

Tabela punktów swapowych

Obowiązuje w dniach 2019.02.11 - 2019.02.17 Opublikowane punkty swapowe są naliczane w minimalnym kroku notowań dla danego instrumentu.

Instrument	Długa pozycja	Krótka pozycja
EURUSD.pro	-11.4232	6.5841
CADCHF.pro	3.1906	-7.1692
CADJPY.pro	2.3278	-6.3156
CHFJPY.pro	-4.4375	-0.8235
EURCAD.pro	-12.4909	5.2346
EURCHF.pro	-1.6548	-3.8141
EURGBP.pro	-4.7635	0.9244
EURJPY.pro	-3.5820	-1.8517
GBPCAD.pro	-8.6946	0.4086
GBPCHF.pro	2.3234	-8.5683
GBPJPY.pro	0.5346	-6.7389
GBPUSD.pro	-8.8492	3.3239
USDCAD.pro	-0.4055	-5.8613
USDCHF.pro	6.5748	-11.2968
USDJPY.pro	5.6586	-10.3392
AUDCHF.pro	3.3151	-7.2536
AUDCAD.pro	-2.0629	-3.1599
AUDJPY.pro	2.5352	-6.5009
AUDNZD.pro	-1.9533	-3.5862
AUDUSD.pro	-2.8134	-0.7280
CHFPLN.pro	-3.7230	1.6837
EURAUD.pro	-14.4398	6.2778

EURCZK.pro	-2.0982	0.9795
EURHUF.pro	-1.3713	-0.6614
EURNOK.pro	-5.5205	0.7770
EURNZD.pro	-13.3866	5.7513
EURPLN.pro	-3.7221	1.5920
EURSEK.pro	-3.1006	-2.1110
EURTRY.pro	-493.8139	265.6378
GBPAUD.pro	-10.5658	1.2457
GBPNZD.pro	-9.0685	0.3498
GBPLN.pro	-2.6486	0.2163
NZDJPY.pro	2.0436	-5.4094
NZDUSD.pro	-3.0178	0.0187
USDCZK.pro	-0.0254	-0.9387
USDHUF.pro	1.0512	-2.8171
USDNOK.pro	2.0721	-6.1691
USDPLN.pro	-0.2315	-1.6095
USDSEK.pro	4.6829	-9.1875
USDTRY.pro	-394.0573	193.0133
EURZAR.pro	-52.1498	8.7921
USDZAR.pro	-35.0816	-3.0930
SILVER.pro	-1.2270	0.9002
GOLD.pro	-10.2045	7.4821
COPPER.pro	-0.4811	0.3528
EURUSD.std	-13.3089	4.6984
CADCHF.std	1.9312	-8.4287

CADJPY.std	0.9450	-7.6985
CHFJPY.std	-6.2674	-2.6536
EURCAD.std	-14.9934	2.7320
EURCHF.std	-3.5460	-5.7053
EURGBP.std	-6.2124	-0.5244
EURJPY.std	-5.6586	-3.9283
GBPCAD.std	-11.5339	-2.4310
GBPCHF.std	0.1776	-10.7142
GBPJPY.std	-1.8215	-9.0951
GBPUSD.std	-10.9887	1.1843
USDCAD.std	-2.6172	-8.0731
USDCHF.std	4.9033	-12.9682
USDJPY.std	3.8234	-12.1744
AUDCHF.std	2.1311	-8.4377
AUDCAD.std	-3.6297	-4.7268
AUDJPY.std	1.2351	-7.8010
AUDNZD.std	-3.7026	-5.3356
AUDUSD.std	-3.9939	-1.9086
CHFPLN.std	-4.3527	1.0535
EURAUD.std	-17.1016	3.6158
EURCZK.std	-2.5287	0.5489
EURHUF.std	-1.9038	-1.1941
EURNOK.std	-7.1563	-0.8588
EURNZD.std	-16.1805	2.9571
EURPLN.std	-4.4369	0.8771

EURSEK.std	-4.8474	-3.8579
EURTRY.std	-498.7852	260.6658
GBPAUD.std	-13.5858	-1.7747
GBPNZD.std	-12.2383	-2.8205
GBPLN.std	-3.4594	-0.5949
NZDJPY.std	0.8051	-6.6482
NZDUSD.std	-4.1424	-1.1060
USDCZK.std	-0.4058	-1.3192
USDHUF.std	0.5805	-3.2879
USDNOK.std	0.6265	-7.6149
USDPLN.std	-0.8631	-2.2413
USDSEK.std	3.1391	-10.7315
USDTRY.std	-398.4488	188.6217
EURZAR.std	-53.4459	7.4959
USDZAR.std	-36.2271	-4.2386
SILVER.std	-1.3580	0.7691
GOLD.std	-11.2940	6.3925
COPPER.std	-0.5325	0.3014
AUDCAD	-3.6297	-4.7268
AUDCHF	2.1311	-8.4377
AUDJPY	1.2351	-7.8010
AUDNZD	-3.7026	-5.3356
AUDUSD	-3.9939	-1.9086
CADCHF	1.9312	-8.4287
CADJPY	0.9450	-7.6985

CHFJPY	-6.2674	-2.6536
CHFPLN	-43.5274	10.5347
EURAUD	-17.1016	3.6158
EURCAD	-14.9934	2.7320
EURCHF	-3.5460	-5.7053
EURCZK	-25.2868	5.4893
EURGBP	-6.2124	-0.5244
EURHUF	-19.0381	-11.9409
EURJPY	-5.6586	-3.9283
EURNOK	-71.5627	-8.5883
EURNZD	-16.1805	2.9571
EURPLN	-44.3687	8.7713
EURSEK	-48.4743	-38.5793
EURTRY	-498.7852	260.6658
EURUSD	-13.3089	4.6984
EURZAR	-534.4586	74.9592
GBPAUD	-13.5858	-1.7747
GBPCAD	-11.5339	-2.4310
GBPCHF	0.1776	-10.7142
GBPJPY	-1.8215	-9.0951
GBPPLN	-34.5936	-5.9492
GBPUSD	-10.9887	1.1843
NZDJPY	0.8051	-6.6482
NZDUSD	-4.1424	-1.1060
USDCAD	-2.6172	-8.0731

USDCHF	4.9033	-12.9682
USDCZK	-4.0576	-13.1923
USDHUF	5.8050	-32.8793
USDJPY	3.8234	-12.1744
USDNOK	6.2645	-76.1494
USDPLN	-8.6313	-22.4129
USDSEK	31.3914	-107.3149
USDTRY	-398.4488	188.6217
USDZAR	-362.2709	-42.3857
USDMXN	-56.6668	6.0398
XAGUSD	-1.3580	0.7691
XAUUSD	-11.2940	6.3925
COPPER	-0.5325	0.3014
AUDCAD.stp	-2.0629	-3.1599
AUDCHF.stp	3.3151	-7.2536
AUDJPY.stp	2.5352	-6.5009
AUDNZD.stp	-1.9533	-3.5862
AUDUSD.stp	-2.8134	-0.7280
CADCHF.stp	3.1906	-7.1692
CADJPY.stp	2.3278	-6.3156
CHFJPY.stp	-4.4375	-0.8235
CHFPLN.stp	-3.7230	1.6837
EURAUD.stp	-14.4398	6.2778
EURCAD.stp	-12.4909	5.2346
EURCHF.stp	-1.6548	-3.8141

EURGBP.stp	-4.7635	0.9244
EURJPY.stp	-3.5820	-1.8517
EURNOK.stp	-55.2050	7.7705
EURNZD.stp	-13.3866	5.7513
EURPLN.stp	-3.7221	1.5920
EURSEK.stp	-31.0058	-21.1096
EURTRY.stp	-493.8139	265.6378
EURUSD.stp	-11.4232	6.5841
GBPAUD.stp	-10.5658	1.2457
GBPCAD.stp	-8.6946	0.4086
GBPCHF.stp	2.3234	-8.5683
GBPJPY.stp	0.5346	-6.7389
GBPNZD.stp	-9.0685	0.3498
GBPPLN.stp	-2.6486	0.2163
GBPUSD.stp	-8.8492	3.3239
NZDUSD.stp	-3.0178	0.0187
USDCAD.stp	-0.4055	-5.8613
USDCHF.stp	6.5748	-11.2968
USDHKD.stp	18.5282	-52.3152
USDJPY.stp	5.6586	-10.3392
USDNOK.stp	20.7210	-61.6912
USDPLN.stp	-0.2315	-1.6095
USDSEK.stp	46.8295	-91.8747
USDTRY.stp	-394.0573	193.0133
XAGUSD.stp	-12.2703	9.0025

XAUUSD.stp	-102.0451	74.8209
3M	-2.7770	0.0000
AMAZON	-22.0767	0.0000
AIG	-0.5902	0.0000
APPLE	-2.3702	0.0000
AT&T	-0.4106	0.0000
BABA	-2.3264	0.0000
BOEING	-5.6269	0.0000
CHEVRON	-1.6347	0.0000
CISCO	-0.6560	0.0000
CITI	-0.8620	0.0000
COCACOLA	-0.6878	0.0000
EBAY	-0.4901	0.0000
EXXONM	-1.0283	0.0000
FACEBOOK	-2.3259	0.0000
GE	-0.1364	0.0000
GMOTORS	-0.5378	0.0000
GOOGLE	-15.3238	0.0000
IBM	-1.8583	0.0000
INTEL	-0.6789	0.0000
J&J	-1.8399	0.0000
JPMORGAN	-1.4084	0.0000
MCDONALD	-2.4285	0.0000
MICROSFT	-1.4700	0.0000
PFIZER	-0.5870	0.0000

P&G	-1.3581	0.0000
STBUCKS	-0.9697	0.0000
WALMART	-1.3286	0.0000
GOLDMAN	-2.6647	0.0000
UPS	-1.5024	0.0000
ALCOA	-0.3842	0.0000
AMERICANEXP	-1.4526	0.0000
BOA	-0.3931	0.0000
CATERPILLAR	-1.7872	0.0000
SNAP	-0.1265	0.0000
DISNEY	-1.5492	0.0000
FORD	-0.1165	0.0000
FEDEX	-2.4637	0.0000
HARLEY-DAVI	-0.4900	0.0000
HP	-0.2212	0.0000
NIKE	-1.1446	0.0000
PEPSI	-1.5709	0.0000
PM	-1.1120	0.0000
TWITTER	-0.4167	0.0000
VISA	-1.9515	0.0000
PAYPAL	-1.2772	0.0000
TESLA	-4.2507	0.0000
NETFLIX	-4.8332	0.0000
BASF	-3.6498	-5.1199
DTELEKOM	-0.8207	-1.1513

ALLIANZ	-10.6747	-14.9746
BAYER	-3.8544	-5.4061
BEIERSDO	-5.1419	-7.2141
DAIMLERC	-2.7687	-3.8839
DBANK	-0.4238	-0.5944
SIEMENS	-5.3194	-7.4614
LUFTHANS	-1.2800	-1.7958
CECONOMY	-0.2754	-0.3866
ADIDAS	-11.5049	-16.1421
BMW	-3.9758	-5.5772
COMMERZBANK	-0.3654	-0.5126
CONTINENTAL	-7.4146	-10.4020
HENKEL	-4.9477	-6.9417
RWE	-1.2586	-1.7666
THYSSEN	-0.8227	-1.1549
VOLKSWAGEN	-8.2905	-11.6424
BARCLAYS	-1.3784	-0.7540
GSK	-13.7007	-7.4967
M&S	-2.5317	-1.3857
RBS	-2.0748	-1.1358
ROLLS-ROYCE	-8.0210	-4.3882
RIOTINTO	-38.0816	-20.8366
SHELL	-21.5047	-11.7672
STAN	-5.5052	-3.0122
TESCO	-1.9818	-1.0849

UNILEVER	-36.8817	-20.1779
VODAFONE	-1.2403	-0.6785
SANTANDER	-0.2313	-0.3244
TELEFONICA	-0.4253	-0.5966
BBVA	-0.2962	-0.4155
IBERDOLA	-0.4170	-0.5849
REPSOL	-0.8623	-1.2096
CAIXABANK	-0.1695	-0.2377
REDELECTRIC	-1.1502	-1.6134
GRIFOLS	-1.3077	-1.8355
BANKINTER	-0.3831	-0.5382
MAPFRE	-0.1379	-0.1935
ACS	-2.0634	-2.8952
AMADEUS	-3.7567	-5.2715
INDITEX	-1.4014	-1.9661
ACERINOX	-0.5277	-0.7435
AENA	-8.5709	-12.0275
BANKIA	-0.1438	-0.2020
IAG	-0.4342	-0.6094
SACYR	-0.1183	-0.1663
TECNICAS	-1.2702	-1.7853
BOGDANKA	-0.6091	-0.1270
BUDIMEX	-1.3271	-0.2761
CCC	-2.0088	-0.4180
MBANK	-4.9317	-1.0249

ASSECOPL	-0.5621	-0.1171
SANTANDERPL	-4.2829	-0.8902
EUROCASH	-0.2105	-0.0438
KGHM	-1.0678	-0.2220
LOTOS	-1.0607	-0.2205
MILLENNI	-0.1032	-0.0215
NETIA	-0.0561	-0.0118
ORANGEPL	-0.0615	-0.0128
PEKAO	-1.2817	-0.2664
PGE	-0.1371	-0.0285
PGNIG	-0.0831	-0.0173
PKNORLEN	-1.1915	-0.2476
PKOBP	-0.4456	-0.0926
CDPROJEKT	-2.0507	-0.4265
PZU	-0.4960	-0.1031
CYFRPLST	-0.2931	-0.0609
ALIOR	-0.6760	-0.1405
HANDLOWY	-0.7758	-0.1616
CIECH	-0.6182	-0.1289
INGBSK	-2.2050	-0.4604
JSW	-0.7527	-0.1565
PKPCARGO	-0.4690	-0.0975
TAURON	-0.0270	-0.0056
LPP	-91.9874	-19.1438
ASHR.ETF	-0.3311	0.0003

DBA.ETF	-0.2341	0.0002
DBC.ETF	-0.2150	0.0002
EEM.ETF	-0.5860	0.0005
EFA.ETF	-0.8621	0.0007
EWA.ETF	-0.2890	0.0002
EWV.ETF	-0.6179	0.0005
EWY.ETF	-0.8711	0.0007
EWZ.ETF	-0.5990	0.0005
FXI.ETF	-0.5898	0.0005
GLD.ETF	-1.7264	0.0014
HYG.ETF	-1.1786	0.0010
IVV.ETF	-3.7831	0.0031
IYR.ETF	-1.1694	0.0010
OIH.ETF	-0.2294	0.0002
SLV.ETF	-0.2063	0.0002
SPY.ETF	-3.7603	0.0031
SSO.ETF	-1.4989	0.0012
SVXY.ETF	-0.6817	0.0006
TBT.ETF	-0.4805	0.0004
VNQ.ETF	-1.1693	0.0010
XHB.ETF	-0.5143	0.0004
XLB.ETF	-0.7325	0.0006
XLE.ETF	-0.8750	0.0007
XLF.ETF	-0.3568	0.0003
XLI.ETF	-1.0154	0.0008

XLP.ETF	-0.7474	0.0006
XLU.ETF	-0.7741	0.0006
XLV.ETF	-1.2502	0.0010
XLY.ETF	-1.4891	0.0012
BITCOIN	-74.3176	-25.8075
BTCUSD	-253.6361	-205.1645
ETHUSD	-84.2337	-68.1329
LTCUSD	-30.8066	-24.9539
BCHUSD	-8.6974	-7.0664
XRPUSD	-21.1247	-17.1011

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