

Tabela punktów swapowych

Obowiązuje w dniach 2021.08.09 – 2021.08.15 Opublikowane punkty swapowe są naliczane w minimalnym kroku notowań dla danego instrumentu.

Instrument	Długa pozycja	Krótką pozycja
EURUSD	-5.3253	-0.6861
CADCHF	-0.0112	-0.4244
CADJPY	-0.1488	-0.3488
CHFJPY	-0.5172	-0.1118
EURCAD	-0.8151	-0.0655
EURCHF	-0.2679	-0.3293
EURGBP	-0.3912	-0.0647
EURJPY	-5.2145	-1.5824
GBPCHF	-0.0600	-0.6227
GBPJPY	-0.3077	-0.4679
GBPUSD	-3.4890	-3.3635
USDCAD	-0.4179	-0.2751
USDCHF	-0.2673	-4.4037
USDJPY	-2.0182	-3.2718
AUDCHF	-0.0477	-0.2939
AUDCAD	-0.3457	-0.1613
AUDJPY	-0.1821	-0.2046
AUDUSD	-0.2022	-0.1389
CHFPLN	-2.0720	-0.3738
EURCZK	-1.6216	0.1058
EURHUF	-2.8217	-0.2853
EURNOK	-4.9212	-1.1942
EURNZD	-0.8377	-0.1536
EURPLN	-2.1068	-0.5360
EURSEK	-4.7109	-1.8165
GBPAUD	-0.3905	-0.5360
GBPNZD	-0.5904	-0.5451
GBPLN	-1.4016	-1.6241
NZDJPY	-0.1674	-0.2662
NZDUSD	-0.1872	-0.1969
USDCZK	-0.9051	-0.2878
USDNOK	-2.2283	-2.5756
USDPLN	-0.9399	-1.1350
USDSEK	-2.0992	-3.0650
USDTRY	-82.6832	18.1995

EURZAR	-51.7036	1.6686
USDZAR	-40.7629	-1.1350
NZDCHF	-0.0402	-0.3395
USDMXN	-50.7403	0.7000
CHFTRY	-92.6136	21.8054
GBPCAD	-0.6115	-0.3975
AUDNZD	-0.3376	-0.2328
EURAUD	-0.6530	-0.1599
EURTRY	-99.5154	23.1981
USDHUF	-1.7388	-0.7695
NZDCAD	-0.3226	-0.2347
SILVER	-0.1283	-0.1138
GOLD	-9.3527	-8.2884
COPPER.UK	-0.1376	-0.0805
ZINC	-0.0436	-0.0255

Maksymalna wielkość marży na stopę procentową przy kalkulacji punktów swapowych została określona w Tabeli Opłat i Prowizji dla danej usługi. Do ustalenia w/w Punktów Swapowych TMS Brokers zastosował marżę w wysokości:

TMS	
Wysokość prowizji na stopy procentowe uwzględniana przy kalkulacji punktów swapowych	
EURTRY, USDTRY, EURZAR, USDZAR, USDMXN, EURTRY, CHFTRY	4.00%
Pozostałe FX, ZINC	0.40%
GOLD, SILVER, COPPER.UK	1.80%

Wzory na obliczanie punktów swapowych CFD opartych o waluty, kryptowaluty, złoto, srebro oraz miedź (punkty swapowe dla CFD opartych o wartość kryptowalut, złota, srebra oraz miedzi są wyliczane w oparciu formułę właściwą dla wyznaczania punktów swapowych dla instrumentów o charakterze walutowym, z takim jednak zastrzeżeniem, że oprocentowanie wyznaczane jest tylko dla jednej waluty, w której kwotowany jest instrument bazowy).

$$long\ swap = -(kurs\ spot_{BID} \times \frac{(1 + (stopa\ \% waluty\ kwotowanej_{ASK} + marża) \times \frac{1}{T})}{(1 + (stopa\ \% waluty\ bazowej_{BID} - marża) \times \frac{1}{T})} - kurs\ spot_{BID}) \times mnożnik$$

$$short\ swap = (kurs\ spot_{ASK} \times \frac{(1 + (stopa\ \% waluty\ kwotowanej_{BID} - marża) \times \frac{1}{T})}{(1 + (stopa\ \% waluty\ bazowej_{ASK} + marża) \times \frac{1}{T})} - kurs\ spot_{ASK}) \times mnożnik$$

Dom Maklerski TMS Brokers SA, Złote Tarasy (Budynek Skylight), ul. Złota 59, 00-120 Warszawa
tel. (22) 27 66 200, fax (22) 27 66 202, dommaklerski@tms.pl, www.tms.pl

Dom Maklerski TMS Brokers SA, podlega Komisji Nadzoru Finansowego. Spółka zarejestrowana przez Sąd Rejonowy dla m.st. Warszawy w Warszawie, XII Wydział Gospodarczy Krajowego Rejestru Sądowego pod numerem KRS 0000204776
Kapitał zakładowy: 3.537.560 zł, kapitał wpłacony: 3.537.560 zł, NIP: 526-27-59-131, REGON: 015715078

long swap - wartość punktów swap naliczanych dla pozycji długiej;

short swap – wartość punktów swap naliczanych dla pozycji krótkiej;

kurs spot BID,ASK – kurs danej pary walutowej w momencie kalkulowania punktów swapowych BID lub ASK;

marża – wielkość prowizji, jaką TMS Brokers nakłada na stopę procentową;

T - oznacza ilość dni wg przyjętej dla danej waluty konwencji (np. dla USD rok ma 360 dni, podczas gdy dla PLN 365 dni);

mnożnik - współczynnik wynikający z minimalnego kroku notowań, np. dla EURUSD minimalny krok notowań to 0.00001 dlatego mnożnik w przypadku kalkulacji punktów swapowych będzie wynosił 100 000;

stopa % waluty bazowej/kwotowanej BID,ASK - dla wyznaczania stopy procentowej TMS Brokers przyjmuje kwotowania z rynku międzybankowego na podstawie instrumentów przedstawionych w poniższej tabeli:

Waluta	Symbol w Bloomberg	Konwencja liczenia dni (T)	Nazwa stopy Procentowej
EUR	EUDR1Z CMPN Curncy	360	Euro 1 Week Deposit
USD	USDR1Z CMPN Curncy	360	United States Dollar 1 Week Deposit
PLN	PZDR1Z CMPN Curncy	365	Polish Zloty 1 Week Deposit
CAD	CDDR1Z CMPN Curncy	360	Canadian Dollar 1 Week Deposit
JPY	JYDR1Z CMPN Curncy	360	Japanese Yen 1 Week Deposit
GBP	BPDR1Z CMPN Curncy	365	British Pound 1 Week Deposit
CHF	SFDR1Z Curncy	360	Swiss Franc 1 Week Deposit
AUD	ADDR1Z CMPN Curncy	360	Australian Dollar 1 Week Deposit
NZD	NDDR1Z CMPN Curncy	360	New Zealand Dollar 1 Week Deposit

CZK	CKDR1Z Curncy	360	Czech Koruna 1 Week Deposit
SEK	SKDR1Z Curncy	360	Swedish Krona 1 Week Deposit
NOK	NKDR1Z Curncy	360	Norwegian Krone 1 Week Deposit
ZAR	SADR1Z CURRENCY	360	South African Rand 1 Week Deposit
HUF	HFDR1Z Curncy	360	Hungarian Forint 1 Week Deposit
RON	RNDR1Z CMPN Curncy	360	Romanian Leu 1 Week Deposit
HKD	HDDR1Z Curncy	360	Hong Kong Dollar 1 Week Deposit
TRY	TYDR1Z CMPN Curncy	360	Turish Lira 1 Week Deposit
MXN	MXNI1M CMPN Curncy	360	Mexican Peso 1 Month Froward Implied Yeld

Przykład.

Kalkulacja dla EURUSD

kurs spot BID : 1,2114

kurs spot ASK : 1,2115

T: 360

Marża: 0,65%

stopa % waluty bazowej BID : -0,5%

stopa % waluty bazowej ASK : -0,37%

stopa % waluty kwotowanej BID : 1,74%

stopa % waluty kwotowanej ASK : 1,82%

$$long\ swap = - \left(1,2114 \times \frac{\left(1 + (1,82\% + 0,65\%) \times \frac{1}{360}\right)}{\left(1 + ((-0,5\%) - 0,65\%) \times \frac{1}{360}\right)} - 1,2114 \right) \times 100000 = -12,1817$$

$$short\ swap = \left(1,2115 \times \frac{\left(1 + (1,74\% - 0,65\%) \times \frac{1}{360}\right)}{\left(1 + ((-0,37\%) + 0,65\%) \times \frac{1}{360}\right)} - 1,2115 \right) \times 100000 = 2,7259$$

Wzory na obliczanie punktów swapowych dla CFD opartych o wartość akcji i ETF.

$$\text{long swap} = -\text{kurs spot}_{\text{BID}} \left((\text{stopa \%} + \text{marża}) \times \frac{1}{T} \right) \times \text{mnożnik}$$

$$\text{short swap} = \text{kurs spot}_{\text{ASK}} \left((\text{stopa \%} - \text{marża}) \times \frac{1}{T} \right) \times \text{mnożnik}$$

long swap - wartość punktów swap naliczanych dla pozycji długiej;

short swap – wartość punktów swap naliczanych dla pozycji krótkiej;

kurs spot BID,ASK – kurs danej pary walutowej w momencie kalkulowania punktów swapowych BID lub ASK;

marża – wielkość prowizji, jaką TMS Brokers nakłada na stopę procentową;

T - oznacza ilość dni wg przyjętej dla danej waluty konwencji (np. dla USD rok ma 360 dni, podczas gdy dla PLN 365 dni);

mnożnik – współczynnik wynikający z minimalnego kroku notowań, np. dla EURUSD minimalny krok notowań to 0.00001 dlatego mnożnik w przypadku kalkulacji punktów swapowych będzie wynosił 100 000;

stopa % waluty kwotowanej BID,ASK - dla wyznaczania stopy procentowej TMS Brokers przyjmuje kwotowania z rynku międzybankowego na podstawie instrumentów przedstawionych w poniższej tabeli:

Waluta	Ticker w Bloomberg	Konwencja liczenia dni (T)	Opis
USD	US0001M Index	360	ICE LIBOR USD 1 Month
EUR	EE0001M Index	360	ICE LIBOR EUR 1 Month
PLN	WIBR1M Index	365	GPW Benchmark WIBOR PLN 1 Month
GBP	BP0001M Index	365	ICE LIBOR GBO 1 Month