

Maklumat & Pengiraan Gulung Matang Komoditi dan Indeks

Apabila kontrak niaga hadapan menghampiri tarikh luputnya, 24ForexMarket akan memindahkan semua kedudukan terbuka ke kontrak boleh niaga seterusnya pada masa yang dinyatakan dalam bahagian tarikh peralihan CFD di Platform Perdagangan kami. Tarikh gulung matang adalah unik untuk setiap jenis kontrak yang didagangkan dan berbeza-beza dalam tempoh. Pelanggan dengan kedudukan terbuka yang tidak mahu kedudukan mereka digulung ke kontrak seterusnya harus menutup kedudukan mereka sebelum jadual Gulung Matang 'Rollover' (tarikh Rollover tersedia untuk pelanggan di bahagian Bantuan di Laman Web kami, dalam bahagian "Adakah CFD niaga hadapan mempunyai tamat tempoh, dan jika ya, bila" bahagian).

Pelanggan akan dikenakan bayaran yang sama seperti menutup kontrak lama dan membuka yang baru secara manual. Yuran ini termasuk kos spread untuk menutup kontrak lama dan membuka kontrak baru ditambah dengan caj faedah semalaman (Ini adalah swap panjang dan swap jumlah pendek yang ditunjukkan pada spesifikasi aset).

Dalam kebanyakan kes, kadar (harga bida /tawar) kontrak baru akan berbeza dari kontrak lama. Oleh itu, syarikat mengambil langkah berjaga-jaga yang perlu agar pelanggan tidak dibebani dengan perbezaan harga pada kedudukan barunya. Oleh itu, pelarasan gulung matang akan berlaku secara automatik pada akaun pelanggan untuk memastikan kedua-dua pelanggan dan syarikat tidak mendapat manfaat atau kurang bernasib baik daripada gulung matang itu.

Untuk mengira jumlah pelarasan gulung matang, kadar kontrak lama dan kontrak baru akan digunakan pada masa yang sama sebelum kontrak tamat. Oleh itu, perbezaan harga antara kontrak dan spread akan diambil kira. Jumlah gulung matang yang terhasil akan didebitkan atau dikreditkan ke akaun pelanggan sebagai pelarasan gulung matang. Pengiraan adalah seperti berikut:

Kedudukan beli:

$$(\text{Volum1} * - (\text{Harga bida (kontrak baru)} - \text{Harga bida (Kontrak lama)})) + (\text{Volum} * -\text{Spread}) * \text{Kadar Pertukaran2}$$

Kedudukan jual:

$$(\text{Volum} * (\text{Harga tawar (kontrak baru)} - \text{Harga tawar (kontrak lama)})) + (\text{Volum} * -\text{Spread}) * \text{Kadar Pertukaran}$$

Peraturan umum yang dipertimbangkan untuk menentukan sama ada amaun yang akan didebitkan atau dikreditkan ditunjukkan di bawah:

Jika (harga kontrak baru kurang daripada harga kontrak lama) debit untuk pendek, kredit untuk panjang

Jika (harga kontrak baru lebih besar daripada harga kontrak lama) debit untuk panjang, kredit untuk pendek

1 Volum = Lot * Saiz kontrak

2 Semua Pelarasan Rollover dikira dalam mata wang Instrumen didenominasi. Jika akaun didenominasi dalam mata wang yang berbeza, sistem akan secara automatik menukar ini kepada mata wang akaun menggunakan kadar pasaran pada masa itu.

Contoh 1

Pelanggan dengan akaun GBP memegang kedudukan beli 10 kontrak pada indeks prestasi DAX (Mata wang instrumen: EUR). Pada masa gulung matang 'rollover', kadar DAX adalah seperti berikut:

Bida (kontrak sedia ada) = 12,228.00, Tawar (kontrak sedia ada) = 12,231.00

Bida (kontrak baru) = 12,232.00, Tawar (kontrak baru) = 12,236.00

Dalam kes di atas, formula terpakai seperti berikut:

$(\text{Volum} * - (\text{Harga bida (kontrak baru)} - \text{Harga bida (Kontrak lama)})) + (\text{Volum} * - \text{Spread}) * \text{Kadar Pertukaran}$

$(10 * - (12,232 - 12,228) + (10 * (12,232 - 12,236))) * 0.9 = -£72.00$

Akibatnya, pelanggan terus memegang kedudukan panjang yang sama dengan 10 kontrak DAX dan akaunnya akan didebitkan dengan £72.00.

Contoh 2

Pelanggan dengan akaun GBP memegang kedudukan jual 1000 tong pada minyak mentah manis ringan (Mata wang instrumen: USD). Pada masa gulung matang 'rollover', kadar CL adalah seperti berikut:

Bida (kontrak sedia ada) = 61.74, Tawar (kontrak sedia ada) = 61.87

Bida (kontrak baru) = 61.95, Tawar (kontrak baru) = 62.15

Dalam kes di atas, formula terpakai seperti berikut:

$(\text{Volum} * (\text{Harga tawar (kontrak baru)} - \text{Harga tawar (kontrak lama)})) + (\text{Volum} * \text{-Spread}) * \text{Kadar Pertukaran}$

$$(1000 * (62.15 - 61.87) + 1000 * (61.95 - 62.15)) * 0.78 = \text{£}62.40$$

Akibatnya, pelanggan terus memegang kedudukan pendek yang sama sebanyak 1000 tong CL dan akaunnya akan dikreditkan dengan £62.40.