

Tabulka rolování pozic pro rok 2020

Instrument	Leden	Únor	Březen	Duben	Květen	Červen	Červenec	Srpen	Září	Říjen	Listopad	Prosinec
US30	-	-	18	-	-	17	-	-	16	-	-	16
US100	-	-	18	-	-	17	-	-	16	-	-	16
US500	-	-	18	-	-	17	-	-	16	-	-	16
US2000	-	-	18	-	-	17	-	-	16	-	-	16
UK100	-	-	19	-	-	18	-	-	17	-	-	17
DE30	-	-	19	-	-	18	-	-	17	-	-	17
EU50	-	-	19	-	-	18	-	-	17	-	-	17
FRA40	16	20	19	16	14	18	16	13	17	15	19	17
SPA35	16	20	19	16	14	18	16	13	17	15	19	17
ITA40	-	-	19	-	-	18	-	-	17	-	-	17
SUI20	-	-	19	-	-	18	-	-	17	-	-	17
W20	-	-	19	-	-	18	-	-	17	-	-	17
NED25	16	20	19	16	14	18	16	13	17	15	19	17
RUS50	-	-	17	-	-	16	-	-	15	-	-	15
JAP225	-	-	10	-	-	9	-	-	8	-	-	8
HKComp	21	25	24	27	26	23	28	25	28	27	24	29
CHNComp	21	25	24	27	26	23	28	25	28	27	24	29
KOSP200	-	-	10	-	-	9	-	-	8	-	-	8
AUS200	-	-	17	-	-	16	-	-	15	-	-	15
MEXComp	-	-	18	-	-	17	-	-	17	-	-	16
BRAComp	-	11	-	14	-	16	-	11	-	13	-	15
NATGAS	22	19	19	21	19	18	22	20	17	21	18	16
OIL	21	18	24	21	19	23	28	25	22	27	24	17
OIL.WTI	16	18	17	16,21	-	16	16	13	17	15	12	10
SOYBEAN	-	20	-	23	-	25	-	-	-	22	-	10
WHEAT	-	20	-	23	-	25	-	27	-	-	24	-
CORN	-	20	-	23	-	25	-	27	-	-	24	-
COFFEE	-	6	-	7	-	11	-	6	-	-	5	-
COCOA	-	6	-	7	-	11	-	6	-	-	5	-

Instrument	Leden	Únor	Březen	Duben	Květen	Červen	Červenec	Srpen	Září	Říjen	Listopad	Prosinec
SUGAR	-	6	-	7	-	11	-	-	9	-	-	-
COTTON	-	6	-	7	-	11	-	-	-	-	12	-
TNOTE	-	27	-	-	28	-	-	27	-	-	24	-
BUND10Y	-	-	4	-	-	4	-	-	2	-	-	2
SCHATZ2Y	-	-	4	-	-	4	-	-	2	-	-	2
VOLX	16	13	12	15	14	11	16	13	10	15	12	10
EMISS	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3
USDIDX	-	-	12	-	-	11	-	-	10	-	-	10
USFANG	-	-	18	-	-	17	-	-	16	-	-	16
AUT20	-	-	19	-	-	18	-	-	17	-	-	17

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 X-Trade Brokers 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 specifičnosti 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. X-Trade Brokers 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, X-Trade Brokers 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.

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.