

PARAMETRY KONFIGURACYJNE APLIKACJI PC-SPAN

Parametry zawarte w zakładce *Calculation Parameters – Currency* po otwarciu menu *Tools – Preferences*:

Native Currency: PLN

Conversion Currency: PLN

To Convert to Native Currency: zaznaczone *Use Rate from SPAN File*

Parametry zawarte w zakładce *Calculation Parameters – Advanced* po otwarciu menu *Tools – Preferences*:

Default Volatility: 0.150000

Default Interest Rate: 0.016000

Look Ahead Years: 0.002740

Days Per Year: 365

Use yield-based volatilities - odznaczone

Use dollar-denominated greeks – odznaczone

Konfiguracja po otwarciu menu *Tools – Organization Master*:

- jeżeli w zakładce *Clearing Organization Master* brakuje rekordu KDPW – KDPW_CCP:

- kliknąć prawym przyciskiem myszy na zakładce *Clearing Organization Master* i wybrać *New Clearing Organization Master*

- uzupełnić pola w sposób następujący:

Clearing Organization Acronym: KDPW

Clearing Organization Name: KDPW_CCP

Gross Margining Clearing Organization: odznaczone

Do Contract Scaling: odznaczone

Do Intercommodity Spreading: zaznaczone

Limit Option Value to Offsetting Risk for Each Combined Commodity: odznaczone

Calculate SOM using GROSS method: zaznaczone

Aggregate SOM by Position Type: zaznaczone

Load Combined Commodity Redefinition Records (Record Type R): odznaczone

Load Scan-Based Spreads: zaznaczone

Limit SubAccount Offset: odznaczone

Use LOV to offset risk in CUST accounts: zaznaczone

Fraction of LOV which can be used to offset risk: 1.00000

Prefix Combined Commodities names during PAR file load: odznaczone

Default weighted risk calculation method: NORMAL

Rounding Convention: wybrane Four Decimal Rounding

- jeżeli w zakładce *Clearing Organization Master* w rekordzie KDPW – KDPW_CCP brakuje:

BS – BondSpot

- kliknąć prawym przyciskiem myszy na rekord KDPW – KDPW_CCP i wybrać *New Exchange Master*

- uzupełnić pola:

Exchange Acronym: BS

Exchange Name: BondSpot

Exchange Code: BS

BSA – BondSpot ASO

- kliknąć prawym przyciskiem myszy na rekord KDPW – KDPW_CCP i wybrać *New Exchange Master*

- uzupełnić pola:

Exchange Acronym: BSA

Exchange Name: BondSpot ASO

Exchange Code: BA

GPA – GPW ASO

- kliknąć prawym przyciskiem myszy na rekord KDPW – KDPW_CCP i wybrać *New Exchange Master*

- uzupełnić pola:

Exchange Acronym: GPA

Exchange Name: GPW ASO

Exchange Code: GA

GPW – Warsaw Stock Exchange

- kliknąć prawym przyciskiem myszy na rekord KDPW – KDPW_CCP i wybrać *New Exchange Master*

- uzupełnić pola:

Exchange Acronym: GPW

Exchange Name: Warsaw Stock Exchange

Exchange Code: GP

PN - PN

- kliknąć prawym przyciskiem myszy na rekord KDPW – KDPW_CCP i wybrać *New Exchange Master*

- uzupełnić pola:

Exchange Acronym: PN

Exchange Name: PN

Exchange Code: PN