

Tabulka rolování pozic 2024

Instrument	Leden	Únor	Březen	Duben	Květen	Červen	Červenec	Srpen	Září	Říjen	Listopad	Prosinec
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	

Instrument	Leden	Únor	Březen	Duben	Květen	Červen	Červenec	Srpen	Září	Říjen	Listopad	Prosinec
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
USDIDX			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

Rolování pozic u finančních instrumentů navázaných na bázecký instrument 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 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 pozicí potrvá do chvíle, dokud se úroveň marže nedostane zpět na požadovanou výši.