

Nawigator FX

piątek, 31 marca 2017

Przykładowe kwotowania wybranych strategii zabezpieczających.

<p>EURPLN</p> <p>spot 4.2176</p> <p>Strategie zabezpieczające (eksporter)</p> <p>1) Average Forward, 1y, miesięcznie *</p> <p style="text-align: right;">4.2537</p> <p>2) Forward Extra, 1y, miesięcznie**</p> <p style="text-align: right;">4.2446</p> <p style="padding-left: 20px;">Knock-in 4.3200</p> <p>3) Korytarz zerokosztowy***</p> <p>6m 4.20-4.2652</p> <p>6m 4.22-4.2427</p> <p>1y 4.20-4.3161</p> <p>1y 4.22-4.2963</p>	<p>USDPLN</p> <p>spot 3.947</p> <p>Strategie zabezpieczające (eksporter)</p> <p>1) Average Forward, 1y, miesięcznie*</p> <p style="text-align: right;">3.9485</p> <p>2) Forward Extra, 1y, miesięcznie**</p> <p style="text-align: right;">3.9347</p> <p style="padding-left: 20px;">Knock-in 4.0000</p> <p>3) Korytarz zerokosztowy***</p> <p>6m 3.90-3.9768</p> <p>6m 3.93-3.9446</p> <p>1y 3.90-3.9854</p> <p>1y 3.93-3.9503</p>
<p>GBPPLN</p> <p>spot 4.9164</p> <p>Strategie zabezpieczające (eksporter)</p> <p>1) Average Forward, 1y, miesięcznie*</p> <p style="text-align: right;">4.9347</p> <p>2) Forward Extra, 1y, miesięcznie**</p> <p style="text-align: right;">4.9247</p> <p style="padding-left: 20px;">Knock-in 5.0200</p> <p>3) Korytarz zerokosztowy***</p> <p>6m 4.86-4.9806</p> <p>6m 4.90-4.9387</p> <p>1y 4.86-5.0101</p> <p>1y 4.90-4.9655</p>	<p>USDCNH</p> <p>spot 6.8831</p> <p>Strategie zabezpieczające (eksporter)</p> <p>1) Average Forward, 1y, miesięcznie*</p> <p style="text-align: right;">6.9608</p> <p>2) Forward Extra, 1y, miesięcznie**</p> <p style="text-align: right;">6.9497</p> <p style="padding-left: 20px;">Knock-in 7.0000</p> <p>3) Korytarz zerokosztowy***</p> <p>6m 6.80-7.0607</p> <p>6m 6.85-6.9987</p> <p>1y 6.80-7.2061</p> <p>1y 6.85-7.1224</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.