

Alapletétkövetelmény kalkulátor

Felhasználói leírás

Tartalom

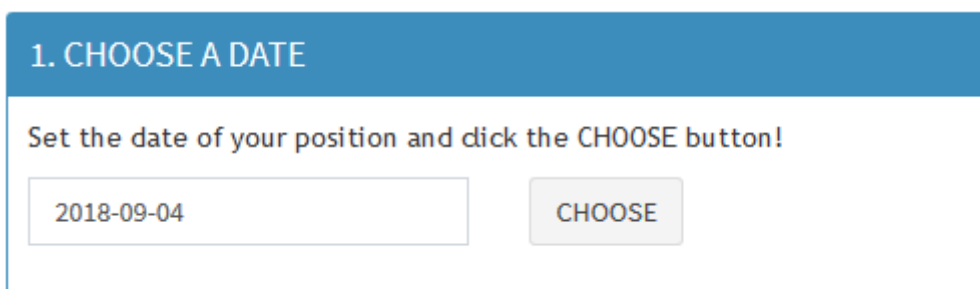
Alapletétkövetelmény számítás 3 lépésben	2
1. lépés - Dátumválasztás	2
1.1. Dátum megadása	2
1.2. Dátum betöltése	3
2. lépés - Portfólió megadása	3
2.1. Product	4
2.2. Instrument.....	5
2.3. Portfólió elemek hozzáadása és törlése	6
3. lépés - Margin számítás és eredmények	7
3.1. Margin számítás	7
3.2. Eredmények	8
Újra futtathatóság.....	9
Nem megfelelő használat	9
+ Portfólió mentése	10
Felületi elemek működése.....	11
Hivatkozások.....	11
Felületi elemek dinamikus változása	11
Interaktív diagram és táblázat	12

Alapletétkövetelmény számítás 3 lépésben

A kalkulátor felületen 3 egyszerű lépésben elvégezhetjük a kiválasztott portfólióink alapletét követelményének meghatározását, mely lépések egymásra épülnek.

1. lépés - Dátumuálasztás

Első lépésként ki kell választani azt a dátumot, amely napra vonatkozó záró pozícióra szeretnénk meghatározni az alapletét követelményt.



1. ábra: Dátum kiválasztásához használt felület.

1.1. Dátum megadása

A kalkulációhoz minden alapadat (egységnyi alapletét követelmény, egységnyi kedvezményi lehetőségek, elszámolási árfolyam, short opciós követelmény stb.) a KELER KSZF honlapján közzétett SPAN fájlból kerül feldolgozásra. A KELER KSZF minden alapletét számítási napra közzéteszi a számításai során használt SPAN fájlt. A felületen a dátum kiválasztásával adhatjuk meg, hogy melyik napi SPAN fájl képezze a számítás alapját. Így, ha tervezéshez szeretnénk felhasználni a kalkulátort, akkor érdemes azt a dátumot kiválasztani, melyre a legfrissebb SPAN fájl elérhető a honlapon.

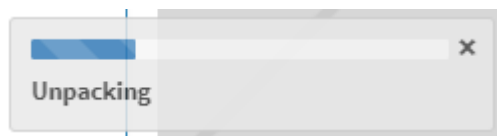
A felület megnyitásakor automatikusan megjelenítésre kerül a szervertől idő szerinti eggyel korábbi naptári nap. Ez munkaszüneti nap után mindenképp átállítandó a legutóbbi munkanapra, melyre már megtörtént a SPAN fájl feltöltése.

Ha ettől eltérő dátumra vonatkozó pozícióra szeretnénk kiszámítani a margin követelményt, akkor többféleképpen is módosíthatjuk a dátumot.

- A bemeneti mezőre kattintva felnyílik egy naptár, melyből a felhasználó kiválaszthatja a használni kívánt dátumot.
- A felhasználó beírhatja azt, akár a megjelenő formátummal összhangban, de például az alábbi formátumokat is felismeri és átalakítja a beviteli mező: YYYY.MM.DD; YYYY/MM/DD.
- A felhasználó bemásolhatja a dátumot vágólapról. Ehhez nem szükséges a beviteli mezőben lévő dátum kijelölése, majd törlése. Egyszerűen a kurzorral kattintsunk a mezőbe és illesszük be a használni kívánt dátumot (jobb kattintás beillesztéssel vagy Ctrl + V megnyomásával). Itt sem fontos a teljesen egyforma formátum használata, a felület felismeri az előző pontban leírt formátumokat másolás után.

1.2. Dátum betöltése

A dátum megadása után nyomjuk meg a 'CHOOSE' gombot, ezzel tölthetjük be a dátumnak megfelelő SPAN fájlt. A beolvasás státuszát a képernyő jobb alsó sarkában láthatjuk:



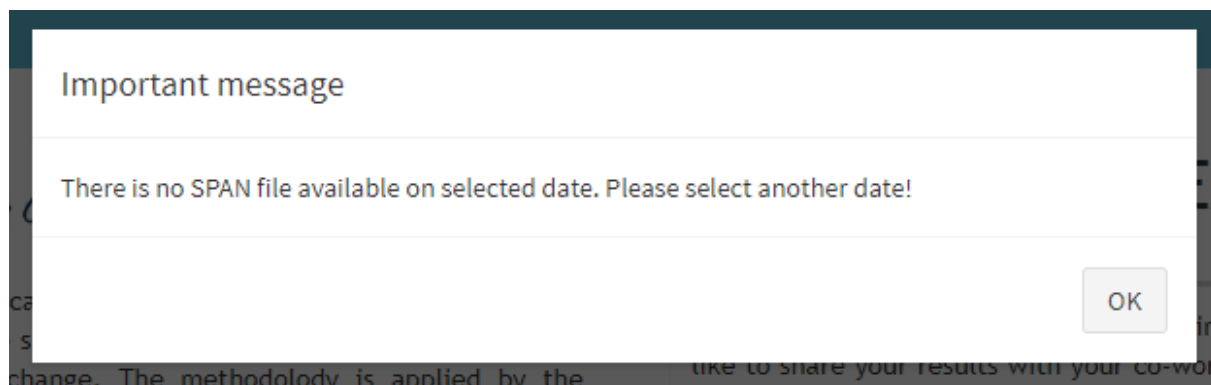
2. ábra: Alapadatok betöltési státuszát jelző képernyő elem a felület jobb alsó sarkában.

Az alábbi lépéseket követhetjük nyomon:

1. Downloading
2. Unpacking
3. Data mining
4. Data transforming
5. Updating UI

Sikeres beolvasás után a státuszt jelző ablak eltűnik, tovább léphetünk a 2. lépésre.

Ha valamely kiválasztott napra nem elérhető SPAN fájl, akkor a 'CHOOSE' gomb megnyomása után a rendszer figyelmeztet annak hiányára az alábbi üzenettel. A pop-up leokézása után választhatunk ki másik dátumot.



3. ábra: Megjelenő hibüzenet nem megfelelő napra történő fájlbeolvasáskor.

2. lépés - Portfólió megadása

Sikeres dátumválasztás és betöltés után feltöltődik értékekkel a 'Product' legördülő mező. A kívánt 'Product' kiválasztása után betöltődik az 'Instrument' legördülő értékkeszlete is, valamint a 'Position' mezőben megadható a pozíció darab száma is.

2. CREATE YOUR PORTFOLIO

Choose product and then instruments from the drop list and set the amount of your position! By clicking to "+" / "trash button", instruments can be added to / deleted from your portfolio!

Product	Instrument	Position	
▼	▼	0	<div style="display: flex; justify-content: space-around; align-items: center;"> + ✖ </div>

4. ábra: Portfolió megadásához használt felület

2.1. Product

A 'Product' legördülő menüben a listázott termékek kategóriánként csoportosítva jelennek meg egymás alatt az alábbiak szerint:

- | | |
|---------------------------------------|------------------------------------|
| • Share section | Részvény ügyletkör |
| • Financial section | Pénzügyi ügyletkör |
| • Financial section (weekly products) | Pénzügyi ügyletkör (heti termékek) |
| • Commodity section | Áru szekció |
| • Unclassified | Be nem sorolt |

Az egyes terméknevek kezdete az alábbi konvenciók szerint épül fel:

- H. - határidős termékek esetén
- H.W - határidős heti termékek esetén
- O. - opciós termékek esetén

Deviza termékek neve perjellel kerül feltüntetésre pl. H.EUR/HUF, míg keresztdevizás termékek kiegészítésre kerülnek az elszámolási devizával pl. EUR/USD-HUF. Árutermékek megnevezésére angolul kereshetünk, például határidős kukorica termékre: H.CORN.

A legördülő lista görgetése mellett kereshetünk benne gépeléssel is. A kereső nem tesz különbséget a kis, illetve nagybetűk között továbbá a szavakat nem szükséges az elejéről kezdenünk gépelni, tetszőleges szótöredékre is képes a mező szűrni.

2. CREATE YOUR PORTFOLIO

Choose product and then instruments from the drop list and set the amount of your position! By clicking to "+" / "trash button", instruments can be added to / deleted from your portfolio!

Product	Instrument	Position	
<div style="border: 1px solid #ccc; padding: 2px;"> bu ▲ </div> <div style="border: 1px solid #ccc; padding: 2px; margin-top: 2px;"> Share section H.BUMIX H.BUX H.BUXETF O.BUX </div>	<div style="border: 1px solid #ccc; height: 20px; width: 100%;"></div>	<div style="border: 1px solid #ccc; padding: 2px; width: 50px; text-align: center;">0</div>	<div style="background-color: #E67E22; color: white; width: 20px; height: 20px; margin: 0 auto; display: flex; align-items: center; justify-content: center;"> ✖ </div>

5. ábra: Legördülő listában történő szabad szavas keresés.

2.2. Instrument

A 'Product' mező definiálása után töltődik fel értékkel az 'Instrument' mező a kiválasztott terméknek megfelelően. Az instrumentumok már tartalmaznak lejáratot, opciók esetében pedig kötési árfolyamot és az opciótípust is. Itt is működik a 'Product'-nál bemutatott szabadszavas keresési lehetőség.

2. CREATE YOUR PORTFOLIO

Choose product and then instruments from the drop list and set the amount of your position! By clicking to "+" / "trash button", instruments can be added to / deleted from your portfolio!


Product	Instrument	Position	
<div style="border: 1px solid #ccc; padding: 2px;"> H.BUX ▼ </div>	<div style="border: 1px solid #ccc; padding: 2px;"> ▲ </div> <div style="border: 1px solid #ccc; padding: 2px; margin-top: 2px;"> H.BUX 201809 H.BUX 201810 H.BUX 201811 H.BUX 201812 H.BUX 201903 H.BUX 201906 H.BUX 201912 H.BUX 202006 </div>	<div style="border: 1px solid #ccc; padding: 2px; width: 50px; text-align: center;">0</div>	<div style="background-color: #E67E22; color: white; width: 20px; height: 20px; margin: 0 auto; display: flex; align-items: center; justify-content: center;"> ✖ </div>

+

6. ábra: Példa az instrumentum nevének felépítésére határidős típusú termék esetén.

2. CREATE YOUR PORTFOLIO

Choose product and then instruments from the drop list and set the amount of your position! By clicking to "+" / "trash button", instruments can be added to / deleted from your portfolio!

Product	Instrument	Position	
O.BUX	c	1	

O.BUX
201809C34700

O.BUX
201809C34800


O.BUX
201809C34900

7. ábra: Példa az instrumentum nevének felépítésére opció típusú termék esetén. Kereső szó 'c', így a legördülő mezőben csak a CALL opciók kerülnek megjelenítésre.

A kívánt instrumentum után adjuk meg pozíciónk nagyságát. Ezt megtehetjük egész számok beírásával, vagy a felfelé/lefelé mutató nyilakra történő kattintással. Pozitív szám vételi (long) pozíciót jelent, míg negatív számmal adhatjuk meg eladási (short) pozíciók mennyiségét.

2. CREATE YOUR PORTFOLIO

Choose product and then instruments from the drop list and set the amount of your position! By clicking to "+" / "trash button", instruments can be added to / deleted from your portfolio!

Product	Instrument	Position	
H.BUX	H.BUX 201810	1	

8. ábra: Példa pozíció méretének megadására, a 'Position' mező felfelé/lefelé mutató nyilak megjelenésére.

2.3. Portfólió elemek hozzáadása és törlése



A zöld pluszjellel adható hozzá új elem a portfóliókhhoz. Az akció gomb megnyomására új sor jelenik meg a felületen, ahol újra kiválaszthatjuk a szükséges 'Product' - 'Instrument' - 'Position' kombinációt. Tetszőleges mennyiségű portfólió elemet adhatunk hozzá, az új sorok mindig legalul jelennek meg.

2. CREATE YOUR PORTFOLIO

Choose product and then instruments from the drop list and set the amount of your position! By clicking to "+" / "trash button", instruments can be added to / deleted from your portfolio!

Product	Instrument	Position	
H.BUX	H.BUX201810	1	🗑️
+			

2. CREATE YOUR PORTFOLIO

Choose product and then instruments from the drop list and set the amount of your position! By clicking to "+" / "trash button", instruments can be added to / deleted from your portfolio!

Product	Instrument	Position	
H.BUX	H.BUX201810	1	🗑️
H.4IG		0	🗑️
+			

9. ábra: Portfólió elem hozzáadásával új 'Product' - 'Instrument' - 'Position' kombináció jelenik meg a felületen.



A piros törlés (kuka) jellel törölhetünk elemet a portfóliónkból. Az akció gomb megnyomására a gomb sorában látható 'Product' - 'Instrument' - 'Position' kombináció eltávolításra kerül a portfólióból.

2. CREATE YOUR PORTFOLIO

Choose product and then instruments from the drop list and set the amount of your position! By clicking to "+" / "trash button", instruments can be added to / deleted from your portfolio!

Product	Instrument	Position	
H.BUX	H.BUX201810	1	🗑️
H.4IG	H.4IG 201811	-2	🗑️
+			

2. CREATE YOUR PORTFOLIO

Choose product and then instruments from the drop list and set the amount of your position! By clicking to "+" / "trash button", instruments can be added to / deleted from your portfolio!

Product	Instrument	Position	
H.BUX	H.BUX201810	1	🗑️
+			

10. ábra: Portfólió elem törlésekor a felületről is eltűnik a használt törlés gomb melletti sor.

3. lépés - Margin számítás és eredmények

3.1. Margin számítás

Utolsó lépésben a beállított portfóliónkra a 'CALCULATE' gomb megnyomásával indíthatjuk az alapletét követelmény számítását.

3. CALCULATE THE RESULTS

Push the **CALCULATE** button to get the margin results of your created portfolio!

CALCULATE

11. ábra: A számításhoz szükséges a 'CALCULATE' gomb megnyomása.

3.2. Eredmények

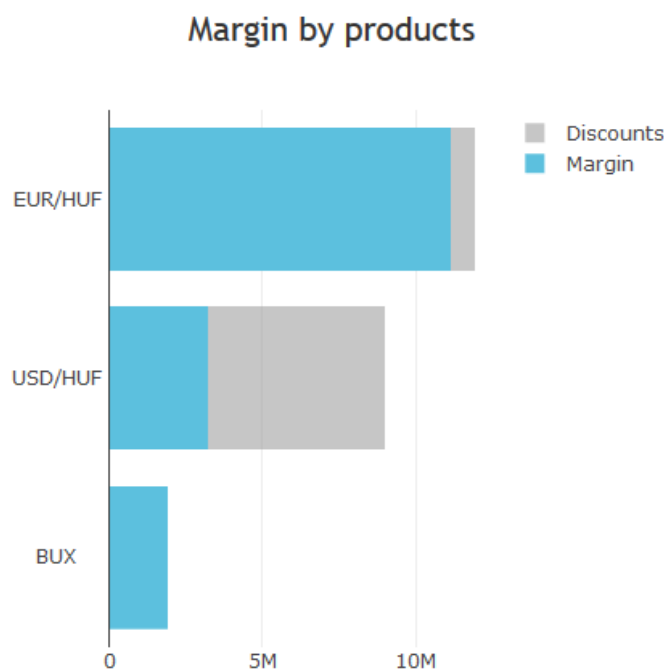
Az összevont alapletét követelmény értéke minden esetben HUF-ban kerül feltüntetésre. Emellett megjelenítésre kerül az összevont alapletét követelmény aránya a pozíció bruttó elszámolási értékéhez (adott napi elszámolóár és darabszám szorzatának abszolút értéke) viszonyítva százalékban.

A KELER K SZF egy adott instrumentumban az első ügyletkötésig nem határoz meg záróárat, így előfordulhat, hogy a pozíció elszámolási értéke nulla. A margin ekkor is meghatározásra kerül, azonban a 'Margin ratio' meghatározhatatlan. A felületen ekkor 'Inf%' jelenik meg.



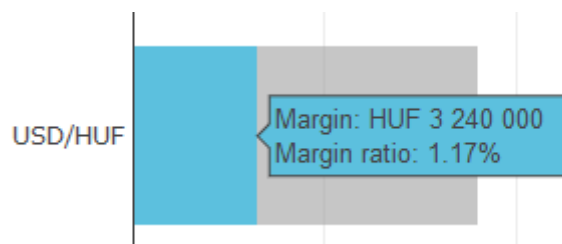
12. ábra: Összevont alapletét követelmény és aránya a pozíció elszámolási értékéhez.

Az eredmények jobb megértéshez halmozott diagramon kerül szemléltetésre az alapletét követelmény termékenkénti felbontása (kék színnel), mellette pedig a számítás során a KELER K SZF módszertanából adódó különböző (intra- és inter-spread) kedvezmények szintén adott termékhez kapcsolódóan (szürke színnel). Ha nem alkalmaznának kedvezményeket, akkor az alapletét követelmény több lenne az esetleges szürkével jelölt kedvezmények mértékével. A diagramon a termékek megjelenítési sorrendjét a csökkenő alapletét igény vezérli. A diagram dinamikusan nagyítható, a kurzor mozgatásával megjeleníthetőek az alatta lévő elemek pontos értékei. A diagram, mint felületi elem működéséről lásd bővebben a Felületi elemek működése fejezetet.



13. ábra: Alapletét követelmény, és érvényesített kedvezmény mértéke HUF-ban termékenkénti bontásban.

Az alapletét követelmény - elszámolási érték arányt szintén megvizsgálhatjuk termékenkénti bontásban a fenti ábrán az kurzort a margin értékét jelző oszlop fölé mozdítva.



14. ábra: Alapletét követelmény és aránya a bruttó elszámolási értékhez egy terméke esetén.

Újra futtathatóság

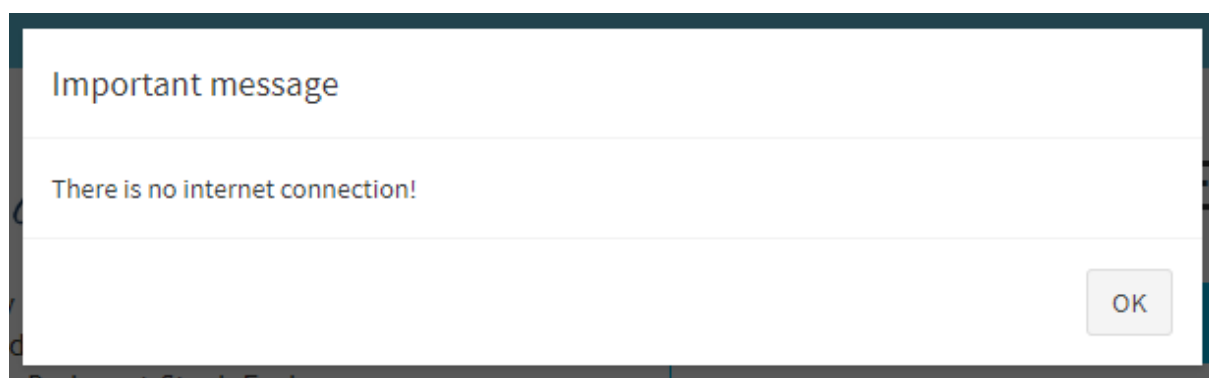
A három lépést a felhasználó tetszőleges sorrendben ismételheti. A már összeállított portfólió alapletét követelményét eltérő dátumra is kiszámíthatjuk, ha a portfólió összeállítása után új dátumot választunk és a 'CHOOSE' gombbal beolvassuk a SPAN fájlt. Ebben az esetben a portfólió azon elemei üressé válnak, melyek az új fájlban nem elérhetőek. Vagyis az adott napon az adott termékből a korábban kiválasztott instrumentummal már nem kereskednek, vagy még nem került megnyitásra.

Nem megfelelő használat

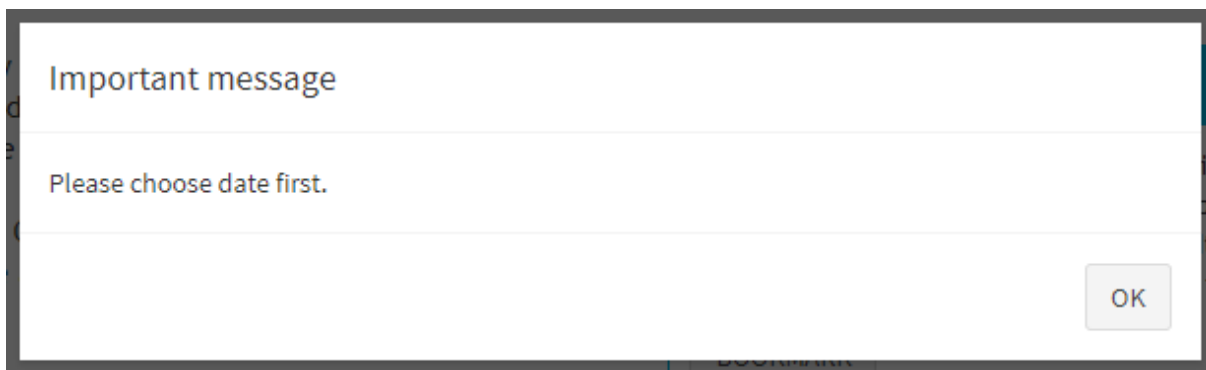
Ha az egyes lépésekhez szükséges előfeltételek nem teljesülnek, akkor a felület felugró ablakban 'Important message' címmel figyelmezteti erre a felhasználót. A hibaüzenet szövege szerint járhat el ezután a felhasználó a felugró ablakon az 'OK' gomb megnyomása után.

Az alábbi figyelmeztető üzenetekkel találkozhat a felhasználó a kalkulátor használata során.

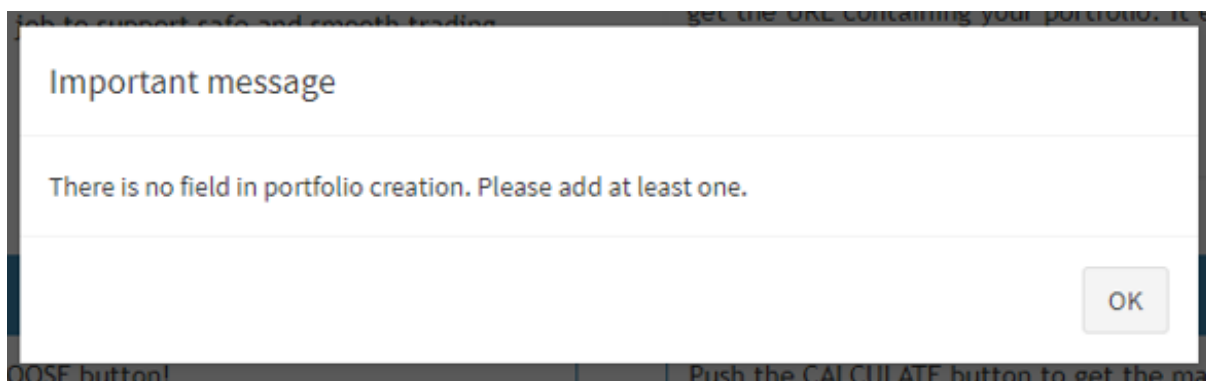
Ha a felület megnyitása után az internet kapcsolat megszűnik és szeretnénk beolvasni a kiválasztott dátumhoz kapcsolódó SPAN fájlt, a 'CHOOSE' gomb megnyomásakor az alábbi üzenetet kapjuk:



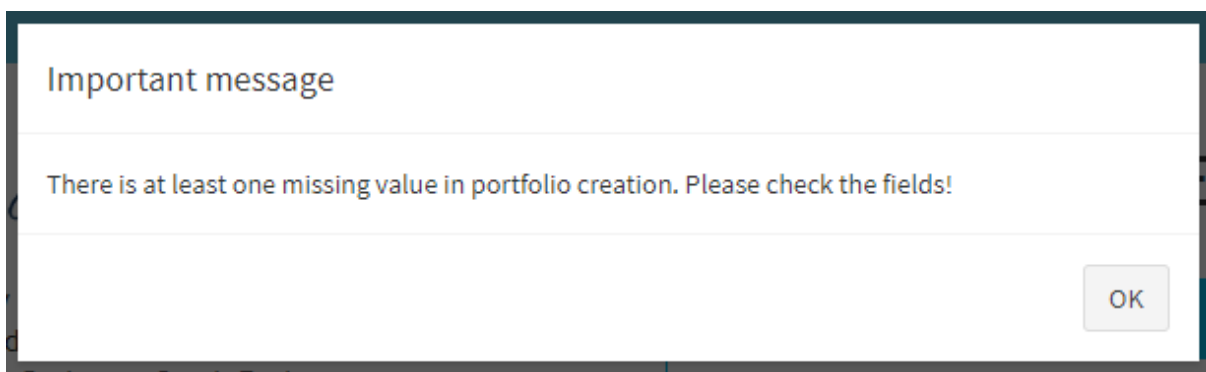
Ha a dátum kiválasztása nélkül szeretnénk hozzá adni új portfólió elemet, akkor az alábbi figyelmeztető üzenetet kapjuk:



Ha véletlenül minden sort kitörlünk a portfólióból és így nyomjuk meg a 'CALCULATE' gombot:



Ha nem választunk ki dátumot, vagy a dátum kiválasztása és SPAN fájl betöltése után nem hozunk létre portfóliót, hanem egyből a 3. pontban lévő 'CALCULATE' gombra kattintunk, vagy esetleg úgy lépünk a 3. pontra, hogy valamely portfólió elem nem megfelelően került kitöltésre, pl. üres a Product az Instrument vagy a Position mező, akkor az alábbi figyelmeztető üzenetet kapjuk:

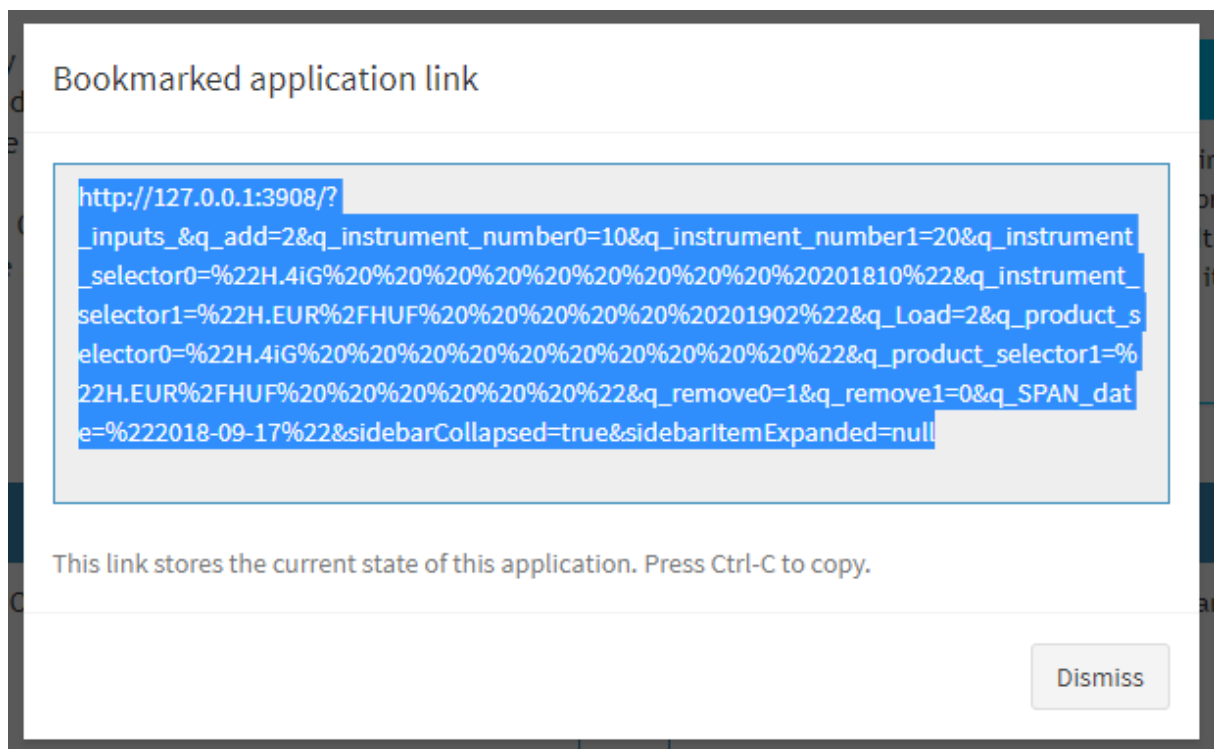


+ Portfólió mentése

A létrehozott portfóliót megoszthatjuk, így az alapletét követelmény felépítését könnyen megismertethetjük másokkal. Továbbá a már egyszer rögzített portfóliót elmenthetjük, így rendszeres használat esetén nem szükséges a portfólió újbóli rögzítése, csupán a módosítások átvezetése, amennyiben volt.

Ehhez a portfólió létrehozása után nyomjuk meg a 'BOOKMARK' gombot. A gomb megnyomására

felugró ablakban láthatjuk a portfóliót tartalmazó URL elérést, melyet könnyen másolhatunk vagy könyvjelzőként menthetünk. A felugró ablakot a 'Dismiss' gombbal zárhatjuk be.



A link nemcsak a portfóliót, hanem a kiválasztott napot is menti, így annak újbóli megnyitásakor a dátumhoz kapcsolódó fájl automatikusan betöltésre kerül. Igény szerint választhatunk másik napot, majd egyszerűen a 'CALCULATE' gomb megnyomásával már láthatjuk is az eredményt.

Felületi elemek működése

Hivatkozások

A felület tetején található logókra kattintva külön ablakban megnyílnak az egyes vállalati honlapok.



Felületi elemek dinamikus változása

A kijelző méretének változásával a felületi elemek mérete dinamikusan igazodik a kijelző méretéhez. Nagy kijelző esetén az elemek egymás mellett helyezkednek el, míg egy bizonyos méret szélesség esetén a felületi már elemek vertikálisan tagozódnak. Erre az egyik legszemléletesebb példa az alapletét követelmény, illetve arány. Az első képen az eredmények egymás mellett helyezkednek el, míg a második ábrán már egymás alatt.

1. CHOOSE A DATE

Set the date of your position and click the CHOOSE button!

2. CREATE YOUR PORTFOLIO

Choose product and then instruments from the drop list and set the amount of your position! By clicking to "+" / "trash button", instruments

3. CALCULATE THE RESULTS

Click the CALCULATE button to get the margin results of your created portfolio!

HUF 16 280 780

Margin requirement

2.42%

Margin ratio

3. CALCULATE THE RESULTS

Click the CALCULATE button to get the margin results of your created portfolio!

HUF 16 280 780

Margin requirement

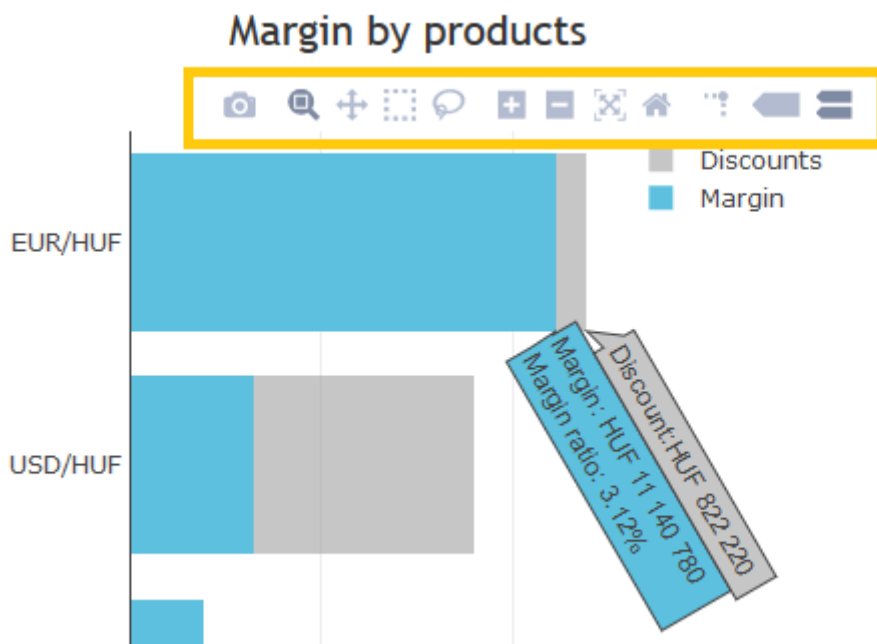
2.42%

Margin ratio

15. ábra: A felület elemei dinamikusan illeszkednek a kijelző méretéhez. Például az első képen az eredmények egymás mellett helyezkednek el, míg a második ábrán már egymás alatt.

Interaktív diagram és táblázat

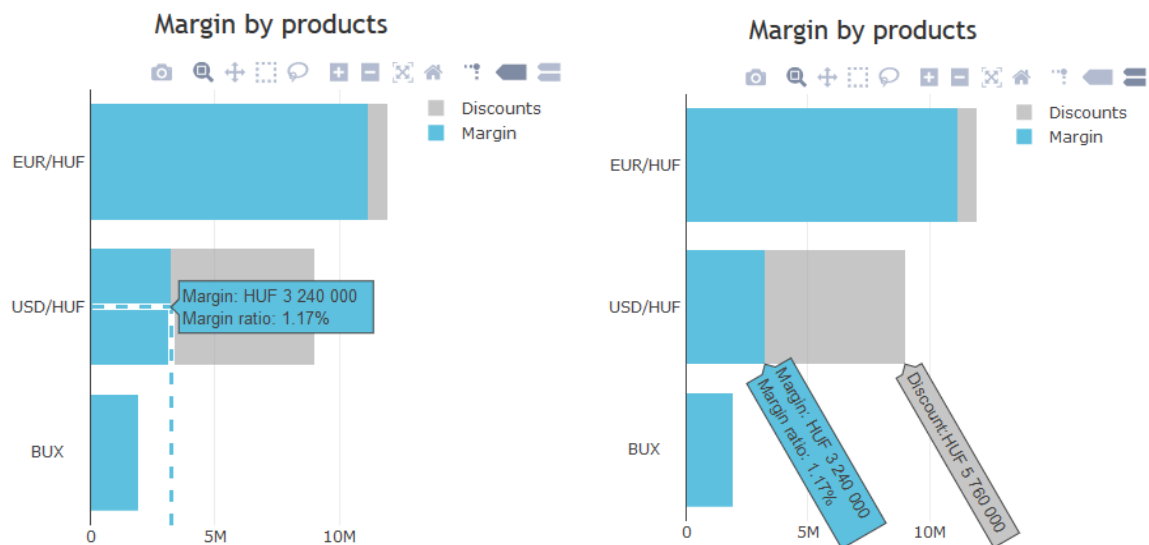
A felületen található ábráról interaktív módon további információkat kaphatunk. A 'Margin by products' ábrán az ezt támogató funkciók az ábra jobb felső sarkában villannak fel, amennyiben a kurzort az ábrára visszük.



16. ábra: Interaktivitás támogató ábra funkciók.

A felvillanó funkciók a következő lehetőségeket adják a felhasználók számára, balról jobbra haladva (a kurzort az egyes ikonokra mutatva az alábbi angol funkció megnevezéseket láthatjuk):

- Download plot as a png: Ábra mentése png formátumban
- Zoom: Az ábrán a kurzorral kijelölt terület nagyításra kerül, mely nézetből dupla kattintással léphetünk vissza a teljes ábra nézetre. Ha az ábrán további akciókat hajtottunk végre, akkor a Zoom gomb megnyomásával állíthatjuk vissza a nagyítása lehetőségét.
- Pan: bekapcsolja a mozgathatóságot, a kurzorral kattintva a diagram odébb tehető. Dupla kattintással visszajuthatunk az alapnézetre.
- Zoom in / Zoom out: Az ábra közepére nagyít / távolít.
- Autoscale / Reset axes: Visszahelyezi az ábrát az eredeti helyére.
- Toggle spike lines: x-y tengely metszéspont megjelenítése
- Show closest data on hover / Compare data on hover: a legközelebbi adatpont egyedüli, vagy logikailag hozzá tartozó másik adatponttal történő megjelenítése.



17. ábra: Példa adatmegjelenítésre 'Toggle spike lines' & ' Show closest data on hover', illetve 'Compare data on hover' beállítások esetén.

Product	Margin	Margin ratio
EUR/HUF	HUF 11 140 780	3.12%
USD/HUF	HUF 3 240 000	1.17%
BUX	HUF 1 900 000	5.11%

18. ábra: Termékenkénti megbontásban a pozíció biztosíték igénye és margin aránya.