

Nawigator FX

środa, 29 marca 2017

Przykładowe kwotowania wybranych strategii zabezpieczających.

| | |
|---|---|
| <p>EURPLN</p> <p>spot 4.2434</p> <p>Strategie zabezpieczające (eksporter)</p> <p>1) Average Forward, 1y, miesięcznie *</p> <p>4.2788</p> <p>2) Forward Extra, 1y, miesięcznie**</p> <p>4.2686</p> <p>Knock-in 4,35</p> <p>3) Korytarz zerokosztowy***</p> <p>6m 4.23-4.2850</p> <p>6m 4.25-4.2630</p> <p>1y 4.23-4.3343</p> <p>1y 4.25-4.3089</p> | <p>USDPLN</p> <p>spot 3.9292</p> <p>Strategie zabezpieczające (eksporter)</p> <p>1) Average Forward, 1y, miesięcznie*</p> <p>3.9295</p> <p>2) Forward Extra, 1y, miesięcznie**</p> <p>3.9137</p> <p>Knock-in 3.9800</p> <p>3) Korytarz zerokosztowy***</p> <p>6m 3.85-3.9940</p> <p>6m 3.88-3.9615</p> <p>1y 3.85-4.0067</p> <p>1y 3.88-3.9707</p> |
| <p>GBPPLN</p> <p>spot 4.8788</p> <p>Strategie zabezpieczające (eksporter)</p> <p>1) Average Forward, 1y, miesięcznie*</p> <p>4.8964</p> <p>2) Forward Extra, 1y, miesięcznie**</p> <p>4.9949</p> <p>Knock-in 4.9300</p> <p>3) Korytarz zerokosztowy***</p> <p>6m 4.82-4.9440</p> <p>6m 4.86-4.9028</p> <p>1y 4.82-4.9724</p> <p>1y 4.86-4.9286</p> | <p>USDCNH</p> <p>spot 6.8538</p> <p>Strategie zabezpieczające (eksporter)</p> <p>1) Average Forward, 1y, miesięcznie*</p> <p>6.9293</p> <p>2) Forward Extra, 1y, miesięcznie**</p> <p>6.9144</p> <p>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.