

Rolowania

Otwarte pozycje w kontraktach CFD opartych o ceny kontraktów futures będą rolowane, co oznacza, że instrumentem bazowym dla kontraktu CFD przestaje być wygasający kontrakt, a staje się nim kontrakt kolejnej serii. Z tego tytułu otwarte pozycje będą korygowane o odpowiednią wartość wynikającą z różnicy cen obu serii kontraktów, zwanej bazą (cena kolejnego kontraktu - cena wygasającego kontraktu). Wartość bazy będzie uwzględniana w punktach swapowych w dniu rolowania. Zwracamy uwagę, że wskazane w tabeli daty nie są wiążące i mogą ulec zmianie w zależności od aktualnych warunków rynkowych.

Nadchodzące rolowania (rzymskie cyfry oznaczają numery poszczególnych miesięcy):

Symbol	I	II	III	IV	V	VI	VII	Aktualna seria kontraktu
UK100.f			19			18		06.2026
DE30.f			19			18		06.2026
DE40.ns			17			16		06.2026
POL20.f			19			18		06.2026
POL20.ns			17			16		06.2026
EU50.f			19			18		06.2026
EU600.ns			17			16		06.2026
AUS200.ns			17			16		06.2026
US30.f			18			17		06.2026
US30.ns			18			17		06.2026
US100.f			18			17		03.2026
US100.ns			18			17		06.2026
US500.f			18			17		06.2026
US500.ns			18			17		06.2026
US2000.f			18			17		06.2026
US2000.ns			18			17		06.2026
USMID400.ns			16			15		06.2026

Symbol	I	II	III	IV	V	VI	VII	Aktualna seria kontraktu
US_FANG.ns			18			15		06.2026
DEMID50.ns			17			16		06.2026
SUI20.f			19			18		06.2026
SPA35.f	15	19	19	16	14	18	16	06.2026
ITA40.f			19			16		06.2026
JPN225.ns			5			4		06.2026
FRA40.f	15	19	19	16	14	18	16	06.2026
MEXICO.f			18			17		06.2026
NED25.f	15	19	19	16	14	18	16	06.2026
GOLD.ns	14		19		19			06.2026
SILVER.ns		18		21				05.2026
WTI.f	15	19	12	15	20	11	15	05.2026
WTI.ns	15	18	12	15	20	11	15	05.2026
BRENT.f	22	17	17	16	21	24	22	06.2026
BRENT.ns	22	17	17	16	21	24	22	06.2026
HEATOIL.ns	22	17	17	16	21	24	22	05.2026
GASOLINE.ns	22	17	17	16	21	24	22	05.2026
COCOA.US.f		10		14		10		03.2026
COFFEE.US.f		10		14		10		03.2026
ROBUSTA.ns		18		22				05.2026
COTTON.f		11		13		15		03.2026
SUGAR.US.f		10		14		10		03.2026
SOY.f		17		13		15		05.2026
CORN.f		17		13		15		05.2026
WHEAT.US.f		17		13		15		05.2026

Symbol	I	II	III	IV	V	VI	VII	Aktualna seria kontraktu
VOLXEU.ns	15	11	12	9	14			05.2026
LUMBER.ns		18		22				05.2026
VOLX.f	15	11	12	15	14	11	15	04.2026
VOLX.ns	15	11	12	13	14	11	15	04.2026
CO2.f								12.2026
USD_I.f			12			11		06.2026
NATGAS.f	22	19	17	15	20	17	22	05.2026
NATGAS.ns	22	19	17	15	20	17	22	05.2026
NATGASEU.ns	22	19	17	15	20	17	22	05.2026
TNOTE.f		25			28			06.2026
EURBUND.f			3			2		06.2026

Przykład:

Założmy, że inwestor zajmuje na początku września długą pozycję w kontrakcie CFD na 1000 baryłek (1 lot ropy WTI.f. Decyduje się on nie zamykać jej do końca miesiąca. Aby było to możliwe, 18 września jego pozycja musi zostać zrolowana, gdyż następnego dnia kontrakt wrześniowy stanowiący instrument bazowy dla CFD wygaśnie, zatem cena CFD będzie oparta o cenę kolejnego kontraktu - październikowego. Zakładając, że w dniu rolowania (18 września cena kontraktu wrześniowego jest wyższa od ceny kontraktu październikowego, to wówczas w efekcie rolowania wynik z pozycji klienta ulegnie pogorszeniu. W celu neutralizacji tego efektu do pozycji zostaną doliczone dodatnie punkty SWAP, które będą odpowiadały wartości straty z tytułu rolowania kontraktu skorygowanej o marżę.

Analogicznie w przypadku gdyby klient trzymał we wrześniu pozycję krótką na ropie, w efekcie rolowania znalazłby się na plusie. Dlatego w tej sytuacji jego pozycja zostanie obciążona ujemnymi punktami SWAP skorygowanymi o marżę. Mechanizm ten ma na celu zmniejszenie negatywnego bądź pozytywnego wpływu rolowania na wynik pozycji.