

Tabela rolowań 2020

Symbol	I	II	III	IV	V	VI	VII	VIII	IX	X	XI	XII
FUS30.												
FUS100.			12			11			10			10
FUS500.												
FJP225.			11			10			9			9
FUSD.												
FMSCIEM.			16			15			14			14
FGB100.												
FDE30.												
FEU50.												
FEU600.												
FEUBANKS.			19			18			17			17
FPL20.												
FCH20.												
FFR40.	16	20		16	14		16	20			19	
FNL25.									15			
FEUVOL.	21		17	14	19	16	21	17	15		17	15
FHK45.	29		26	27	27	24	29		28	28	26	29
FCN40.		26						27				
FCOPPER.				23		25					25	
FGOLD.	29		26				27				25	
FOIL.	15	13	17	16 22		17	16	17	17	15	17	16
FBRENT.	28	25	23	27	25	23	27	24	21	26	24	22
FNATGAS.	23		20	23			23			22		23
FGASOIL.	16	20	18	15	20	18	21	17	22	14	19	22
FEMISS.												10
FCORN.		24		20		25					23	
FWHEAT.				16		18		13			17	
FSOYBEAN.		20				23				22		23
FRICE.				23				20		21		21
FTNOTE10.					28						30	
FGILT10.		27						27			26	

FBUND10.											
FBOBL5.											
FSCHATZ2.			4			4			3		3
FOAT10.											
FBTP10.											
FSUGAR.				15		15			16		
FCOTTON.		12		13						12	
FCOCOA.		6		6		8		6		5	
FCOFFEE.		12		9		11		12		12	
FORANGE.		19		20		22		20		27	16

Instrumenty, których wycena oparta jest na kontraktach terminowych futures, podlegają rolowaniu zgodnie z poniższą tabelą. Rolowanie ma na celu zagwarantowanie, aby instrument bazowy na którym oparty jest instrument CFD dostępny na platformie BOSSAFX był możliwie jak najbardziej płynny. Wobec tego jeżeli aktualny kontrakt terminowy futures traci płynność na rzecz kolejnej serii wygasania kontraktu terminowego, wtedy przeprowadza się rolowanie. Między kontraktami sąsiadujących serii istnieje różnica kursu (baza), która korygowana jest jednorazowo w formie punktów swapowych. Rolowanie nie ma zatem żadnego wpływu na ostateczną wycenę rachunku, ponieważ jeżeli rachunek inwestora zostaje obciążony/uznany bazą, wtedy wyższa/nizsza wartość otwartej pozycji na instrumencie rekompensuje inwestorowi obciążenie/uznanie rachunku. Rolowanie może mieć za to wpływ na wystawione zlecenia oczekujące. Poniższa tabela zawiera orientacyjne daty rolowań, które mogą ulec zmianie z powodu niskiej płynności kontraktów bazowych. Ostateczne terminy rolowań, wraz z wstępnymi bazami, podawane są za pośrednictwem poczty wewnętrznej platformy (na rachunkach rzeczywistych i demo) w przeddzień rolowania.

Przykład:

15 stycznia 2020 miało miejsce rolowanie instrumentu FOIL., którego cena oparta jest o kontrakt terminowy futures na ropę naftową. Wygasający w lutym kontrakt został zamieniony na kontrakt serii marcowej. Kursy zamknięcia z dnia 10 stycznia dla kontraktów były następujące:

- seria lutowa: 60.26
- seria marcowa: 60.89

Różnica kursów między seriami wyniosła zatem 63 punkty. Oznacza to, że posiadacze długich pozycji zyskaliby dzięki rolowaniu 63 pipsy. Tyle samo straciliby wszyscy, którzy posiadali pozycje krótkie. Dzięki korekcie w postaci punktów swapowych wyniki posiadaczy pozycji długich i krótkich nie uległy zmianie. Załóżmy, że mamy otwartą krótką pozycję w instrumencie FOIL. zabezpieczoną zleceniem Stop Loss na poziomie 48.48. Jeżeli wiemy, że w wyniku rolowania kurs otwarcia będzie wyższy, to aby uniknąć zamknięcia pozycji powinniśmy odpowiednio zrewidować nasze zlecenie Stop Loss.