

Tabela punktów swapowych

Obowiązuje w dniach 2019.01.14 - 2019.01.20 Opublikowane punkty swapowe są naliczane w minimalnym kroku notowań dla danego instrumentu.

Instrument	Długa pozycja	Krótka pozycja
EURUSD.pro	-11.5669	6.4052
CADCHF.pro	3.2134	-6.9408
CADJPY.pro	2.4413	-6.2624
CHFJPY.pro	-4.2813	-0.9328
EURCAD.pro	-12.4784	4.9918
EURCHF.pro	-1.5166	-4.0653
EURGBP.pro	-4.8399	0.7311
EURJPY.pro	-3.3393	-2.3755
GBPCAD.pro	-8.4673	0.4543
GBPCHF.pro	2.3856	-8.3625
GBPJPY.pro	0.7537	-6.8512
GBPUSD.pro	-8.8088	3.3087
USDCAD.pro	-0.2581	-5.8262
USDCHF.pro	6.5280	-11.0671
USDJPY.pro	5.7318	-10.3530
AUDCHF.pro	3.3641	-7.3578
AUDCAD.pro	-1.9903	-3.3706
AUDJPY.pro	2.6566	-6.7824
AUDNZD.pro	-2.6963	-3.8105
AUDUSD.pro	-2.8587	-0.8797
CHFPLN.pro	-3.5384	1.5259
EURAUD.pro	-14.6982	5.8886

EURCZK.pro	-2.1094	0.7105
EURHUF.pro	-1.4722	-0.6426
EURNOK.pro	-5.3601	0.4082
EURNZD.pro	-14.5742	5.3727
EURPLN.pro	-3.4718	1.2582
EURSEK.pro	-2.4768	-3.4168
EURTRY.pro	-506.3309	262.8497
GBPAUD.pro	-10.6991	1.2204
GBPNZD.pro	-10.2414	0.3446
GBPLN.pro	-2.3347	-0.0396
NZDJPY.pro	2.1492	-6.0186
NZDUSD.pro	-3.0500	-0.4548
USDCZK.pro	-0.0557	-1.0901
USDHUF.pro	0.9566	-2.7073
USDNOK.pro	2.1582	-6.1912
USDPLN.pro	-0.0322	-1.7734
USDSEK.pro	4.9877	-9.8285
USDTRY.pro	-397.0466	186.7227
EURZAR.pro	-55.6546	8.6376
USDZAR.pro	-37.3980	-3.1273
SILVER.pro	-1.2179	0.8935
GOLD.pro	-10.1128	7.4149
COPPER.pro	-0.4593	0.3368
EURUSD.std	-13.4788	4.4932
CADCHF.std	1.9814	-8.1728

CADJPY.std	1.0851	-7.6188
CHFJPY.std	-6.1162	-2.7679
EURCAD.std	-15.0165	2.4536
EURCHF.std	-3.3929	-5.9416
EURGBP.std	-6.3157	-0.7447
EURJPY.std	-5.4049	-4.4411
GBPCAD.std	-11.2944	-2.3731
GBPCHF.std	0.2957	-10.4524
GBPJPY.std	-1.5471	-9.1522
GBPUSD.std	-10.9385	1.1789
USDCAD.std	-2.4705	-8.0387
USDCHF.std	4.8926	-12.7026
USDJPY.std	3.9313	-12.1535
AUDCHF.std	2.1872	-8.5350
AUDCAD.std	-3.5826	-4.9629
AUDJPY.std	1.3607	-8.0783
AUDNZD.std	-4.4547	-5.5692
AUDUSD.std	-4.0582	-2.0793
CHFPLN.std	-4.1695	0.8943
EURAUD.std	-17.3546	3.2321
EURCZK.std	-2.5356	0.2842
EURHUF.std	-2.0075	-1.1781
EURNOK.std	-6.9926	-1.2246
EURNZD.std	-17.3771	2.5695
EURPLN.std	-4.1825	0.5473

EURSEK.std	-4.1849	-5.1252
EURTRY.std	-511.6058	257.5730
GBPAUD.std	-13.6579	-1.7388
GBPNZD.std	-13.3634	-2.7780
GBPPLN.std	-3.1261	-0.8315
NZDJPY.std	0.9211	-7.2468
NZDUSD.std	-4.1866	-1.5917
USDCZK.std	-0.4272	-1.4617
USDHUF.std	0.4900	-3.1741
USDNOK.std	0.7352	-7.6144
USDPLN.std	-0.6517	-2.3931
USDSEK.std	3.4989	-11.3176
USDTRY.std	-401.6419	182.1259
EURZAR.std	-56.9833	7.3087
USDZAR.std	-38.5562	-4.2856
SILVER.std	-1.3479	0.7634
GOLD.std	-11.1925	6.3351
COPPER.std	-0.5084	0.2878
AUDCAD	-3.5826	-4.9629
AUDCHF	2.1872	-8.5350
AUDJPY	1.3607	-8.0783
AUDNZD	-4.4547	-5.5692
AUDUSD	-4.0582	-2.0793
CADCHF	1.9814	-8.1728
CADJPY	1.0851	-7.6188

CHFJPY	-6.1162	-2.7679
CHFPLN	-41.6952	8.9430
EURAUD	-17.3546	3.2321
EURCAD	-15.0165	2.4536
EURCHF	-3.3929	-5.9416
EURCZK	-25.3557	2.8419
EURGBP	-6.3157	-0.7447
EURHUF	-20.0750	-11.7809
EURJPY	-5.4049	-4.4411
EURNOK	-69.9262	-12.2458
EURNZD	-17.3771	2.5695
EURPLN	-41.8253	5.4730
EURSEK	-41.8489	-51.2515
EURTRY	-511.6058	257.5730
EURUSD	-13.4788	4.4932
EURZAR	-569.8334	73.0870
GBPAUD	-13.6579	-1.7388
GBPCAD	-11.2944	-2.3731
GBPCHF	0.2957	-10.4524
GBPJPY	-1.5471	-9.1522
GBPPLN	-31.2612	-8.3153
GBPUSD	-10.9385	1.1789
NZDJPY	0.9211	-7.2468
NZDUSD	-4.1866	-1.5917
USDCAD	-2.4705	-8.0387

USDCHF	4.8926	-12.7026
USDCZK	-4.2717	-14.6168
USDHUF	4.8996	-31.7408
USDJPY	3.9313	-12.1535
USDNOK	7.3521	-76.1435
USDPLN	-6.5168	-23.9308
USDSEK	34.9886	-113.1758
USDTRY	-401.6419	182.1259
USDZAR	-385.5619	-42.8559
USDMXN	-55.6746	4.9412
XAGUSD	-1.3479	0.7634
XAUUSD	-11.1925	6.3351
COPPER	-0.5084	0.2878
AUDCAD.stp	-1.9903	-3.3706
AUDCHF.stp	3.3641	-7.3578
AUDJPY.stp	2.6566	-6.7824
AUDNZD.stp	-2.6963	-3.8105
AUDUSD.stp	-2.8587	-0.8797
CADCHF.stp	3.2134	-6.9408
CADJPY.stp	2.4413	-6.2624
CHFJPY.stp	-4.2813	-0.9328
CHFPLN.stp	-3.5384	1.5259
EURAUD.stp	-14.6982	5.8886
EURCAD.stp	-12.4784	4.9918
EURCHF.stp	-1.5166	-4.0653

EURGBP.stp	-4.8399	0.7311
EURJPY.stp	-3.3393	-2.3755
EURNOK.stp	-53.6005	4.0820
EURNZD.stp	-14.5742	5.3727
EURPLN.stp	-3.4718	1.2582
EURSEK.stp	-24.7675	-34.1680
EURTRY.stp	-506.3309	262.8497
EURUSD.stp	-11.5669	6.4052
GBPAUD.stp	-10.6991	1.2204
GBPCAD.stp	-8.4673	0.4543
GBPCHF.stp	2.3856	-8.3625
GBPJPY.stp	0.7537	-6.8512
GBPNZD.stp	-10.2414	0.3446
GBPPLN.stp	-2.3347	-0.0396
GBPUSD.stp	-8.8088	3.3087
NZDUSD.stp	-3.0500	-0.4548
USDCAD.stp	-0.2581	-5.8262
USDCHF.stp	6.5280	-11.0671
USDHKD.stp	25.2708	-59.0388
USDJPY.stp	5.7318	-10.3530
USDNOK.stp	21.5817	-61.9116
USDPLN.stp	-0.0322	-1.7734
USDSEK.stp	49.8770	-98.2850
USDTRY.stp	-397.0466	186.7227
XAGUSD.stp	-12.1786	8.9351

XAUUSD.stp	-101.1280	74.1491
3M	-2.6732	0.0000
AMAZON	-22.8262	0.0000
AIG	-0.5795	0.0000
APPLE	-2.1188	0.0000
AT&T	-0.4294	0.0000
BABA	-2.1078	0.0000
BOEING	-4.9089	0.0000
CHEVRON	-1.5652	0.0000
CISCO	-0.6050	0.0000
CITI	-0.7881	0.0000
COCACOLA	-0.6584	0.0000
EBAY	-0.4231	0.0000
EXXONM	-0.9976	0.0000
FACEBOOK	-2.0000	0.0000
GE	-0.1242	0.0000
GMOTORS	-0.5172	0.0000
GOOGLE	-14.8050	0.0000
IBM	-1.6893	0.0000
INTEL	-0.6807	0.0000
J&J	-1.8047	0.0000
JPMORGAN	-1.3903	0.0000
MCDONALD	-2.5362	0.0000
MICROSFT	-1.4298	0.0000
PFIZER	-0.5961	0.0000

P&G	-1.2763	0.0000
STBUCKS	-0.8877	0.0000
WALMART	-1.3193	0.0000
GOLDMAN	-2.4612	0.0000
UPS	-1.3623	0.0000
ALCOA	-0.3970	0.0000
AMERICANEXP	-1.3711	0.0000
BOA	-0.3618	0.0000
CATERPILLAR	-1.8376	0.0000
SNAP	-0.0872	0.0000
DISNEY	-1.5671	0.0000
FORD	-0.1226	0.0000
FEDEX	-2.3784	0.0000
HARLEY-DAVI	-0.5083	0.0000
HP	-0.1980	0.0000
NIKE	-1.0580	0.0000
PEPSI	-1.5053	0.0000
PM	-0.9670	0.0000
TWITTER	-0.4569	0.0000
VISA	-1.9200	0.0000
PAYPAL	-1.2614	0.0000
TESLA	-4.8311	0.0000
NETFLIX	-4.6971	0.0000
BASF	-3.6092	-5.0610
DTELEKOM	-0.8482	-1.1897

ALLIANZ	-10.2737	-14.4057
BAYER	-3.7410	-5.2467
BEIERSDO	-5.0998	-7.1534
DAIMLERC	-2.8214	-3.9569
DBANK	-0.4306	-0.6039
SIEMENS	-5.5936	-7.8441
LUFTHANS	-1.1587	-1.6262
CECONOMY	-0.1920	-0.2694
ADIDAS	-11.3503	-15.9176
BMW	-4.1308	-5.7939
COMMERZBANK	-0.3600	-0.5051
CONTINENTAL	-7.4127	-10.4010
HENKEL	-5.4977	-7.7111
RWE	-1.1541	-1.6189
THYSSEN	-0.9263	-1.2995
VOLKSWAGEN	-8.4593	-11.8764
BARCLAYS	-1.3933	-0.7621
GSK	-13.3364	-7.2929
M&S	-2.4196	-1.3238
RBS	-2.0149	-1.1020
ROLLS-ROYCE	-7.6327	-4.1747
RIOTINTO	-33.8591	-18.5156
SHELL	-20.6139	-11.2720
STAN	-5.3973	-2.9512
TESCO	-1.9104	-1.0449

UNILEVER	-35.7279	-19.5397
VODAFONE	-1.3262	-0.7253
SANTANDER	-0.2429	-0.3406
TELEFONICA	-0.4391	-0.6157
BBVA	-0.2863	-0.4015
IBERDOLA	-0.3963	-0.5558
REPSOL	-0.8393	-1.1771
CAIXABANK	-0.1869	-0.2622
REDELECTRIC	-1.1264	-1.5800
GRIFOLS	-1.3819	-1.9391
BANKINTER	-0.3915	-0.5490
MAPFRE	-0.1385	-0.1944
ACS	-1.9786	-2.7749
AMADEUS	-3.4832	-4.8867
INDITEX	-1.3420	-1.8824
ACERINOX	-0.5256	-0.7377
AENA	-8.0083	-11.2360
BANKIA	-0.1491	-0.2092
IAG	-0.3905	-0.5479
SACYR	-0.1133	-0.1597
TECNICAS	-1.2929	-1.8192
BOGDANKA	-0.6318	-0.1319
BUDIMEX	-1.3407	-0.2790
CCC	-2.0995	-0.4368
MBANK	-4.9022	-1.0197

ASSECOPL	-0.5453	-0.1134
SANTANDERPL	-4.1445	-0.8614
EUROCASH	-0.2134	-0.0445
KGHM	-1.0045	-0.2088
LOTOS	-1.0642	-0.2212
MILLENNI	-0.1024	-0.0213
NETIA	-0.0584	-0.0123
ORANGEPL	-0.0590	-0.0123
PEKAO	-1.2845	-0.2671
PGE	-0.1158	-0.0241
PGNIG	-0.0819	-0.0170
PKNORLEN	-1.2420	-0.2582
PKOBP	-0.4458	-0.0926
CDPROJEKT	-1.8159	-0.3777
PZU	-0.4988	-0.1036
CYFRPLST	-0.2586	-0.0538
ALIOR	-0.6244	-0.1298
HANDLOWY	-0.7894	-0.1642
CIECH	-0.5444	-0.1134
INGBSK	-2.1052	-0.4415
JSW	-0.7472	-0.1554
PKPCARGO	-0.5025	-0.1047
TAURON	-0.0246	-0.0051
LPP	-87.6773	-18.2367
ASHR.ETF	-0.3200	0.0006

DBA.ETF	-0.2396	0.0004
DBC.ETF	-0.2132	0.0004
EEM.ETF	-0.5666	0.0010
EFA.ETF	-0.8492	0.0015
EWA.ETF	-0.2812	0.0005
EWV.ETF	-0.6161	0.0011
EWY.ETF	-0.8327	0.0015
EWZ.ETF	-0.5951	0.0011
FXI.ETF	-0.5620	0.0010
GLD.ETF	-1.6944	0.0030
HYG.ETF	-1.1672	0.0021
IVV.ETF	-3.6236	0.0065
IYR.ETF	-1.0840	0.0019
OIH.ETF	-0.2279	0.0004
SLV.ETF	-0.2036	0.0004
SPY.ETF	-3.6024	0.0064
SSO.ETF	-1.3800	0.0025
SVXY.ETF	-0.6409	0.0011
TBT.ETF	-0.4927	0.0009
VNQ.ETF	-1.0819	0.0019
VXX.ETF	-0.5467	0.0010
XHB.ETF	-0.4924	0.0009
XLB.ETF	-0.7271	0.0013
XLE.ETF	-0.8627	0.0015
XLF.ETF	-0.3406	0.0006

XLI.ETF	-0.9445	0.0017
XLP.ETF	-0.7184	0.0013
XLU.ETF	-0.7406	0.0013
XLV.ETF	-1.2215	0.0022
XLY.ETF	-1.4551	0.0026
BITCOIN	-73.0458	-25.3765
BTCUSD	-249.2958	-201.7380
ETHUSD	-82.0944	-66.4742
LTCUSD	-21.3581	-17.3013
BCHUSD	-8.7964	-7.1281
XRPUSD	-22.5462	-18.2565

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