

Nawigator FX

czwartek, 30 marca 2017

Przykładowe kwotowania wybranych strategii zabezpieczających.

<p>EURPLN</p> <p>spot 4.227</p> <p>Strategie zabezpieczające (eksporter)</p> <p>1) Average Forward, 1y, miesięcznie *</p> <p style="text-align: right;">42630</p> <p>2) Forward Extra, 1y, miesięcznie**</p> <p style="text-align: right;">4.2535</p> <p style="padding-left: 20px;">Knock-in 4.3300</p> <p>3) Korytarz zerokosztowy***</p> <p>6m 4.20-4.2840</p> <p>6m 4.22-4.2626</p> <p>1y 4.20-4.3353</p> <p>1y 4.22-4.3105</p>	<p>USDPLN</p> <p>spot 3.936</p> <p>Strategie zabezpieczające (eksporter)</p> <p>1) Average Forward, 1y, miesięcznie*</p> <p style="text-align: right;">3.9365</p> <p>2) Forward Extra, 1y, miesięcznie**</p> <p style="text-align: right;">3.9237</p> <p style="padding-left: 20px;">Knock-in 3.9900</p> <p>3) Korytarz zerokosztowy***</p> <p>6m 3.85-4.0077</p> <p>6m 3.88-3.9757</p> <p>1y 3.85-4.0213</p> <p>1y 3.88-3.9852</p>
<p>GBPPLN</p> <p>spot 4.8894</p> <p>Strategie zabezpieczające (eksporter)</p> <p>1) Average Forward, 1y, miesięcznie*</p> <p style="text-align: right;">4.9075</p> <p>2) Forward Extra, 1y, miesięcznie**</p> <p style="text-align: right;">4.9014</p> <p style="padding-left: 20px;">Knock-in 4.9900</p> <p>3) Korytarz zerokosztowy***</p> <p>6m 4.85-4.9360</p> <p>6m 4.88-4.9047</p> <p>1y 4.85-4.9628</p> <p>1y 4.88-4.9298</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.