

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: 0.200000

Default Interest Rate: 0.05000

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

TBS – Treasury BondSpot

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

→ uzupełnić pola:

Exchange Acronym: TBS

Exchange Name: Treasury BS

Exchange Code: TB