

Tabela punktów swapowych

Obowiązuje w dniach 2019.03.04 - 2019.03.10 Opublikowane punkty swapowe są naliczane w minimalnym kroku notowań dla danego instrumentu.

Instrument	Długa pozycja	Krótka pozycja
EURUSD.pro	-11.4297	6.3287
CADCHF.pro	3.5524	-8.0042
CADJPY.pro	2.3349	-6.2814
CHFJPY.pro	-5.9902	-0.2794
EURCAD.pro	-12.6531	5.2376
EURCHF.pro	-1.3239	-5.2959
EURGBP.pro	-4.6570	0.7035
EURJPY.pro	-3.9447	-1.9020
GBPCAD.pro	-9.0580	0.8095
GBPCHF.pro	2.7380	-10.1568
GBPJPY.pro	0.1856	-6.6686
GBPUSD.pro	-9.0457	3.3979
USDCAD.pro	-0.5175	-5.5815
USDCHF.pro	6.8405	-12.3472
USDJPY.pro	5.4684	-10.2539
AUDCHF.pro	3.0127	-7.5042
AUDCAD.pro	-2.8006	-2.3037
AUDJPY.pro	1.8264	-5.8755
AUDNZD.pro	-3.0934	-2.8337
AUDUSD.pro	-3.3048	-0.2361
CHFPLN.pro	-3.7167	1.3866
EURAUD.pro	-13.3375	4.8018

EURCZK.pro	-2.0785	0.9113
EURHUF.pro	-1.1588	-0.3951
EURNOK.pro	-5.4775	0.5424
EURNZD.pro	-13.9754	5.3226
EURPLN.pro	-3.2519	1.0357
EURSEK.pro	-3.1334	-2.9287
EURTRY.pro	-523.0444	338.7284
GBPAUD.pro	-9.5077	-0.0220
GBPNZD.pro	-10.0039	0.3547
GBPLN.pro	-2.1686	-0.3021
NZDJPY.pro	1.9025	-5.6871
NZDUSD.pro	-3.0424	-0.2646
USDCZK.pro	-0.0251	-0.9296
USDHUF.pro	1.2080	-2.4866
USDNOK.pro	2.0571	-6.1246
USDPLN.pro	0.1648	-1.9941
USDSEK.pro	4.6756	-9.7146
USDTRY.pro	-418.0439	257.2999
EURZAR.pro	-55.2636	9.8724
USDZAR.pro	-37.3559	-2.2167
SILVER.pro	-1.1810	0.8666
GOLD.pro	-10.0434	7.3642
COPPER.pro	-0.4978	0.3650
EURUSD.std	-13.3190	4.4395
CADCHF.std	2.2986	-9.2581

CADJPY.std	0.9340	-7.6823
CHFJPY.std	-7.8525	-2.1417
EURCAD.std	-15.1671	2.7235
EURCHF.std	-3.2153	-7.1873
EURGBP.std	-6.0770	-0.7166
EURJPY.std	-6.0579	-4.0153
GBPCAD.std	-11.9682	-2.1008
GBPCHF.std	0.5486	-12.3461
GBPJPY.std	-2.2607	-9.1151
GBPUSD.std	-11.2327	1.2107
USDCAD.std	-2.7352	-7.7993
USDCHF.std	5.1721	-14.0156
USDJPY.std	3.6042	-12.1182
AUDCHF.std	1.8313	-8.6859
AUDCAD.std	-4.3711	-3.8745
AUDJPY.std	0.5061	-7.1958
AUDNZD.std	-4.8280	-4.5685
AUDUSD.std	-4.4852	-1.4163
CHFPLN.std	-4.3435	0.7593
EURAUD.std	-16.0051	2.1341
EURCZK.std	-2.5056	0.4841
EURHUF.std	-1.6855	-0.9220
EURNOK.std	-7.1046	-1.0848
EURNZD.std	-16.7521	2.5456
EURPLN.std	-3.9635	0.3241

EURSEK.std	-4.8905	-4.6860
EURTRY.std	-528.1401	333.6319
GBPAUD.std	-12.5957	-3.1103
GBPNZD.std	-13.2180	-2.8600
GBPLN.std	-2.9922	-1.1262
NZDJPY.std	0.6342	-6.9556
NZDUSD.std	-4.1762	-1.3985
USDCZK.std	-0.4018	-1.3064
USDHUF.std	0.7434	-2.9513
USDNOK.std	0.6219	-7.5600
USDPLN.std	-0.4629	-2.6218
USDSEK.std	3.1257	-11.2647
USDTRY.std	-422.5360	252.8074
EURZAR.std	-56.6098	8.5261
USDZAR.std	-38.5434	-3.4042
SILVER.std	-1.3071	0.7404
GOLD.std	-11.1157	6.2918
COPPER.std	-0.5510	0.3119
AUDCAD	-4.3711	-3.8745
AUDCHF	1.8313	-8.6859
AUDJPY	0.5061	-7.1958
AUDNZD	-4.8280	-4.5685
AUDUSD	-4.4852	-1.4163
CADCHF	2.2986	-9.2581
CADJPY	0.9340	-7.6823

CHFJPY	-7.8525	-2.1417
CHFPLN	-43.4350	7.5934
EURAUD	-16.0051	2.1341
EURCAD	-15.1671	2.7235
EURCHF	-3.2153	-7.1873
EURCZK	-25.0563	4.8414
EURGBP	-6.0770	-0.7166
EURHUF	-16.8555	-9.2201
EURJPY	-6.0579	-4.0153
EURNOK	-71.0457	-10.8479
EURNZD	-16.7521	2.5456
EURPLN	-39.6346	3.2408
EURSEK	-48.9047	-46.8595
EURTRY	-528.1401	333.6319
EURUSD	-13.3190	4.4395
EURZAR	-566.0982	85.2606
GBPAUD	-12.5957	-3.1103
GBPCAD	-11.9682	-2.1008
GBPCHF	0.5486	-12.3461
GBPJPY	-2.2607	-9.1151
GBPPLN	-29.9215	-11.2616
GBPUSD	-11.2327	1.2107
NZDJPY	0.6342	-6.9556
NZDUSD	-4.1762	-1.3985
USDCAD	-2.7352	-7.7993

USDCHF	5.1721	-14.0156
USDCZK	-4.0184	-13.0642
USDHUF	7.4340	-29.5133
USDJPY	3.6042	-12.1182
USDNOK	6.2192	-75.6000
USDPLN	-4.6285	-26.2182
USDSEK	31.2571	-112.6466
USDTRY	-422.5360	252.8074
USDZAR	-385.4335	-34.0416
USDMXN	-55.2310	4.2663
XAGUSD	-1.3071	0.7404
XAUUSD	-11.1157	6.2918
COPPER	-0.5510	0.3119
AUDCAD.stp	-2.8006	-2.3037
AUDCHF.stp	3.0127	-7.5042
AUDJPY.stp	1.8264	-5.8755
AUDNZD.stp	-3.0934	-2.8337
AUDUSD.stp	-3.3048	-0.2361
CADCHF.stp	3.5524	-8.0042
CADJPY.stp	2.3349	-6.2814
CHFJPY.stp	-5.9902	-0.2794
CHFPLN.stp	-3.7167	1.3866
EURAUD.stp	-13.3375	4.8018
EURCAD.stp	-12.6531	5.2376
EURCHF.stp	-1.3239	-5.2959

EURGBP.stp	-4.6570	0.7035
EURJPY.stp	-3.9447	-1.9020
EURNOK.stp	-54.7752	5.4240
EURNZD.stp	-13.9754	5.3226
EURPLN.stp	-3.2519	1.0357
EURSEK.stp	-31.3339	-29.2875
EURTRY.stp	-523.0444	338.7284
EURUSD.stp	-11.4297	6.3287
GBPAUD.stp	-9.5077	-0.0220
GBPCAD.stp	-9.0580	0.8095
GBPCHF.stp	2.7380	-10.1568
GBPJPY.stp	0.1856	-6.6686
GBPNZD.stp	-10.0039	0.3547
GBPPLN.stp	-2.1686	-0.3021
GBPUSD.stp	-9.0457	3.3979
NZDUSD.stp	-3.0424	-0.2646
USDCAD.stp	-0.5175	-5.5815
USDCHF.stp	6.8405	-12.3472
USDHKD.stp	17.6599	-51.4532
USDJPY.stp	5.4684	-10.2539
USDNOK.stp	20.5710	-61.2461
USDPLN.stp	0.1648	-1.9941
USDSEK.stp	46.7562	-97.1456
USDTRY.stp	-418.0439	257.2999
XAGUSD.stp	-11.8102	8.6656

XAUUSD.stp	-100.4341	73.6421
3M	-2.8718	-0.0104
AMAZON	-23.1278	-0.0841
AIG	-0.5982	-0.0022
APPLE	-2.4212	-0.0088
AT&T	-0.4265	-0.0016
BABA	-2.5445	-0.0093
BOEING	-6.1014	-0.0222
CHEVRON	-1.6883	-0.0061
CISCO	-0.7113	-0.0026
CITI	-0.8923	-0.0032
COCACOLA	-0.6277	-0.0023
EBAY	-0.5167	-0.0019
EXXONM	-1.1069	-0.0040
FACEBOOK	-2.2456	-0.0082
GE	-0.1421	-0.0005
GMOTORS	-0.5469	-0.0020
GOOGLE	-15.8937	-0.0578
IBM	-1.9265	-0.0070
INTEL	-0.7376	-0.0027
J&J	-1.9148	-0.0070
JPMORGAN	-1.4449	-0.0053
MCDONALD	-2.5601	-0.0093
MICROSFT	-1.5570	-0.0057
PFIZER	-0.6000	-0.0022

P&G	-1.3623	-0.0050
STBUCKS	-0.9803	-0.0036
WALMART	-1.3553	-0.0049
GOLDMAN	-2.7429	-0.0100
UPS	-1.5517	-0.0056
ALCOA	-0.4105	-0.0015
AMERICANEXP	-1.5072	-0.0055
BOA	-0.4056	-0.0015
CATERPILLAR	-1.9027	-0.0069
SNAP	-0.1358	-0.0005
DISNEY	-1.5779	-0.0057
FORD	-0.1216	-0.0004
FEDEX	-2.5297	-0.0092
HARLEY-DAVI	-0.5242	-0.0019
HP	-0.2265	-0.0008
NIKE	-1.2063	-0.0044
PEPSI	-1.6075	-0.0058
PM	-1.2109	-0.0044
TWITTER	-0.4237	-0.0015
VISA	-2.0693	-0.0075
PAYPAL	-1.3671	-0.0050
TESLA	-4.0768	-0.0148
NETFLIX	-4.9426	-0.0180
BASF	-3.9684	-5.5352
DTELEKOM	-0.8468	-1.1814

ALLIANZ	-11.4875	-16.0241
BAYER	-4.2044	-5.8644
BEIERSDO	-4.7954	-6.6911
DAIMLERC	-3.1065	-4.3373
DBANK	-0.4766	-0.6651
SIEMENS	-5.6480	-7.8778
LUFTHANS	-1.3172	-1.8378
CECONOMY	-0.2927	-0.4085
ADIDAS	-12.5686	-17.5367
BMW	-4.3384	-6.0513
COMMERZBANK	-0.4225	-0.5898
CONTINENTAL	-8.5028	-11.8624
HENKEL	-5.1597	-7.1991
RWE	-1.2464	-1.7399
THYSSEN	-0.7679	-1.0714
VOLKSWAGEN	-9.1582	-12.7804
BARCLAYS	-1.4566	-0.8000
GSK	-13.3898	-7.3546
M&S	-2.4618	-1.3528
RBS	-2.3442	-1.2882
ROLLS-ROYCE	-7.7711	-4.2702
RIOTINTO	-38.9349	-21.3826
SHELL	-20.8204	-11.4379
STAN	-5.4649	-3.0028
TESCO	-2.0259	-1.1130

UNILEVER	-35.2652	-19.3674
VODAFONE	-1.1740	-0.6449
SANTANDER	-0.2464	-0.3436
TELEFONICA	-0.4307	-0.6008
BBVA	-0.3108	-0.4336
IBERDOLA	-0.4224	-0.5892
REPSOL	-0.8726	-1.2178
CAIXABANK	-0.1799	-0.2510
REDELECTRIC	-1.0884	-1.5183
GRIFOLS	-1.4024	-1.9575
BANKINTER	-0.4135	-0.5769
MAPFRE	-0.1450	-0.2024
ACS	-2.3171	-3.2331
AMADEUS	-3.8303	-5.3451
INDITEX	-1.5561	-2.1711
ACERINOX	-0.5516	-0.7710
AENA	-9.1118	-12.7157
BANKIA	-0.1554	-0.2169
IAG	-0.3950	-0.5512
SACYR	-0.1284	-0.1801
TECNICAS	-1.4686	-2.0538
BOGDANKA	-58.0734	-12.1814
BUDIMEX	-133.6142	-27.9441
CCC	-215.2800	-44.7907
MBANK	-484.3233	-100.7025

ASSECOPL	-61.6463	-12.8411
SANTANDERPL	-429.1989	-89.2515
EUROCASH	-23.4789	-4.8843
KGHM	-113.9918	-23.7030
LOTOS	-107.1863	-22.2752
MILLENNI	-10.1969	-2.1205
NETIA	-5.5578	-1.1757
ORANGEPL	-6.1193	-1.2723
PEKAO	-128.5101	-26.7071
PGE	-12.3293	-2.5623
PGNIG	-7.4690	-1.5527
PKNORLEN	-113.5381	-23.5970
PKOBP	-43.8386	-9.1113
CDPROJEKT	-218.2290	-45.3562
PZU	-47.5590	-9.8818
CYFRPLST	-28.2654	-5.8763
ALIOR	-71.0605	-14.7967
HANDLOWY	-75.5408	-15.7392
CIECH	-69.0189	-14.3726
INGBSK	-218.4559	-45.4268
JSW	-65.3780	-13.5904
PKPCARGO	-47.1847	-9.8488
TAURON	-2.5747	-0.5353
LPP	-9056.9589	-1883.7534
ASHR.ETF	-0.3900	-0.0014

DBA.ETF	-0.2278	-0.0008
DBC.ETF	-0.2184	-0.0008
EEM.ETF	-0.5879	-0.0021
EFA.ETF	-0.8944	-0.0033
EWA.ETF	-0.2964	-0.0011
EWV.ETF	-0.5988	-0.0022
EWY.ETF	-0.8722	-0.0032
EWZ.ETF	-0.5861	-0.0021
FXI.ETF	-0.6114	-0.0022
GLD.ETF	-1.6866	-0.0061
HYG.ETF	-1.1846	-0.0043
IVV.ETF	-3.9055	-0.0142
IYR.ETF	-1.1620	-0.0042
OIH.ETF	-0.2411	-0.0009
SLV.ETF	-0.1965	-0.0007
SPY.ETF	-3.8814	-0.0141
SSO.ETF	-1.6003	-0.0058
SVXY.ETF	-0.7222	-0.0026
TBT.ETF	-0.5068	-0.0018
VNQ.ETF	-1.1587	-0.0042
XHB.ETF	-0.5344	-0.0019
XLB.ETF	-0.7608	-0.0028
XLE.ETF	-0.9194	-0.0033
XLF.ETF	-0.3692	-0.0013
XLI.ETF	-1.0574	-0.0038

XLP.ETF	-0.7500	-0.0027
XLU.ETF	-0.7903	-0.0029
XLV.ETF	-1.2863	-0.0047
XLY.ETF	-1.5375	-0.0056
BITCOIN	-76.5500	-26.5850
BTCUSD	-261.2550	-211.3455
ETHUSD	-87.6708	-70.9812
LTCUSD	-32.0230	-25.9434
BCHUSD	-8.7038	-7.0675
XRPUSD	-21.3015	-17.2441

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.stp, USDTRY.stp, EURTRY.pro, USDTRY.pro, EURZAR.pro, USDZAR.pro , EURTRY.std, USDTRY.std, EURZAR.std, USDZAR.std ,	4,00%
Akcje i ETF'y	2,50%
Pozostałe FX + FX(.std) oraz COPPER, XAGUSD, XAUUSD, COPPER.std, GOLD.std, SILVER.std	0,65%
Pozostałe FX (.pro) + FX (.stp), XAGUSD.stp, XAUUSD.stp, COPPER.pro, GOLD.pro, SILVER.pro	0.35%
BITCOIN	5,00%
BTCUSD, ETHUSD, LTCUSD, BCHUSD, XRPUSD	23,00%

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 wyznaczone jest tylko dla jednej waluty, w której kwotowany jest instrument bazowy).

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

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

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.

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

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

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