

Nawigator FX

wtorek, 28 marca 2017

Przykładowe kwotowania wybranych strategii zabezpieczających.

<p>EURPLN</p> <p>spot 4.254</p> <p>Strategie zabezpieczające (eksporter)</p> <p>1) Average Forward, 1y, miesięcznie *</p> <p style="text-align: right;">4.2894</p> <p>2) Forward Extra, 1y, miesięcznie**</p> <p style="text-align: right;">4.281</p> <p style="padding-left: 20px;">Knock-in 4,35</p> <p>3) Korytarz zerokosztowy***</p> <p>6m 4.25-4.2852</p> <p>6m 4.27-4.2633</p> <p>1y 4.25-4.3320</p> <p>1y 4.27-4.3070</p>	<p>USDPLN</p> <p>spot 3.9154</p> <p>Strategie zabezpieczające (eksporter)</p> <p>1) Average Forward, 1y, miesięcznie*</p> <p style="text-align: right;">3.917</p> <p>2) Forward Extra, 1y, miesięcznie**</p> <p style="text-align: right;">3.9036</p> <p style="padding-left: 20px;">Knock-in 3.9700</p> <p>3) Korytarz zerokosztowy***</p> <p>6m 3.85-3.9652</p> <p>6m 3.87-3.9438</p> <p>1y 3.85-3.9763</p> <p>1y 3.87-3.9527</p>
<p>GBPPLN</p> <p>spot 4.9237</p> <p>Strategie zabezpieczające (eksporter)</p> <p>1) Average Forward, 1y, miesięcznie*</p> <p style="text-align: right;">4.9412</p> <p>2) Forward Extra, 1y, miesięcznie**</p> <p style="text-align: right;">4.9319</p> <p style="padding-left: 20px;">Knock-in 5.0200</p> <p>3) Korytarz zerokosztowy***</p> <p>6m 4.87-4.9842</p> <p>6m 4.91-4.9425</p> <p>1y 4.87-5.0118</p> <p>1y 4.91-4.9678</p>	<p>USDCNH</p> <p>spot 6.8538</p> <p>Strategie zabezpieczające (eksporter)</p> <p>1) Average Forward, 1y, miesięcznie*</p> <p style="text-align: right;">6.9293</p> <p>2) Forward Extra, 1y, miesięcznie**</p> <p style="text-align: right;">6.9144</p> <p style="padding-left: 20px;">Knock-in 7.0000</p> <p>3) Korytarz zerokosztowy***</p> <p>6m 6.80-6.9913</p> <p>6m 6.85-6.9293</p> <p>1y 6.80-7.1221</p> <p>1y 6.85-7.0400</p>

* Klient sprzedaje EUR za PLN po uśrednionym kursie na rok, kontrakty rozliczane są na miesięcznie.

** Klient kupuje EUR put PLN Call z kursem rozliczenia X i jednocześnie sprzedaje EUR call PLN put po tym samym kursie rozliczenia X i barierą europejską typu "knock-in" Z, te same nominały w przypadku opcji Call i Put, czas trwania strategii 1 rok, rozliczenia następują miesięcznie.

** Klient kupuje EUR put PLN Call z kursem rozliczenia X i jednocześnie sprzedaje EUR call PLN put po kursie rozliczenia Y, te same nominały w przypadku opcji Call i Put, czas trwania strategii 1 rok, poszczególne opcje rozliczane są miesięcznie.