

Tabuľka rolloverov 2024

Inštrument	Január	Február	Marec	April	Máj	Jún	Júl	August	September	Október	November	December
US30			13			13			18			18
US100			13			13			18			18
US500			13			13			18			18
US2000			13			13			18			18
UK100			14			20			19			19
DE30			14			20			19			19
DE40			14			20			19			19
EU50			14			20			19			19
FRA40	18	15	14	18	16	20	18	15	19	17	14	19
SPA35	18	15	14	18	16	20	18	15	19	17	14	19
ITA40			14			20			19			19
SUI20			14			20			19			19
W20			14			20			19			19
NED25	18	15	14	18	16	20	18	15	19	17	14	19
JP225			6			11			11			11
JAP225			6			11			11			11
NATGAS	18	21	20	23	23	17	18	22	17	17	21	17
OIL	25	21	21	23	23	19	25	22	17	24	21	17
KOSP200			12			11			11			11
AUS200			20			18			17			17
MEXComp			12			18			17			17
BRAComp		8		15		10		12		14		16
SOYBEAN		21		23		17				24		17
CORN		21		18		13					21	
OIL.WTI	17	13	13	17	15	12	18	14	17	17	12	12
HKComp	25	22	21	25	23	19	23	22	24	24	21	18
CHNComp	25	22	21	25	23	19	23	22	24	24	21	18
WHEAT		22		17		18		13			14	
COFFEE		8		16		11		7			7	
COCOA		7		10		6		7			7	

Inštrument	Január	Február	Marec	April	Máj	Jún	Júl	August	September	Október	November	December
SUGAR		8		18		12			12			
COTTON		7		16		6					7	
TNOTE		22			23			22			21	
BUND10Y		29			30				3			3
SCHATZ2Y		29			30				3			3
EMISS												5
USDDIX			13			13			12			12
VIET30	17	15	20	16	15	18	17	14	18	15	20	18
GASOLINE	17	13	13	16	15	12	17	13	12	17	12	12
LSGASOIL	18	13	20	17	16	12	18	13	18	17	12	12
AUT20			14			20			19			19
SOYOIL		21		17		17					14	12
LEANHOGS	17		12		9	11	23		12		12	
CATTLE	17		6		9		18		11		7	
VSTOXX	11	8	6	10	9	6	11	7	12	10	5	12
VIX	11	7	6	10	9	6	11	7	11	10	5	5

Rolovanie predstavuje presunutie ceny podkladového aktíva z aktuálneho futures kontraktu, ktorého platnosť čoskoro vyprší, na nasledujúci dlhodobý future kontrakt.

Keďže niektoré finančné inštrumenty, ponúkané spoločnosťou XTB S.A., akými sú indexy či komodity, vychádzajú z príslušných futures kontraktov a nemajú určenú splatnosť, musia sa pravidelne rolovať. XTB S.A. zavádza opravný mechanizmus, ktorým koriguje prechod na nový kontrakt pomocou swapových bodov. Tento mechanizmus predstavuje technickú korekciu ceny nástroja pomocou zvláštnej sadzby swapových bodov. Nejde preto o štandardné swapové body, o ktorých hovorí Tabuľka swapových bodov a Špecifikačná tabuľka inštrumentov.

Korekcia vyplýva zo špecifickosti trhu s niektorými nástrojmi, kde sa obchodné transakcie s dátumom dodania typu spot vyskytujú len zriedka a obchodovanie je sústredené na transakcie s jednomačným, dvojmačným a trojmačným dátumom dodania.

Vyššie uvedené termíny dodávok predstavujú posledný deň, v ktorom je daný inštrument kótovaný - deň prechodu na nový kontrakt. Tento termín vychádza z príslušného kontraktu futures. K rolovaniu kontraktu a korekcii ceny pomocou swapových bodov dochádza nasledujúci deň po polnoci. Od tohto dňa je kotácia príslušného inštrumentu založená na novom kontrakte futures.

Poznámka:

Účty zákazníkov, ktorí držia pozície na danom finančnom nástroji, budú v závislosti na danej pozícii (dlhej alebo krátkej) a type bázy medzi jednotlivými kontraktmi na základnom nástroji (kladná alebo záporná) upravené pomocou swapových bodov, ktoré vyplývajú z rolovania. V prípade, že je cena základného nástroja s dodávkou budúci mesiac vyššia než cena nástroja s dodávkou v tomto mesiaci, máme dočinenie s kladnou bazou. V opačnom prípade hovoríme o báze zápornej. Ak ide o kladnú bázu, bude účet zákazníka, ktorý v deň dodávky drží dlhú pozíciu na jednom z vyššie uvedených finančných nástrojov, zaťažený swapovými bodmi rovnajúcimi sa hodnote bázy, zatiaľ čo účet zákazníka, ktorý má v deň dodávky krátku pozíciu na jednom z vyššie uvedených finančných nástrojov, bude o rovnakú sumu navýšený. V prípade zápornej bázy bude účet zákazníka, ktorý má na konci dňa krátku pozíciu, zaťažený swapovými bodmi rovnajúcimi sa báze, zatiaľ čo účet zákazníka držiaceho dlhú pozíciu bude o rovnakú čiastku navýšený.

Je nutné mať na pamäti, že po započítaní swapových bodov, môže dôjsť k zmene hodnoty jednotlivých údajov na účte klienta. Pokiaľ bude báza príliš vysoká, môže sa stať, že dôjde k prekročeniu úrovne marže (50 %). V takom prípade dôjde k automatickému uzavretiu najstratovejšej pozície, popr. viacerých pozícií. Uzatváranie pozícií, tzv. Stop out na obchodnom účte potrvá do chvíle, kým sa úroveň marže nedostane späť na požadovanú výšku.

Majte tiež na pamäti, že čakajúce pokyny, ktorých otváracia cena sa nachádza medzi poslednou cenou pred rolloverom a otváracou cenou po rollovaní budú realizované na otváracej cene instrumentu. Ak chcete predísť podobnej situácii je potrebné odstrániť/upraviť čakajúce pokyny na instrumente v deň, kedy má prebehnúť rolovanie.