

Tabulka rolování pozic 2023

Instrument	Leden	Únor	Březen	Duben	Květen	Červen	Červenec	Srpen	Září	Říjen	Listopad	Prosinec
US30			15			14			13			13
US100			15			14			13			13
US500			15			14			13			13
US2000			15			14			13			13
UK100			16			15			14			14
DE30			16			15			14			14
EU50			16			15			14			14
FRA40	17	14	16	19	16	15	20	17	14	18	15	14
SPA35	17	14	16	19	16	15	20	17	14	18	15	14
ITA40			16			15			14			14
SUI20			16			15			14			14
W20			16			15			14			14
NED25	17	14	16	19	16	15	20	17	14	18	15	14
JAP225			9			6			6			6
JP225									6			6
HKComp	26	23	29	26	24	28	27	29	27	26	28	27
CHNComp	26	23	29	26	24	28	27	29	27	26	28	27
KOSP200			9			6			13			13
AUS200			15			13			14			20
MEXComp			15			14			13			13
BRAComp		9		10		12		15		17		12
NATGAS	19	16	23	20	23	22	20	24	21	24	21	21
OIL	24	22	16	20	24	22	20	24	20	25	21	21
OIL.WTI	18	16	16	18	18	15	18	17	14	17	16	13
SOYBEAN		22		19		22				26		20
WHEAT		16		13		22		15			16	
CORN		22		13		22		15			16	
COFFEE		9		11		13		10			9	
COCOA		2		5		6		3			8	

Instrument	Leden	Únor	Březen	Duben	Květen	Červen	Červenec	Srpen	Září	Říjen	Listopad	Prosinec
SUGAR		9		13		15			14			
COTTON		8		11		8					9	
TNOTE		23			25			29			28	
BUND10Y			2			6			6			6
SCHATZ2Y			2			6			6			6
EMISS												7
USDIDX			9			8			14			14
VIET30	19	14	15	19	17	14	19	16	14	19	16	21
GASOLINE	17	9	9	11	17	14	11	16	13	17	14	7
LSGASOIL	18	16	16	12	11	14	13	16	21	12	9	14
AUT20			16			15			14			14
SOYOIL		15		12		22					16	13
LEANHOGS	17		16		11	13	18		13		15	
CATTLE	10		9		11		18		13		9	
VSTOXX	12	9	9	18	11	8	13	10	14	12	7	14
VIX	5	8	8	11	9	8	13	9	13	12	7	7

Rolování pozic u finančních instrumentů navázaných na báze instrumentu podléhá termínu dodávky.

Vzhledem k tomu, že finanční nástroje, jako jsou indexy či komodity, vycházejí z příslušných futures kontraktů, zavádí XTB S.A. opravný mechanismus, který koriguje swapové body v okamžiku rolování data dodávky. Tento mechanismus představuje technickou korekci ceny nástroje pomocí zvláštní sazby swapových bodů. Cílem je očistit cenu od mimotržních faktorů spojených se změnou data dodání základního nástroje. Korekce vyplývá ze specifických podmínek trhu s některými nástroji kde se obchodní transakce s datem dodání typu spot vyskytují jen zřídka, a obchodování je soustředěno na transakce s jednoměsíčním, dvouměsíčním i tříměsíčním datem dodání. Data dodání pro základní nástroje jsou uvedeny v následující tabulkách.

Výše uvedené termíny dodávek představují poslední den, ve kterém je daný instrument kótovaný. Tento termín vychází z příslušného futures kontraktu.

K rolování kontraktu a korekci ceny pomocí swapových bodů dochází následující den po půlnoci. Od tohoto dne je kotace příslušného instrumentu založena na novém futures kontraktu.

Tabulka rolování má výlučně informativní charakter. XTB S.A. si vyhrazuje právo změnit datum rolování v případě změn podmínek na trhu podkladového aktiva nebo v případě jiných mimořádných událostí. Pokud dojde k takovým změnám, XTB S.A. bude klienty informovat prostřednictvím svých internetových stránek.

Poznámka:

Účty zákazníků, kteří drží pozice v daném finančním nástroji, budou v závislosti na dané pozici (dlouhé či krátké) a typu báze mezi jednotlivými kontrakty na základním nástroji (kladná nebo záporná) zatíženy nebo navýšeny o swapové body, jež z daného rolování vyplývají. V případě, že je cena základního nástroje s

dodávkou příští měsíc vyšší než cena tohoto nástroje s dodávkou v tomto měsíci, máme co do činění s kladnou bází. V opačném případě hovoříme o bázi záporné. Jedná-li se o kladnou bázi, bude účet zákazníka, který v den dodávky drží dlouhou pozici na jednom z výše uvedených finančních nástrojů, zatížen swapovými body rovnajícími se hodnotě báze, zatímco účet zákazníka jenž má v den dodávky krátkou pozici na jednom z výše uvedených finančních nástrojů, bude o tutéž částku navýšen. V případě záporné báze bude účet zákazníka, který má na konci dne krátkou pozici, zatížen swapovými body rovnajícími se bázi, zatímco účet zákazníka držícího dlouhou pozici bude o stejnou částku navýšen.

Je nutné mít na paměti, že po započítání swapových bodů, vezmeme-li v úvahu bázi, může dojít ke změně hodnoty jednotlivých údajů na účtu klienta. Pokud bude báze příliš vysoká, může se stát, že dojde k překročení úrovně marže, jejíž výši vyžadují obchodní podmínky (50%). V takovém případě dojde k automatickému uzavření pozic počínaje od nejztrátovější / nejméně ziskové pozice (stop out). Uzavírání pozic potrvá do chvíle, dokud se úroveň marže nedostane zpět na požadovanou výši.

Mějte rovněž na paměti, že čekající pokyny, jejichž otevírací cena se nachází v mezeře vzniklé v souvislosti s otevřením trhu na daném instrumentu, budou realizovány na otevírací ceně instrumentu. Pokud chcete předejít podobné situaci je zapotřebí odstranit/upravit čekající pokyny na instrumentu v den, kdy má proběhnout rolování.