

# ATLANTIK

**Přehled měn, které ATLANTIK finanční trhy, a.s. přijímá jako zajištění poskytnutého úvěru.**

Primárně jsou jako zajištění úvěru uznány měnové pozice v následujících měnách:

Název měny	Kód měny	Haircut v %
Česká koruna	CZK	0
Euro	EUR	5
Americký dolar	USD	5
Libra šterlinků	GBP	7
Maďarský forint	HUF	10
Švýcarský frank	CHF	7
Polský zloty	PLN	7
Ruský rubl	RUB	15
Nová turecká lira	TRY	10
Australský dolar	AUD	7
Kanadský dolar	CAD	7
Rumunské leu	RON	10
Jihoafriický rand	ZAR	8
Mexické peso	MXN	8
Chorvatská kuna	HRK	6
Čínský jüan	CNY	10

Na měnové pozice v ostatních měnách bude aplikován jednotný Haircut 15%.

## Výpočet požadovaného FX kolaterálu

Výpočet Požadovaného FX kolaterálu k měnovým pozicím je dán vztahem:

$$kol = \sum_i |FX_i| HC_i^{FX},$$

kde kol je Požadovaný FX kolaterál,

$HC_i^{FX}$  je Haircut na měnu  $i$ ,  $i \in \{CZK, EUR, USD, \dots\}$ ,

$FX_i$  je celková měnová pozice klienta v měně  $i$ ,

$$FX_i = m_i + CP_i,$$

kde  $m_i$  je zůstatek peněžního účtu klienta v měně  $i$ , kterou ATLANTIK finanční trhy, a.s. přijímá jako zajištění úvěru. Kreditní zůstatek ( $m_i > 0$ ) je se znaménkem +, debetní zůstatek ( $m_i < 0$ ) se znaménkem -.

$CP_i$  je celková měnová pozice všech investičních nástrojů, které ATLANTIK finanční trhy, a.s. přijímá jako zajištění úvěru v měně  $i$ . Long pozice je se znaménkem +, short pozice se znaménkem -.

## Požadované zajištění

Požadovaný FX kolaterál je srovnáván s Aktivy klienta.

Aktiva klienta jsou dána vztahem:

$$A = \sum_i FX_i,$$

kde A jsou Aktiva klienta,  
FX<sub>i</sub> je vysvětleno výše.

Je-li poměr **A / kol**:

- a) menší než 0,5 vyzve ATLANTIK finanční trhy, a.s. klienta k doplnění zajištění.
- b) menší než 0,3 provede ATLANTIK finanční trhy, a.s. uzavření klientových pozic.

Postupy v rámci bodu a) i b) jsou blíže popsány v oddíle IV ve Všeobecných obchodních podmínkách společnosti ATLANTIK finanční trhy, a.s.