2.05%	2.40%	2.50%	3.25%	3.15%	4.10%	3.60%	4.40%	3.90%	4.40%	4.00%
2Y	1.90%	2.05%	2.40%	2.50%	3.25%	3.15%	4.10%	3.60%	4.40%	3.90%	4.40%	4.00%
USDCHF												
T<=1W	2.70%	2.50%	3.00%	2.90%	3.50%	3.30%	3.80%	3.70%	3.90%	3.90%	3.90%	3.90%
1W<T<3M	3.60%	3.15%	4.15%	3.65%	5.00%	4.60%	5.60%	5.10%	5.90%	5.25%	5.90%	5.25%
3M<=T<6M	3.60%	3.15%	4.15%	3.65%	5.00%	4.60%	5.60%	5.10%	5.90%	5.25%	5.90%	5.25%
6M<=T<1Y	3.60%	3.15%	4.15%	3.65%	5.00%	4.60%	5.80%	5.20%	5.90%	5.50%	5.90%	5.40%
1Y<=T<2Y	3.60%	3.15%	4.15%	3.65%	5.00%	4.60%	5.80%	5.20%	5.90%	5.50%	5.90%	5.40%
2Y	3.60%	3.15%	4.15%	3.65%	5.00%	4.60%	5.80%	5.20%	5.90%	5.50%	5.90%	5.40%

Jelmagyarázat: Y:year/év, M:month/hónap, W:week/hét, T:futamidő
1 hét=7 naptári nap, 1 hónap=30 naptári nap, 1 év=365 naptári nap

	delta												
	delta < 5%		5% <= delta <= 15%		15% < delta <= 35%		35% < delta <= 65%		65% < delta <= 85%		85% < delta		
	call	put	call	put	call	put	call	put	call	put	call	put	
USDHUF													
T<=1W	1.90%	2.10%	2.30%	2.50%	3.10%	3.10%	3.70%	3.60%	3.90%	3.80%	3.90%	3.90%	
1W<T<3M	2.50%	3.00%	3.25%	3.70%	4.75%	4.70%	5.80%	5.35%	5.90%	5.55%	5.90%	5.50%	
3M<=T<6M	2.50%	3.00%	3.25%	3.70%	4.75%	4.70%	5.80%	5.35%	5.90%	5.55%	5.90%	5.50%	
6M<=T<1Y	2.50%	3.00%	3.25%	3.70%	4.75%	4.70%	5.80%	5.35%	5.90%	5.55%	5.90%	5.50%	
1Y<=T<2Y	2.50%	3.00%	3.25%	3.70%	4.75%	4.70%	5.90%	5.35%	5.90%	5.55%	5.90%	5.50%	
2Y	2.50%	3.00%	3.25%	3.70%	4.75%	4.70%	5.90%	5.35%	5.90%	5.55%	5.90%	5.50%	
USDJPY													
T<=1W	3.70%	3.20%	4.00%	3.60%	4.50%	4.20%	4.90%	4.60%	4.90%	4.80%	4.90%	4.90%	
1W<T<3M	4.95%	3.85%	5.55%	4.50%	6.40%	5.65%	7.05%	6.30%	7.40%	6.40%	7.40%	6.40%	
3M<=T<6M	4.95%	3.85%	5.55%	4.50%	6.40%	5.65%	7.05%	6.30%	7.40%	6.40%	7.40%	6.40%	
6M<=T<1Y	4.95%	3.85%	5.55%	4.50%	6.40%	5.65%	7.40%	6.60%	7.40%	6.80%	7.40%	6.70%	
1Y<=T<2Y	4.95%	3.85%	5.55%	4.50%	6.40%	5.65%	7.40%	6.60%	7.40%	6.80%	7.40%	6.70%	
2Y	4.95%	3.85%	5.55%	4.50%	6.40%	5.65%	7.40%	6.60%	7.40%	6.80%	7.40%	6.70%	
USDPLN													
T<=1W	2.00%	2.20%	2.40%	2.50%	3.20%	3.20%	3.70%	3.60%	3.90%	3.80%	3.90%	3.90%	
1W<T<3M	2.45%	3.00%	3.20%	3.60%	4.70%	4.65%	5.75%	5.30%	5.90%	5.55%	5.90%	5.50%	
3M<=T<6M	2.45%	3.00%	3.20%	3.60%	4.70%	4.65%	5.75%	5.30%	5.90%	5.55%	5.90%	5.50%	
6M<=T<1Y	2.45%	3.00%	3.20%	3.60%	4.70%	4.65%	5.75%	5.30%	5.90%	5.55%	5.90%	5.50%	
1Y<=T<2Y	2.45%	3.00%	3.20%	3.60%	4.80%	4.65%	5.90%	5.30%	5.90%	5.55%	5.90%	5.50%	
2Y	2.45%	3.00%	3.20%	3.60%	4.80%	4.65%	5.90%	5.30%	5.90%	5.55%	5.90%	5.50%	
USD RUB													
T<=1W	5.50%	5.90%	6.10%	6.40%	7.30%	7.00%	7.90%	7.40%	7.90%	7.70%	7.90%	7.70%	
1W<T<3M	5.70%	6.90%	6.90%	7.65%	9.15%	8.60%	10.70%	9.00%	10.90%	9.05%	10.90%	8.80%	
3M<=T<6M	5.70%	6.90%	6.90%	7.65%	9.15%	8.60%	10.70%	9.00%	10.90%	9.05%	10.90%	8.80%	
6M<=T<1Y	5.70%	6.90%	6.90%	7.65%	9.40%	8.70%	10.90%	9.20%	10.90%	9.05%	10.90%	8.80%	
1Y<=T<2Y	5.70%	6.90%	6.90%	7.65%	9.40%	8.70%	10.90%	9.20%	10.90%	9.05%	10.90%	8.80%	
2Y	5.70%	6.90%	6.90%	7.65%	9.40%	8.70%	10.90%	9.20%	10.90%	9.05%	10.90%	8.80%	
USDTRY													
T<=1W	24.90%	21.60%	24.90%	22.20%	24.90%	23.10%	24.90%	23.60%	24.90%	23.70%	24.90%	23.40%	
1W<T<3M	27.70%	25.25%	29.85%	26.00%	29.90%	26.50%	29.90%	26.00%	29.90%	24.70%	29.90%	23.40%	
3M<=T<6M	27.70%	25.25%	29.85%	26.00%	29.90%	26.50%	29.90%	26.00%	29.90%	24.70%	29.90%	23.40%	
6M<=T<1Y	27.70%	25.25%	29.85%	26.00%	29.90%	26.50%	29.90%	26.00%	29.90%	24.70%	29.90%	23.40%	
1Y<=T<2Y	27.70%	25.25%	29.85%	26.00%	29.90%	26.50%	29.90%	26.00%	29.90%	24.70%	29.90%	23.40%	
2Y	27.70%	25.25%	29.85%	26.00%	29.90%	26.50%	29.90%	26.00%	29.90%	24.70%	29.90%	23.40%	

Jelmagyarázat: Y:year/év, M:month/hónap, W:week/hét, T:futamidő
1 hét=7 naptári nap, 1 hónap=30 naptári nap, 1 év=365 naptári nap

Delta: Az egyszerű (plain vanilla) opció deltája az opció piaci értékének változását mutatja az opció alaptermék árának/árfolyamának (kismértékű) változása függvényében. Az egyszerű (plain vanilla) opció deltája 0 és 1 közötti szám vett call opciók esetén, míg 0 és -1 közötti szám vett put opció esetén. A táblázatban a delta kategóriák %-os formában lettek megjelenítve, vagyis az 1 az 100%-nak, a -1 pedig -100%-nak felel meg. A |delta| a delta érték abszolút értékét jelöli. A delta értéke „Az egyes tőzsdén kívüli származtatott Egyedi Ügyletek változó letétigény mértékének számításáról és a biztosított követelés összegének változását meghatározó feltételekről” című tájékoztató hirdetményben bemutatott értékelési modellből, az alapszámítások igény meghatározásakor kerül kiszámításra. A delta értékét az OTP Bank Nyrt. számítja ki az általa meghatározott módszertan alapján.

Az Európai típusú Egyszerű (Plain Vanilla) Opció Egyedi Ügyletek esetében az alapszámítás devizaneme az ügyletben szereplő devizapár második devizája. Amennyiben az Európai típusú Egyszerű (Plain Vanilla) Opció Egyedi Ügyletek esetében az alapszámítás devizaneme nem a forint (HUF), az alapszámítás minden értékeléskor, azaz minden banki munkanapon, napon belüli értékelés esetében akár napon belül is, a devizában kalkulált összeg forint értéke, mely az aktuális OTP középárfolyam alapján kerül megállapításra, így az aktuális árfolyam alapján változik a forintban (HUF devizanemben) kifejezett összege.

7/B. Árfolyamkorlát (Barrier) Opció kötések

- a. a Biztosított követelés ügyletkötés időpontjára kalkulált összege azonos az Egyedi Ügylet Névértékével,
- b. az alapbiztosíték ügyletkötés időpontjára megállapított mértéke és a Biztosított követelésnek az a része, amelyet az Üzletfél az ügyletkötés időpontjában Biztosítékkal köteles fedezni egyedileg, az Üzletféllel megkötésre kerülő Egyedi Ügyletre vonatkozó szerződésben kerül megállapításra,
- c. az Árfolyamkorlát (Barrier) Opció Egyedi Ügyletek esetében az alapbiztosíték devizaneme az ügyletben szereplő devizapár második devizája,
- d. amennyiben az Árfolyamkorlát (Barrier) Opció Egyedi Ügyletek esetében az alapbiztosíték devizaneme nem a forint (HUF), az alapbiztosíték devizában kalkulált összegének forintban kifejezett értéke minden értékeléskor, azaz minden banki munkanapon, napon belüli értékelés esetében akár napon belül is, az aktuális OTP középárfolyam alapján kerül megállapításra, így az aktuális árfolyam alapján változik a forintban (HUF devizanemben) kifejezett összege.

8. Inflációs Swap Ügyletre vonatkozó Egyedi Ügylet esetében

- a. a Biztosított követelés ügyletkötés időpontjára kalkulált összege azonos az Egyedi Ügylet Kötési Értékével (Névértékével),
- b. az alapbiztosíték ügyletkötés időpontjára megállapított mértéke és a Biztosított követelésnek az a része, amelyet az Üzletfél az ügyletkötés időpontjában Biztosítékkal köteles fedezni egyedileg, az Üzletféllel megkötésre kerülő Egyedi Ügyletre vonatkozó szerződésben kerül megállapításra,
- c. az Inflációs Swap Egyedi Ügyletek esetében az alapbiztosíték devizaneme az Üzletfél által fizetendő devizanem,
- d. amennyiben az Inflációs Swap Egyedi Ügyletek esetében alapbiztosíték devizaneme nem a forint (HUF), az alapbiztosíték devizában kalkulált összegének forintban kifejezett értéke minden értékeléskor, azaz minden banki munkanapon, napon belüli értékelés esetében akár napon belül is, az aktuális OTP középárfolyam alapján kerül megállapításra, így az aktuális árfolyam alapján változik a forintban (HUF devizanemben) kifejezett összege.

9. Áru Swap Ügyletre vonatkozó Egyedi Ügylet esetében a Biztosított követelés összege az ügyletkötés napján azonos az alapbiztosíték ügyletkötés időpontjára kalkulált mértékével, amely az Egyedi Ügyletnek a mögöttes termék piaci értékének az alábbi táblázat szerinti százaléka:

Termékcsalád	Termék	Devizanem	Bullet swap súly	Ázsiai swap súly
Nyersolaj	ICE Brent Crude Futures	USD	16%	
	ICE WTI Crude Futures	USD	16%	
Gázolaj	ICE Gasoil Future	USD	16%	11%
Földgáz	Argus TTF MA Head Natural gas	EUR	17%	10%
	Argus TTF DA Natural gas	EUR	32%	19%
	Natural Gas, Henry Hub (NYMEX)	USD	20%	
	NBP UK Natural Gas	GBP	20%	
Agrár	Wheat Future	USD	15%	
	Wheat , Milling Futures	EUR	10%	
	Corn Future	USD	14%	
	Maize Futures	EUR	12%	
		HUF	12%	
	Rapeseed Future	EUR	7%	
	Coffee, Arabica (ICE)	USD	15%	
	Sugar (ICE)	USD	14%	
	Cocoa (ICE)	USD	15%	
	Soybean Meal	USD	13%	
Fémek	LME Primary Aluminum	USD	14%	
	LME Copper	USD	11%	
	Comex Copper	USD	11%	
	LME Nickel	USD	15%	
	LME Zinc	USD	13%	
	LME Gold	USD	18%	12%
	Comex Gold	USD	9%	
	LME Silver	USD	26%	16%
	Comex Silver	USD	14%	
	Comex Platinum	USD	12%	
	Comex Palladium	USD	16%	
	LME Lead	USD	13%	
	LME Tin	USD	8%	
	LME Steel Scrap	USD	25%	15%
	LME Steel Rebar	USD	15%	12%
	CME Hot-Rolled Coil Steel	USD	12%	8%
	CBT Black Sea Wheat	USD	18%	12%

Megjegyzés:

A szürkével jelölt termék-ügylettípus kombinációjú ügylet nem kerül kötésre.

Bullet swap: olyan csereügylet, amelyben elszámoláskor az ügyletben szereplő egyik fél előre meghatározott, fix árat fizet, míg a másik fél az ügylet alaptermékének lejáratkor megfigyelt árát fizeti, adott névértékre vetítve. Az ügylet egyperiódusú, a kifizetések elszámolása csak egyszer, az ügylet lejáratakor történik.

Ázsiai típusú swap: olyan csereügylet, amelyben elszámoláskor az ügyletben szereplő egyik fél előre meghatározott, fix árat fizet, míg a másik fél az ügylet alaptermékének meghatározott időtartamon keresztül megfigyelt napi záróárainak számtani átlagát, adott névértékre vetítve. Az ügyletnek több periódusa is lehet.

Az Áru Swap Egyedi Ügyletek esetében az alapbiztosíték devizaneme az ügylet azon devizája, amelyben a kifizetés történik.

Amennyiben az Áru Swap Egyedi Ügyletek esetében az alapbiztosíték devizaneme nem a forint (HUF), az alapbiztosíték devizában kalkulált összegének forintban

kifejezett értéke minden értékeléskor, azaz minden banki munkanapon, napon belüli értékelés esetében akár napon belül is, az aktuális OTP középárfolyam alapján kerül megállapításra, így az aktuális árfolyam alapján változik a forintban (HUF devizanemben) kifejezett összege.

II. Tőzsdei származtatott ügyletek letéti követelménye

1. BÉT Tőzsdei Határidős Ügylet és BÉT Tőzsdei Opciós Ügylet esetén Biztosítékként az OTP Bank Nyrt. (i) pénzóvadékat és (ii) azon értékpapírokat fogadja el, amelyeket a KELER Zrt. elfogadhatóként meghatároz. Az Értékpapír óvadék beszámítási értéke megegyezik az adott tőzsdéhez tartozó elszámolóház által alkalmazott beszámítási értékkel.
2. A II.1. pont hatálya alá nem tartozó Egyéb Tőzsdei Határidős Ügylet Biztosítékként az OTP Bank Nyrt. kizárólag Pénzóvadékat fogad el. A Pénzóvadék devizaneme minden esetben megegyezik az Egyéb Tőzsdei Határidős Ügylet tárgyát képező termék kereskedésének devizanemével.
3. Alapbiztosíték mértéke:

A BÉT Tőzsdei Határidős Ügylet, a BÉT Tőzsdei Opciós Ügylet és a Deutsche Börse-n végrehajtott vagy Egyéb Tőzsdei Határidős Ügylet mindenkor elszámolását végző elszámolóház által meghatározott vagy a Teljesítési Partner által előírt mérték *1,5.

III. A fedezetbe foglalható Biztosítékok (értékpapírok) listája és azok befogadási értéke

A fedezetbe foglalható Biztosítékok (értékpapírok) listáját és azok befogadási értékét a jelen Kiegészítő hirdetmény 1. számú melléklete tartalmazza.

IV. Egyéb rendelkezések

A jelen Kiegészítő Hirdetményben nem szabályozott kérdésekben az OTP Bank Nyrt. Regionális Treasury Igazgatóságának Értékesítési Üzletszabályzata (Üzletszabályzat) és mellékletei irányadóak. Amennyiben a jelen Kiegészítő Hirdetmény eltérően nem rendelkezik, akkor az itt használt fogalmak az Üzletszabályzatban meghatározott jelentéssel bírnak.