

Tabulka rolování pozic 2025

Instrument	Leden	Únor	Březen	Duben	Květen	Červen	Červenec	Srpen	Září	Říjen	Listopad	Prosinec
US30			19			18			17			17
US100			19			18			17			17
US500			19			18			17			17
US2000			19			18			17			17
AUT20			20			19			18			18
DE40			20			19			18			18
EU50			20			19			18			18
ITA40			20			19			18			18
SUI20			20			19			18			18
UK100			20			19			18			18
W20			20			17			18			18
FRA40	16	20	20	17	15	19	17	14	18	16	20	18
NED25	16	20	20	17	15	19	17	14	18	16	20	18
SPA35	16	20	20	17	15	19	17	14	18	16	20	18
MEXComp			19			18			17			17
BRAComp		11		14		17		12		14		16
JP225			12			11			10			10
VIET30	15	19	19	15	14	18	16	20	17	15	19	17
USDIDX			13			12			11			11
VSTOXX	15	12	12	14	14	11	16	13	10	15	12	10
VIX	16	13	13	15	15	12	14	14	11	16	13	11
COCOA		11		9		10		12			12	
COFFEE		11		9		11		12			12	
CORN		18		15		17					18	

Instrument	Leden	Únor	Březen	Duben	Květen	Červen	Červenec	Srpen	Září	Říjen	Listopad	Prosinec
COTTON		11		9		11					12	
SOYBEAN		18		15		17			16			16
SOYOIL		18		15		17					18	11
SUGAR		11		9		11			16			
WHEAT		18		15		17		20			18	
EMISS												11
GASOLINE	16	17	13	14	15	12	14	13	16	14	13	16
LSGASOIL	22	18	18	17	21	24	22	20	23	21	20	17
NATGAS	22	18	18	17	21	24	22	20	23	21	20	17
OIL	22	18	18	17	21	24	22	20	23	21	20	17
OIL.WTI	16	13	13	14	15	12	14	13	16	14	13	16
CATTLE	15		12		14		15		16		19	
LEANHOGS	15		12		14	17	15		16		19	
BUND10Y			4			4			4			4
SCHATZ2Y			4			4			4			4
TNOTE		26			28			28			25	

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 specifčnosti 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 pozicí 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.