

Tabela punktów swapowych

Obowiązuje w dniach 2018.12.10 - 2018.12.16. Opublikowane punkty swapowe są naliczane w minimalnym kroku notowań dla danego instrumentu.

Instrument	Długa pozycja	Krótka pozycja
EURUSD.pro	-10.8965	5.9396
CADCHF.pro	3.4165	-7.3303
CADJPY.pro	2.3501	-6.5808
CHFJPY.pro	-4.9008	-0.4585
EURCAD.pro	-13.2037	5.5477
EURCHF.pro	-1.4895	-3.8728
EURGBP.pro	-4.6964	0.8937
EURJPY.pro	-4.0333	-1.7312
GBPCAD.pro	-9.1942	1.1582
GBPCHF.pro	2.4396	-8.0475
GBPJPY.pro	0.1727	-6.1778
GBPUSD.pro	-7.9978	2.8460
USDCAD.pro	-1.6275	-4.8463
USDCHF.pro	6.0903	-10.6142
USDJPY.pro	4.8825	-9.7336
AUDCHF.pro	2.9464	-7.0046
AUDCAD.pro	-3.1232	-2.6162
AUDJPY.pro	1.8746	-6.2792
AUDNZD.pro	-3.4033	-3.1420
AUDUSD.pro	-2.9665	-0.8419
CHFPLN.pro	-3.3189	1.3338
EURAUD.pro	-13.6510	5.0264

EURCZK.pro	-2.1395	0.7648
EURHUF.pro	-1.2748	-0.5792
EURNOK.pro	-5.7266	0.8470
EURNZD.pro	-14.3879	5.5860
EURPLN.pro	-3.2473	1.0999
EURSEK.pro	-2.3237	-2.8836
EURTRY.pro	-517.1852	285.6914
GBPAUD.pro	-9.4692	0.3738
GBPNZD.pro	-10.0186	0.7500
GBPLN.pro	-2.0587	-0.1942
NZDJPY.pro	1.9408	-6.0391
NZDUSD.pro	-2.6985	-0.8422
USDCZK.pro	-0.1825	-0.9824
USDHUF.pro	0.9998	-2.5750
USDNOK.pro	1.3202	-5.4469
USDPLN.pro	-0.0352	-1.7803
USDSEK.pro	4.7292	-9.1331
USDTRY.pro	-413.7382	211.7255
EURZAR.pro	-53.3210	9.0864
USDZAR.pro	-36.1245	-2.4119
SILVER.pro	-1.0540	0.7516
GOLD.pro	-9.0378	6.4418
COPPER.pro	-0.4430	0.3157
EURUSD.std	-12.7971	4.0389
CADCHF.std	2.1779	-8.5691

CADJPY.std	0.9400	-7.9909
CHFJPY.std	-6.7979	-2.3558
EURCAD.std	-15.7349	3.0164
EURCHF.std	-3.3710	-5.7543
EURGBP.std	-6.1822	-0.5921
EURJPY.std	-6.1749	-3.8728
GBPCAD.std	-11.9944	-1.6424
GBPCHF.std	0.3582	-10.1292
GBPJPY.std	-2.1967	-8.5473
GBPUSD.std	-10.1005	0.7430
USDCAD.std	-3.8470	-7.0659
USDCHF.std	4.4406	-12.2640
USDJPY.std	3.0047	-11.6114
AUDCHF.std	1.7559	-8.1952
AUDCAD.std	-4.7248	-4.2179
AUDJPY.std	0.5195	-7.6343
AUDNZD.std	-5.1486	-4.8875
AUDUSD.std	-4.1691	-2.0447
CHFPLN.std	-3.9480	0.7042
EURAUD.std	-16.2847	2.3924
EURCZK.std	-2.5703	0.3339
EURHUF.std	-1.8135	-1.1180
EURNOK.std	-7.3398	-0.7664
EURNZD.std	-17.1461	2.8274
EURPLN.std	-3.9577	0.3893

EURSEK.std	-4.0451	-4.6051
EURTRY.std	-522.2221	280.6519
GBPAUD.std	-12.3830	-2.5403
GBPNZD.std	-13.0700	-2.3020
GBPLN.std	-2.8446	-0.9804
NZDJPY.std	0.6470	-7.3331
NZDUSD.std	-3.8468	-1.9906
USDCZK.std	-0.5602	-1.3602
USDHUF.std	0.5274	-3.0475
USDNOK.std	-0.0943	-6.8616
USDPLN.std	-0.6582	-2.4034
USDSEK.std	3.2199	-10.6426
USDTRY.std	-418.1526	207.3098
EURZAR.std	-54.6736	7.7335
USDZAR.std	-37.3105	-3.5981
SILVER.std	-1.1752	0.6303
GOLD.std	-10.0767	5.4028
COPPER.std	-0.4939	0.2648
AUDCAD	-4.7248	-4.2179
AUDCHF	1.7559	-8.1952
AUDJPY	0.5195	-7.6343
AUDNZD	-5.1486	-4.8875
AUDUSD	-4.1691	-2.0447
CADCHF	2.1779	-8.5691
CADJPY	0.9400	-7.9909

CHFJPY	-6.7979	-2.3558
CHFPLN	-39.4803	7.0418
EURAUD	-16.2847	2.3924
EURCAD	-15.7349	3.0164
EURCHF	-3.3710	-5.7543
EURCZK	-25.7032	3.3392
EURGBP	-6.1822	-0.5921
EURHUF	-18.1351	-11.1804
EURJPY	-6.1749	-3.8728
EURNOK	-73.3976	-7.6636
EURNZD	-17.1461	2.8274
EURPLN	-39.5772	3.8934
EURSEK	-40.4506	-46.0511
EURTRY	-522.2221	280.6519
EURUSD	-12.7971	4.0389
EURZAR	-546.7365	77.3349
GBPAUD	-12.3830	-2.5403
GBPCAD	-11.9944	-1.6424
GBPCHF	0.3582	-10.1292
GBPJPY	-2.1967	-8.5473
GBPPLN	-28.4464	-9.8041
GBPUSD	-10.1005	0.7430
NZDJPY	0.6470	-7.3331
NZDUSD	-3.8468	-1.9906
USDCAD	-3.8470	-7.0659

USDCHF	4.4406	-12.2640
USDCZK	-5.6023	-13.6022
USDHUF	5.2743	-30.4749
USDJPY	3.0047	-11.6114
USDNOK	-0.9430	-68.6163
USDPLN	-6.5817	-24.0339
USDSEK	32.1991	-106.4264
USDTRY	-418.1526	207.3098
USDZAR	-373.1051	-35.9810
USDMXN	-58.9917	5.8159
XAGUSD	-1.1752	0.6303
XAUUSD	-10.0767	5.4028
COPPER	-0.4939	0.2648
AUDCAD.stp	-3.1232	-2.6162
AUDCHF.stp	2.9464	-7.0046
AUDJPY.stp	1.8746	-6.2792
AUDNZD.stp	-3.4033	-3.1420
AUDUSD.stp	-2.9665	-0.8419
CADCHF.stp	3.4165	-7.3303
CADJPY.stp	2.3501	-6.5808
CHFJPY.stp	-4.9008	-0.4585
CHFPLN.stp	-3.3189	1.3338
EURAUD.stp	-13.6510	5.0264
EURCAD.stp	-13.2037	5.5477
EURCHF.stp	-1.4895	-3.8728

EURGBP.stp	-4.6964	0.8937
EURJPY.stp	-4.0333	-1.7312
EURNOK.stp	-57.2658	8.4704
EURNZD.stp	-14.3879	5.5860
EURPLN.stp	-3.2473	1.0999
EURSEK.stp	-23.2374	-28.8360
EURTRY.stp	-517.1852	285.6914
EURUSD.stp	-10.8965	5.9396
GBPAUD.stp	-9.4692	0.3738
GBPCAD.stp	-9.1942	1.1582
GBPCHF.stp	2.4396	-8.0475
GBPJPY.stp	0.1727	-6.1778
GBPNZD.stp	-10.0186	0.7500
GBPPLN.stp	-2.0587	-0.1942
GBPUSD.stp	-7.9978	2.8460
NZDUSD.stp	-2.6985	-0.8422
USDCAD.stp	-1.6275	-4.8463
USDCHF.stp	6.0903	-10.6142
USDHKD.stp	9.9854	-43.6323
USDJPY.stp	4.8825	-9.7336
USDNOK.stp	13.2016	-54.4691
USDPLN.stp	-0.0352	-1.7803
USDSEK.stp	47.2921	-91.3312
USDTRY.stp	-413.7382	211.7255
XAGUSD.stp	-10.5400	7.5156

XAUUSD.stp	-90.3785	64.4180
3M	-2.6984	-0.0550
AMAZON	-22.1853	-0.4519
AIG	-0.5157	-0.0105
APPLE	-2.2918	-0.0467
AT&T	-0.4103	-0.0084
BABA	-2.0826	-0.0424
BOEING	-4.3982	-0.0896
CHEVRON	-1.5720	-0.0320
CISCO	-0.6317	-0.0129
CITI	-0.7942	-0.0162
COCACOLA	-0.6681	-0.0136
EBAY	-0.3956	-0.0081
EXXONM	-1.0571	-0.0215
FACEBOOK	-1.8705	-0.0381
GE	-0.0956	-0.0019
GMOTORS	-0.4722	-0.0096
GOOGLE	-14.2455	-0.2903
IBM	-1.6245	-0.0331
INTEL	-0.6293	-0.0128
J&J	-1.9789	-0.0403
JPMORGAN	-1.4061	-0.0286
MCDONALD	-2.4904	-0.0507
MICROSFT	-1.4262	-0.0291
PFIZER	-0.5978	-0.0122

P&G	-1.2584	-0.0256
STBUCKS	-0.8910	-0.0182
WALMART	-1.2686	-0.0258
GOLDMAN	-2.4456	-0.0498
UPS	-1.4333	-0.0292
ALCOA	-0.3920	-0.0080
AMERICANEXP	-1.4521	-0.0296
BOA	-0.3461	-0.0071
CATERPILLAR	-1.6814	-0.0343
SNAP	-0.0789	-0.0016
DISNEY	-1.5238	-0.0310
FORD	-0.1199	-0.0024
FEDEX	-2.7402	-0.0558
HARLEY-DAVI	-0.5206	-0.0106
HP	-0.2002	-0.0041
NIKE	-0.9981	-0.0203
PEPSI	-1.5764	-0.0321
PM	-1.1510	-0.0234
TWITTER	-0.4470	-0.0091
VISA	-1.8662	-0.0380
PAYPAL	-1.1262	-0.0230
TESLA	-4.8724	-0.0992
NETFLIX	-3.6072	-0.0735
BASF	-3.3783	-4.7164
DTELEKOM	-0.8717	-1.2169

ALLIANZ	-10.1249	-14.1322
BAYER	-3.6821	-5.1404
BEIERSDO	-5.4161	-7.5621
DAIMLERC	-2.6773	-3.7374
DBANK	-0.4490	-0.6269
SIEMENS	-5.6428	-7.8769
LUFTHANS	-1.1192	-1.5628
CECONOMY	-0.2205	-0.3082
ADIDAS	-11.2590	-15.7173
BMW	-4.1157	-5.7456
COMMERZBANK	-0.3981	-0.5559
CONTINENTAL	-7.1456	-9.9806
HENKEL	-5.7767	-8.0638
RWE	-1.0923	-1.5252
THYSSEN	-0.9102	-1.2724
VOLKSWAGEN	-8.0993	-11.3197
BARCLAYS	-1.3666	-0.7453
GSK	-12.8713	-7.0202
M&S	-2.4727	-1.3489
RBS	-1.8627	-1.0164
ROLLS-ROYCE	-6.9029	-3.7648
RIOTINTO	-31.6064	-17.2340
SHELL	-20.6262	-11.2461
STAN	-5.1936	-2.8321
TESCO	-1.7559	-0.9574

UNILEVER	-37.6662	-20.5373
VODAFONE	-1.4269	-0.7781
SANTANDER	-0.2288	-0.3195
TELEFONICA	-0.4419	-0.6169
BBVA	-0.2684	-0.3747
IBERDOLA	-0.3833	-0.5352
REPSOL	-0.8438	-1.1781
CAIXABANK	-0.1935	-0.2701
REDELECTRIC	-1.1288	-1.5762
GRIFOLS	-1.3833	-1.9322
BANKINTER	-0.4122	-0.5756
MAPFRE	-0.1383	-0.1932
ACS	-1.8367	-2.5649
AMADEUS	-3.5064	-4.8952
INDITEX	-1.5445	-2.1563
ACERINOX	-0.4844	-0.6766
AENA	-8.1254	-11.3521
BANKIA	-0.1573	-0.2198
IAG	-0.3873	-0.5407
SACYR	-0.1015	-0.1419
TECNICAS	-1.3619	-1.9071
BOGDANKA	-0.6102	-0.1275
BUDIMEX	-1.4745	-0.3077
CCC	-2.2288	-0.4635
MBANK	-4.5710	-0.9519

ASSECOPL	-0.5431	-0.1134
SANTANDERPL	-3.8927	-0.8091
EUROCASH	-0.1983	-0.0413
KGHM	-0.9995	-0.2079
LOTOS	-0.9310	-0.1936
MILLENNI	-0.1014	-0.0211
NETIA	-0.0517	-0.0108
ORANGEPL	-0.0552	-0.0115
PEKAO	-1.2250	-0.2547
PGE	-0.1286	-0.0267
PGNIG	-0.0775	-0.0161
PKNORLEN	-1.2273	-0.2551
PKOBP	-0.4537	-0.0943
CDPROJEKT	-1.6379	-0.3407
PZU	-0.4865	-0.1012
CYFRPLST	-0.2504	-0.0521
ALIOR	-0.6057	-0.1262
HANDLOWY	-0.7849	-0.1633
CIECH	-0.5206	-0.1084
INGBSK	-2.0371	-0.4236
JSW	-0.7629	-0.1585
PKPCARGO	-0.4991	-0.1044
TAURON	-0.0264	-0.0055
LPP	-86.2027	-17.9422
ASHR.ETF	-0.3127	-0.0064

DBA.ETF	-0.2368	-0.0048
DBC.ETF	-0.2137	-0.0044
EEM.ETF	-0.5423	-0.0110
EFA.ETF	-0.8273	-0.0169
EWA.ETF	-0.2766	-0.0056
EWV.ETF	-0.5517	-0.0112
EWY.ETF	-0.8024	-0.0163
EWZ.ETF	-0.5266	-0.0107
FXI.ETF	-0.5521	-0.0113
GLD.ETF	-1.6071	-0.0327
HYG.ETF	-1.1275	-0.0230
IVV.ETF	-3.6147	-0.0736
IYR.ETF	-1.1132	-0.0227
OIH.ETF	-0.2299	-0.0047
SLV.ETF	-0.1870	-0.0038
SPY.ETF	-3.5886	-0.0731
SSO.ETF	-1.4035	-0.0286
SVXY.ETF	-0.6246	-0.0127
TBT.ETF	-0.5058	-0.0103
VNQ.ETF	-1.1172	-0.0228
VXX.ETF	-0.5491	-0.0112
XHB.ETF	-0.4661	-0.0095
XLB.ETF	-0.7066	-0.0144
XLE.ETF	-0.8722	-0.0178
XLF.ETF	-0.3419	-0.0070

XLI.ETF	-0.9260	-0.0189
XLP.ETF	-0.7444	-0.0152
XLU.ETF	-0.7680	-0.0156
XLV.ETF	-1.2331	-0.0251
XLY.ETF	-1.4069	-0.0287
BITCOIN	-70.5279	-27.1168
BTCUSD	-245.3904	-202.0638
ETHUSD	-64.2130	-52.8990
LTCUSD	-17.3662	-14.3162
BCHUSD	-7.2482	-5.9817
XRPUSD	-21.1833	-17.4694

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