

Tabela punktów swapowych

Obowiązuje w dniach 2018.10.08 - 2018.10.14 Opublikowane punkty swapowe są naliczane w minimalnym kroku notowań dla danego instrumentu.

Instrument	Długa pozycja	Krótka pozycja
EURUSD.pro	-11.0252	5.8789
CADCHF.pro	2.8744	-6.8005
CADJPY.pro	1.8643	-5.9324
CHFJPY.pro	-4.8661	-0.6182
EURCAD.pro	-11.4352	4.1643
EURCHF.pro	-1.5981	-4.1141
EURGBP.pro	-4.6732	0.8474
EURJPY.pro	-3.9365	-1.9685
GBPCAD.pro	-7.3367	-0.2439
GBPCHF.pro	2.5050	-8.4757
GBPJPY.pro	0.4582	-6.5743
GBPUSD.pro	-8.1770	2.8541
USDCAD.pro	-0.2167	-5.7791
USDCHF.pro	6.0548	-10.7727
USDJPY.pro	5.0686	-9.9174
AUDCHF.pro	3.1256	-7.1781
AUDCAD.pro	-1.6574	-3.5192
AUDJPY.pro	2.2672	-6.5130
AUDNZD.pro	-3.0407	-3.2842
AUDUSD.pro	-2.6474	-1.0591
CHFPLN.pro	-3.6478	1.6163
EURAUD.pro	-14.6224	5.6644

EURCZK.pro	-1.9742	0.5044
EURHUF.pro	-1.2288	-0.4474
EURNOK.pro	-6.0233	1.1230
EURNZD.pro	-15.3646	6.4485
EURPLN.pro	-3.6249	1.4223
EURSEK.pro	-2.3789	-3.0032
EURTRY.pro	-624.3913	353.1881
GBPAUD.pro	-10.4532	1.0166
GBPNZD.pro	-10.7137	1.3937
GBPPLN.pro	-2.4850	0.1792
NZDJPY.pro	2.1723	-5.6855
NZDUSD.pro	-2.3287	-0.7345
USDCZK.pro	-0.0374	-1.1851
USDHUF.pro	1.0554	-2.4424
USDNOK.pro	0.9672	-5.0211
USDPLN.pro	-0.3440	-1.4776
USDSEK.pro	4.7542	-9.2069
USDTRY.pro	-497.9059	263.1285
EURZAR.pro	-60.0151	13.3033
USDZAR.pro	-41.1579	0.8269
SILVER.pro	-1.0434	0.7390
GOLD.pro	-8.6251	6.1049
COPPER.pro	-0.4458	0.3156
EURUSD.std	-12.9372	3.9670
CADCHF.std	1.6016	-8.0735
CADJPY.std	0.4116	-7.3851

CHFJPY.std	-6.7683	-2.5205
EURCAD.std	-13.9212	1.6781
EURCHF.std	-3.4968	-6.0128
EURGBP.std	-6.1299	-0.6092
EURJPY.std	-6.1034	-4.1356
GBPCAD.std	-10.1422	-3.0497
GBPCHF.std	0.3623	-10.6186
GBPJPY.std	-1.9873	-9.0199
GBPUSD.std	-10.3347	0.6964
USDCAD.std	-2.3838	-7.9462
USDCHF.std	4.3998	-12.4278
USDJPY.std	3.1797	-11.8063
AUDCHF.std	1.9572	-8.3468
AUDCAD.std	-3.1874	-5.0492
AUDJPY.std	0.9336	-7.8466
AUDNZD.std	-4.8652	-5.1087
AUDUSD.std	-3.8241	-2.2358
CHFPLN.std	-4.2734	0.9903
EURAUD.std	-17.3304	2.9563
EURCZK.std	-2.4034	0.0751
EURHUF.std	-1.7709	-0.9896
EURNOK.std	-7.6084	-0.4624
EURNZD.std	-18.3290	3.4837
EURPLN.std	-4.3379	0.7092
EURSEK.std	-4.1197	-4.7441
EURTRY.std	-630.2759	347.3004

GBPAUD.std	-13.5092	-2.0397
GBPNZD.std	-14.0592	-1.9523
GBPPLN.std	-3.2894	-0.6257
NZDJPY.std	0.9542	-6.9038
NZDUSD.std	-3.4035	-1.8095
USDCZK.std	-0.4115	-1.5594
USDHUF.std	0.5828	-2.9151
USDNOK.std	-0.4145	-6.4031
USDPLN.std	-0.9654	-2.0991
USDSEK.std	3.2369	-10.7245
USDTRY.std	-503.0325	258.0005
EURZAR.std	-61.4378	11.8804
USDZAR.std	-42.3979	-0.4134
SILVER.std	-1.1638	0.6185
GOLD.std	-9.6203	5.1095
COPPER.std	-0.4972	0.2642
AUDCAD	-3.1874	-5.0492
AUDCHF	1.9572	-8.3468
AUDJPY	0.9336	-7.8466
AUDNZD	-4.8652	-5.1087
AUDUSD	-3.8241	-2.2358
CADCHF	1.6016	-8.0735
CADJPY	0.4116	-7.3851
CHFJPY	-6.7683	-2.5205
CHFPLN	-42.7335	9.9028
EURAUD	-17.3304	2.9563

EURCAD	-13.9212	1.6781
EURCHF	-3.4968	-6.0128
EURCZK	-24.0341	0.7512
EURGBP	-6.1299	-0.6092
EURHUF	-17.7092	-9.8963
EURJPY	-6.1034	-4.1356
EURNOK	-76.0841	-4.6240
EURNZD	-18.3290	3.4837
EURPLN	-43.3785	7.0921
EURSEK	-41.1967	-47.4414
EURTRY	-630.2759	347.3004
EURUSD	-12.9372	3.9670
EURZAR	-614.3778	118.8042
GBPAUD	-13.5092	-2.0397
GBPCAD	-10.1422	-3.0497
GBPCHF	0.3623	-10.6186
GBPJPY	-1.9873	-9.0199
GBPPLN	-32.8943	-6.2566
GBPUSD	-10.3347	0.6964
NZDJPY	0.9542	-6.9038
NZDUSD	-3.4035	-1.8095
USDCAD	-2.3838	-7.9462
USDCHF	4.3998	-12.4278
USDCZK	-4.1150	-15.5937
USDHUF	5.8283	-29.1506
USDJPY	3.1797	-11.8063

USDNOK	-4.1450	-64.0306
USDPLN	-9.6544	-20.9914
USDSEK	32.3695	-107.2445
USDTRY	-503.0325	258.0005
USDZAR	-423.9792	-4.1344
USDMXN	-54.5069	5.0257
XAGUSD	-1.1638	0.6185
XAUUSD	-9.6203	5.1095
COPPER	-0.4972	0.2642
AUDCAD.stp	-1.6574	-3.5192
AUDCHF.stp	3.1256	-7.1781
AUDJPY.stp	2.2672	-6.5130
AUDNZD.stp	-3.0407	-3.2842
AUDUSD.stp	-2.6474	-1.0591
CADCHF.stp	2.8744	-6.8005
CADJPY.stp	1.8643	-5.9324
CHFJPY.stp	-4.8661	-0.6182
CHFPLN.stp	-3.6478	1.6163
EURAUD.stp	-14.6224	5.6644
EURCAD.stp	-11.4352	4.1643
EURCHF.stp	-1.5981	-4.1141
EURGBP.stp	-4.6732	0.8474
EURJPY.stp	-3.9365	-1.9685
EURNOK.stp	-60.2327	11.2298
EURNZD.stp	-15.3646	6.4485
EURPLN.stp	-3.6249	1.4223

EURSEK.stp	-23.7895	-30.0320
EURTRY.stp	-624.3913	353.1881
EURUSD.stp	-11.0252	5.8789
GBPAUD.stp	-10.4532	1.0166
GBPCAD.stp	-7.3367	-0.2439
GBPCHF.stp	2.5050	-8.4757
GBPJPY.stp	0.4582	-6.5743
GBPNZD.stp	-10.7137	1.3937
GBPPLN.stp	-2.4850	0.1792
GBPUSD.stp	-8.1770	2.8541
NZDUSD.stp	-2.3287	-0.7345
USDCAD.stp	-0.2167	-5.7791
USDCHF.stp	6.0548	-10.7727
USDHKD.stp	0.8700	-34.7993
USDJPY.stp	5.0686	-9.9174
USDNOK.stp	9.6716	-50.2115
USDPLN.stp	-0.3440	-1.4776
USDSEK.stp	47.5422	-92.0692
USDTRY.stp	-497.9059	263.1285
XAGUSD.stp	-10.4341	7.3902
XAUUSD.stp	-86.2507	61.0492
3M	-2.8290	-0.1323
AMAZON	-25.0694	-1.1724
AIG	-0.7111	-0.0332
APPLE	-2.9757	-0.1391
AT&T	-0.4510	-0.0211

BABA	-2.0519	-0.0959
BOEING	-5.1274	-0.2397
CHEVRON	-1.6635	-0.0778
CISCO	-0.6385	-0.0299
CITI	-0.9608	-0.0449
COCACOLA	-0.6086	-0.0285
EBAY	-0.4278	-0.0200
EXXONM	-1.1322	-0.0529
FACEBOOK	-2.0874	-0.0976
GE	-0.1750	-0.0082
GMOTORS	-0.4526	-0.0212
GOOGLE	-15.4923	-0.7244
IBM	-1.9775	-0.0925
INTEL	-0.6239	-0.0292
J&J	-1.8455	-0.0863
JPMORGAN	-1.5210	-0.0711
MCDONALD	-2.2108	-0.1034
MICROSFT	-1.4877	-0.0696
PFIZER	-0.5958	-0.0279
P&G	-1.0899	-0.0510
STBUCKS	-0.7399	-0.0346
WALMART	-1.2381	-0.0579
GOLDMAN	-2.9934	-0.1399
UPS	-1.5553	-0.0727
ALCOA	-0.5581	-0.0261
AMERICANEXP	-1.4229	-0.0665

BOA	-0.4010	-0.0188
CATERPILLAR	-2.0339	-0.0951
SNAP	-0.1031	-0.0048
DISNEY	-1.5239	-0.0713
FORD	-0.1210	-0.0057
FEDEX	-3.1320	-0.1464
HARLEY-DAVI	-0.5833	-0.0273
HP	-0.2142	-0.0100
NIKE	-1.0629	-0.0497
PEPSI	-1.4126	-0.0661
PM	-1.1158	-0.0522
TWITTER	-0.3767	-0.0176
VISA	-1.9285	-0.0902
PAYPAL	-1.1035	-0.0516
TESLA	-3.4752	-0.1625
NETFLIX	-4.6597	-0.2180
BASF	-4.2890	-6.0029
DTELEKOM	-0.8052	-1.1271
ALLIANZ	-11.0811	-15.5083
BAYER	-4.3833	-6.1349
BEIERSDO	-5.4335	-7.6075
DAIMLERC	-3.1914	-4.4680
DBANK	-0.5521	-0.7728
SIEMENS	-6.0737	-8.5018
LUFTHANS	-1.1288	-1.5803
CECONOMY	-0.3315	-0.4709

ADIDAS	-11.8788	-16.6293
BMW	-4.4737	-6.2613
COMMERZBANK	-0.5025	-0.7041
CONTINENTAL	-8.2897	-11.6073
HENKEL	-5.8178	-8.1446
RWE	-1.0652	-1.4912
THYSSEN	-1.1948	-1.6735
VOLKSWAGEN	-8.4518	-11.8341
BARCLAYS	-1.5047	-0.8323
GSK	-13.1948	-7.2976
M&S	-2.5193	-1.3940
RBS	-2.1788	-1.2057
ROLLS-ROYCE	-8.4084	-4.6511
RIOTINTO	-33.0620	-18.2927
SHELL	-22.7279	-12.5691
STAN	-5.2892	-2.9255
TESCO	-1.8763	-1.0384
UNILEVER	-35.7745	-19.7852
VODAFONE	-1.3830	-0.7649
SANTANDER	-0.2500	-0.3498
TELEFONICA	-0.3995	-0.5594
BBVA	-0.2963	-0.4147
IBERDOLA	-0.3668	-0.5135
REPSOL	-0.9769	-1.3673
CAIXABANK	-0.2209	-0.3093
ABERTIS	-1.0695	-1.4800

GASNATURAL	-1.3621	-1.9067
REDELECTRIC	-1.0750	-1.5046
GRIFOLS	-1.3621	-1.9084
BANKINTER	-0.4665	-0.6533
MAPFRE	-0.1532	-0.2147
ACS	-2.0904	-2.9265
AMADEUS	-4.4540	-6.2338
INDITEX	-1.4594	-2.0428
ACERINOX	-0.6828	-0.9566
AENA	-8.3621	-11.7086
BANKIA	-0.1919	-0.2688
IAG	-0.4021	-0.5631
SACYR	-0.1409	-0.1978
TECNICAS	-1.4889	-2.0882
BOGDANKA	-0.6726	-0.1402
BUDIMEX	-1.1683	-0.2432
CCC	-2.5543	-0.5316
MBANK	-4.8205	-1.0051
ASSECOPL	-0.5263	-0.1095
BZWBK	-4.0356	-0.8407
EUROCASH	-0.2223	-0.0464
KGHM	-0.9759	-0.2030
LOTOS	-0.8502	-0.1769
MILLENNI	-0.1022	-0.0213
NETIA	-0.0532	-0.0111
ORANGEPL	-0.0510	-0.0106

PEKAO	-1.1790	-0.2450
PGE	-0.1132	-0.0235
PGNIG	-0.0721	-0.0150
PKNORLEN	-1.0730	-0.2232
PKOBP	-0.4773	-0.0993
PZU	-0.4503	-0.0937
CYFRPLST	-0.2582	-0.0538
ALIOR	-0.6885	-0.1433
HANDLOWY	-0.8382	-0.1751
CIECH	-0.5329	-0.1110
ENERGA	-0.0930	-0.0193
INGBSK	-2.0190	-0.4203
JSW	-0.7556	-0.1576
PKPCARGO	-0.5002	-0.1041
TAURON	-0.0205	-0.0043
LPP	-98.4526	-20.5104
GETINNOBLE	-0.0058	-0.0012
ASHR.ETF	-0.3257	-0.0152
DBA.ETF	-0.2301	-0.0108
DBC.ETF	-0.2428	-0.0114
EEM.ETF	-0.5419	-0.0253
EFA.ETF	-0.8816	-0.0412
EWA.ETF	-0.2853	-0.0133
EWV.ETF	-0.6575	-0.0307
EWY.ETF	-0.8540	-0.0399
EWZ.ETF	-0.4859	-0.0227

FXI.ETF	-0.5423	-0.0254
GLD.ETF	-1.5104	-0.0706
HYG.ETF	-1.1319	-0.0529
IVV.ETF	-3.8482	-0.1799
IYR.ETF	-1.0332	-0.0483
OIH.ETF	-0.3398	-0.0159
SLV.ETF	-0.1824	-0.0085
SPY.ETF	-3.8199	-0.1786
SSO.ETF	-1.6580	-0.0775
SVXY.ETF	-0.7572	-0.0354
TBT.ETF	-0.5436	-0.0254
VNQ.ETF	-1.0377	-0.0485
VXX.ETF	-0.3764	-0.0176
XHB.ETF	-0.4932	-0.0231
XLB.ETF	-0.7647	-0.0358
XLE.ETF	-1.0235	-0.0479
XLF.ETF	-0.3717	-0.0174
XLI.ETF	-1.0478	-0.0490
XLP.ETF	-0.7093	-0.0332
XLU.ETF	-0.7119	-0.0333
XLV.ETF	-1.2519	-0.0585
XLY.ETF	-1.4897	-0.0696
BITCOIN	-132.1899	-51.2389
BTCUSD	-460.3854	-379.4594
ETHUSD	-156.6868	-129.2214
LTCUSD	-40.3228	-33.2787

BCHUSD	-36.2913	-29.9340
XRPUSD	-33.6737	-27.8334

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	4,00%
Akcje i ETF'y	2,50%
Pozostałe FX oraz COPPER, XAGUSD, XAUUSD	0,65%
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. W przypadku, gdy dla CFD opartych o wartość akcji punkty swapowe dla pozycji krótkiej są ujemne, przyjmujemy wartość 0.

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

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

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