

Tabulka rollování pozic

Tabulka rolloverů obsahuje přehled dat, kdy u otevřených pozic dojde v budoucnu k převodu na kontrakt s delším datem expirace. I když je cenový rozdíl mezi původním a novým kontraktem kompenzován swapovými body (díky nimž cena původního nástroje navazuje na nově vypsany) mohou být touto operací ovlivněny čekající pokyny.

Tabulka rollování pozic 2021

BOSSA.CZ - TABULKA ROLOVÁNÍ 2021													
symbol	I	II	III	IV	V	VI	VII	VIII	IX	X	XI	XII	
FDE30.			18			17			16			16	
FEU50.													
FFR40.	14	18		15	20		15	19		14	18		
FGB100.													
FJP225.			10			9			8			8	
FUS100.			11			10			9			9	
FUS30.													
FUS500.													
FBOBLS.			4			3			6			6	
FBTP10.													
FBUND10.													
FEUVOL.	14	11	11	19	13	10	20	12	14	14	15	21	
FOAT10.			4			3			6			6	
FSCHATZ2.			3										
FGILT10.		25			25			26			29		
FTNOTE10.		25			27			30			30		
FUSD.			10			9			8			8	
FCH20.			18			17			16			16	
FEU600.													
FEUBANKS.													
FNL25.	14	18		15	20		15	19		14	18		
FCN40.	27	24	29	28	27	28	28	26	28	27	25	28	
FHK45.													
FPL20.			18			17			16			16	
FMSCIEM.			16			10			9			9	
FEMISS.												16	
FBRENT.	25	22	22	26	24	23	26	24	21	25	24	23	
FCOCOA.		3		5		3		5			4		
FCOFFEE.		10		12		9		11			11		
FCOPPER.		24		22		24		26			24		
FCORN.		22		20		23					23		
FCOTTON.		10		12		8					11		
FGASOIL.	13	18	18	19	19	21	20	17	22	13	24	23	
FNATGAS.	20		24	22	20	23	21	23		21	18		
FOIL.	14	17	17	15	17	17	15	17	16	14	16	15	
FORANGE.			20		17		19		21		16		
FRICE.		18		22		22		18		20		23	
FSOYBEAN.			15		28				25		27		
FSUGAR.		10		14		15		16					
FWHEAT.		18		15		17		12			17		
FGOLD.	26		25		25		27				23		

Příklad: na 19. ledna 2011 byl stanoven rollover pro nástroj FOIL, jehož cena je vázána na futures kontrakt na ropu. Kontrakt expirující v únoru byl nahrazen kontraktem expirujícím v březnu. 19. ledna byla zavírací cena:

Únorový kontrakt: 78,27

Březnový kontrakt: 78,90

Rozdíl mezi původním a nově vypsáním kontraktem je 63 bodů. To znamená, že držitelé dlouhých pozic by na této změně 63 pipů získali, zatímco držitelé krátkých pozic by stejné množství ztratili. V praxi je však držitelům dlouhých pozic příslušný počet bodů odečten a držitelům krátkých pozic přičten pomocí swapových bodů ve výši 63 bodů.

Pokud budeme mít umístěný stop loss na úrovni 78,60, měli bychom zvážit přenastavení této hodnoty na novou úroveň jinak bude naše pozice po ukončení rolloverové transakce uzavřena.