

Tabela punktów swapowych

Obowiązuje w dniach 2018.10.15 - 2018.10.21 Opublikowane punkty swapowe są naliczane w minimalnym kroku notowań dla danego instrumentu.

Instrument	Długa pozycja	Krótka pozycja
EURUSD.pro	-10.9738	6.1792
CADCHF.pro	2.8421	-6.6953
CADJPY.pro	1.9090	-6.2527
CHFJPY.pro	-4.4079	-0.9131
EURCAD.pro	-11.3887	4.2711
EURCHF.pro	-1.2377	-3.7452
EURGBP.pro	-4.5078	1.0076
EURJPY.pro	-3.3815	-2.2305
GBPCAD.pro	-7.5477	-0.4838
GBPCHF.pro	2.6712	-8.2913
GBPJPY.pro	0.7824	-7.1113
GBPUSD.pro	-8.3216	2.9156
USDCAD.pro	-0.2891	-6.0352
USDCHF.pro	6.1628	-10.6009
USDJPY.pro	5.2782	-10.2768
AUDCHF.pro	3.6176	-7.3925
AUDCAD.pro	-1.2384	-4.0770
AUDJPY.pro	2.8816	-7.1379
AUDNZD.pro	-2.7301	-3.7318
AUDUSD.pro	-2.3201	-1.3486
CHFPLN.pro	-3.5078	1.5924
EURAUD.pro	-14.9648	6.8519
EURCZK.pro	-1.9267	0.7307

EURHUF.pro	-1.4402	-0.5583
EURNOK.pro	-5.6150	1.1022
EURNZD.pro	-15.4579	6.7454
EURPLN.pro	-3.4603	1.4252
EURSEK.pro	-2.4212	-3.1136
EURTRY.pro	-558.0451	301.3979
GBPAUD.pro	-11.1945	2.0372
GBPNZD.pro	-11.2204	1.3870
GBPPLN.pro	-2.3945	0.0983
NZDJPY.pro	2.3338	-6.1705
NZDUSD.pro	-2.3964	-0.9080
USDCZK.pro	-0.0309	-1.0327
USDHUF.pro	0.8079	-2.5723
USDNOK.pro	1.1323	-5.1415
USDPLN.pro	-0.2684	-1.5403
USDSEK.pro	4.4777	-9.3804
USDTRY.pro	-438.7516	216.4280
EURZAR.pro	-58.5179	13.3464
USDZAR.pro	-39.9171	0.7224
SILVER.pro	-1.0726	0.7580
GOLD.pro	-8.9562	6.3251
COPPER.pro	-0.4566	0.3226
EURUSD.std	-12.9048	4.2482
CADCHF.std	1.5789	-7.9585
CADJPY.std	0.4773	-7.6845
CHFJPY.std	-6.2970	-2.8024

EURCAD.std	-13.9010	1.7587
EURCHF.std	-3.1420	-5.6494
EURGBP.std	-5.9663	-0.4509
EURJPY.std	-5.5399	-4.3889
GBPCAD.std	-10.3794	-3.3156
GBPCHF.std	0.5250	-10.4377
GBPJPY.std	-1.6503	-9.5441
GBPUSD.std	-10.4981	0.7390
USDCAD.std	-2.4573	-8.2035
USDCHF.std	4.5194	-12.2443
USDJPY.std	3.4154	-12.1396
AUDCHF.std	2.4444	-8.5659
AUDCAD.std	-2.7863	-5.6252
AUDJPY.std	1.5517	-8.4678
AUDNZD.std	-4.5503	-5.5521
AUDUSD.std	-3.5099	-2.5385
CHFPLN.std	-4.1299	0.9699
EURAUD.std	-17.6694	4.1472
EURCZK.std	-2.3564	0.3009
EURHUF.std	-1.9802	-1.0985
EURNOK.std	-7.1894	-0.4724
EURNZD.std	-18.4117	3.7912
EURPLN.std	-4.1712	0.7141
EURSEK.std	-4.1506	-4.8433
EURTRY.std	-563.6696	295.7688
GBPAUD.std	-14.2429	-1.0113

GBPNZD.std	-14.5497	-1.9428
GBPPLN.std	-3.1955	-0.7033
NZDJPY.std	1.1162	-7.3883
NZDUSD.std	-3.4858	-1.9976
USDCZK.std	-0.4018	-1.4037
USDHUF.std	0.3418	-3.0386
USDNOK.std	-0.2265	-6.5004
USDPLN.std	-0.8819	-2.1540
USDSEK.std	2.9852	-10.8733
USDTRY.std	-443.6034	211.5736
EURZAR.std	-59.9127	11.9512
USDZAR.std	-41.1209	-0.4816
SILVER.std	-1.1954	0.6351
GOLD.std	-9.9817	5.2994
COPPER.std	-0.5089	0.2703
AUDCAD	-2.7863	-5.6252
AUDCHF	2.4444	-8.5659
AUDJPY	1.5517	-8.4678
AUDNZD	-4.5503	-5.5521
AUDUSD	-3.5099	-2.5385
CADCHF	1.5789	-7.9585
CADJPY	0.4773	-7.6845
CHFJPY	-6.2970	-2.8024
CHFPLN	-41.2985	9.6989
EURAUD	-17.6694	4.1472
EURCAD	-13.9010	1.7587

EURCHF	-3.1420	-5.6494
EURCZK	-23.5644	3.0088
EURGBP	-5.9663	-0.4509
EURHUF	-19.8024	-10.9854
EURJPY	-5.5399	-4.3889
EURNOK	-71.8937	-4.7237
EURNZD	-18.4117	3.7912
EURPLN	-41.7115	7.1415
EURSEK	-41.5065	-48.4332
EURTRY	-563.6696	295.7688
EURUSD	-12.9048	4.2482
EURZAR	-599.1274	119.5121
GBPAUD	-14.2429	-1.0113
GBPCAD	-10.3794	-3.3156
GBPCHF	0.5250	-10.4377
GBPJPY	-1.6503	-9.5441
GBPPLN	-31.9548	-7.0326
GBPUSD	-10.4981	0.7390
NZDJPY	1.1162	-7.3883
NZDUSD	-3.4858	-1.9976
USDCAD	-2.4573	-8.2035
USDCHF	4.5194	-12.2443
USDCZK	-4.0177	-14.0369
USDHUF	3.4182	-30.3858
USDJPY	3.4154	-12.1396
USDNOK	-2.2646	-65.0042

USDPLN	-8.8190	-21.5396
USDSEK	29.8517	-108.7326
USDTRY	-443.6034	211.5736
USDZAR	-411.2094	-4.8162
USDMXN	-52.4360	2.8116
XAGUSD	-1.1954	0.6351
XAUUSD	-9.9817	5.2994
COPPER	-0.5089	0.2703
AUDCAD.stp	-1.2384	-4.0770
AUDCHF.stp	3.6176	-7.3925
AUDJPY.stp	2.8816	-7.1379
AUDNZD.stp	-2.7301	-3.7318
AUDUSD.stp	-2.3201	-1.3486
CADCHF.stp	2.8421	-6.6953
CADJPY.stp	1.9090	-6.2527
CHFJPY.stp	-4.4079	-0.9131
CHFPLN.stp	-3.5078	1.5924
EURAUD.stp	-14.9648	6.8519
EURCAD.stp	-11.3887	4.2711
EURCHF.stp	-1.2377	-3.7452
EURGBP.stp	-4.5078	1.0076
EURJPY.stp	-3.3815	-2.2305
EURNOK.stp	-56.1501	11.0220
EURNZD.stp	-15.4579	6.7454
EURPLN.stp	-3.4603	1.4252
EURSEK.stp	-24.2119	-31.1359

EURTRY.stp	-558.0451	301.3979
EURUSD.stp	-10.9738	6.1792
GBPAUD.stp	-11.1945	2.0372
GBPCAD.stp	-7.5477	-0.4838
GBPCHF.stp	2.6712	-8.2913
GBPJPY.stp	0.7824	-7.1113
GBPNZD.stp	-11.2204	1.3870
GBPPLN.stp	-2.3945	0.0983
GBPUSD.stp	-8.3216	2.9156
NZDUSD.stp	-2.3964	-0.9080
USDCAD.stp	-0.2891	-6.0352
USDCHF.stp	6.1628	-10.6009
USDHKD.stp	10.8847	-45.0623
USDJPY.stp	5.2782	-10.2768
USDNOK.stp	11.3228	-51.4149
USDPLN.stp	-0.2684	-1.5403
USDSEK.stp	44.7772	-93.8044
USDTRY.stp	-438.7516	216.4280
XAGUSD.stp	-10.7263	7.5804
XAUUSD.stp	-89.5618	63.2515
3M	-2.6306	-0.1212
AMAZON	-23.7469	-1.0946
AIG	-0.6604	-0.0304
APPLE	-2.9488	-0.1359
AT&T	-0.4279	-0.0197
BABA	-1.9625	-0.0904

BOEING	-4.7764	-0.2201
CHEVRON	-1.5624	-0.0720
CISCO	-0.6066	-0.0280
CITI	-0.9270	-0.0427
COCACOLA	-0.5928	-0.0273
EBAY	-0.4210	-0.0194
EXXONM	-1.0802	-0.0498
FACEBOOK	-2.0411	-0.0941
GE	-0.1632	-0.0075
GMOTORS	-0.4218	-0.0194
GOOGLE	-14.8774	-0.6856
IBM	-1.8699	-0.0862
INTEL	-0.5956	-0.0275
J&J	-1.7762	-0.0819
JPMORGAN	-1.4188	-0.0654
MCDONALD	-2.1751	-0.1002
MICROSFT	-1.4545	-0.0670
PFIZER	-0.5813	-0.0268
P&G	-1.0496	-0.0484
STBUCKS	-0.7494	-0.0345
WALMART	-1.2584	-0.0580
GOLDMAN	-2.8382	-0.1308
UPS	-1.5346	-0.0707
ALCOA	-0.4733	-0.0218
AMERICANEXP	-1.3675	-0.0630
BOA	-0.3773	-0.0174

CATERPILLAR	-1.8853	-0.0869
SNAP	-0.0953	-0.0044
DISNEY	-1.4946	-0.0689
FORD	-0.1147	-0.0053
FEDEX	-2.9345	-0.1352
HARLEY-DAVI	-0.5430	-0.0250
HP	-0.2045	-0.0094
NIKE	-1.0073	-0.0464
PEPSI	-1.3977	-0.0644
PM	-1.0922	-0.0503
TWITTER	-0.3716	-0.0171
VISA	-1.8589	-0.0857
PAYPAL	-1.0493	-0.0484
TESLA	-3.4365	-0.1585
NETFLIX	-4.5085	-0.2078
BASF	-4.0103	-5.5913
DTELEKOM	-0.8163	-1.1382
ALLIANZ	-10.5213	-14.6664
BAYER	-4.5400	-6.3296
BEIERSDO	-5.1730	-7.2119
DAIMLERC	-3.0449	-4.2448
DBANK	-0.5507	-0.7678
SIEMENS	-5.7788	-8.0562
LUFTHANS	-1.0760	-1.5001
CECONOMY	-0.2811	-0.3955
ADIDAS	-11.2210	-15.6441

BMW	-4.3671	-6.0911
COMMERZBANK	-0.5008	-0.6985
CONTINENTAL	-8.0618	-11.2489
HENKEL	-5.5096	-7.6826
RWE	-0.9953	-1.3885
THYSSEN	-1.1575	-1.6141
VOLKSWAGEN	-8.1054	-11.3136
BARCLAYS	-1.4522	-0.8018
GSK	-12.7392	-7.0336
M&S	-2.5934	-1.4322
RBS	-2.1432	-1.1838
ROLLS-ROYCE	-7.7060	-4.2548
RIOTINTO	-32.5895	-17.9931
SHELL	-22.0721	-12.1838
STAN	-4.9838	-2.7510
TESCO	-1.9261	-1.0635
UNILEVER	-34.8140	-19.2207
VODAFONE	-1.3426	-0.7411
SANTANDER	-0.2452	-0.3418
TELEFONICA	-0.4076	-0.5683
BBVA	-0.3084	-0.4300
IBERDOLA	-0.3482	-0.4857
REPSOL	-0.9475	-1.3210
CAIXABANK	-0.2230	-0.3109
ABERTIS	-1.0695	-1.4800
GASNATURAL	-1.2567	-1.7532

REDELECTRIC	-1.0301	-1.4362
GRIFOLS	-1.2834	-1.7904
BANKINTER	-0.4573	-0.6379
MAPFRE	-0.1493	-0.2084
ACS	-1.9152	-2.6719
AMADEUS	-4.0788	-5.6867
INDITEX	-1.4093	-1.9659
ACERINOX	-0.6530	-0.9110
AENA	-8.0734	-11.2610
BANKIA	-0.1840	-0.2568
IAG	-0.3828	-0.5339
SACYR	-0.1325	-0.1852
TECNICAS	-1.3994	-1.9562
BOGDANKA	-0.6783	-0.1411
BUDIMEX	-1.1705	-0.2436
CCC	-2.3547	-0.4901
MBANK	-4.5710	-0.9509
ASSECOPL	-0.5238	-0.1090
BZWBK	-3.9222	-0.8157
SANTANDERPL	-3.9222	-0.8157
EUROCASH	-0.2250	-0.0468
KGHM	-0.9569	-0.1991
LOTOS	-0.8080	-0.1680
MILLENNI	-0.0986	-0.0205
NETIA	-0.0529	-0.0111
ORANGEPL	-0.0505	-0.0105

PEKAO	-1.1547	-0.2401
PGE	-0.1105	-0.0230
PGNIG	-0.0727	-0.0151
PKNORLEN	-1.0834	-0.2252
PKOBP	-0.4395	-0.0914
CDPROJEKT	-1.8410	-0.3831
PZU	-0.4466	-0.0930
CYFRPLST	-0.2525	-0.0526
ALIOR	-0.7112	-0.1480
HANDLOWY	-0.8019	-0.1675
CIECH	-0.5299	-0.1103
ENERGA	-0.0913	-0.0190
INGBSK	-1.9305	-0.4043
JSW	-0.7588	-0.1583
PKPCARGO	-0.4582	-0.0955
TAURON	-0.0204	-0.0043
LPP	-96.2975	-20.0392
GETINNOBLE	-0.0058	-0.0012
ASHR.ETF	-0.3108	-0.0143
DBA.ETF	-0.2329	-0.0107
DBC.ETF	-0.2375	-0.0110
EEM.ETF	-0.5347	-0.0246
EFA.ETF	-0.8473	-0.0391
EWA.ETF	-0.2734	-0.0126
EWV.ETF	-0.6473	-0.0298
EWY.ETF	-0.8241	-0.0380

EWZ.ETF	-0.5125	-0.0236
FXI.ETF	-0.5320	-0.0245
GLD.ETF	-1.5301	-0.0705
HYG.ETF	-1.1308	-0.0521
IVV.ETF	-3.6914	-0.1701
IYR.ETF	-1.0033	-0.0462
OIH.ETF	-0.3217	-0.0148
SLV.ETF	-0.1823	-0.0084
SPY.ETF	-3.6646	-0.1689
SSO.ETF	-1.5210	-0.0701
SVXY.ETF	-0.6834	-0.0315
TBT.ETF	-0.5312	-0.0245
VNQ.ETF	-1.0067	-0.0464
VXX.ETF	-0.4516	-0.0208
XHB.ETF	-0.4627	-0.0213
XLB.ETF	-0.7140	-0.0329
XLE.ETF	-0.9686	-0.0446
XLF.ETF	-0.3510	-0.0162
XLI.ETF	-0.9810	-0.0452
XLP.ETF	-0.6955	-0.0321
XLU.ETF	-0.7033	-0.0324
XLV.ETF	-1.2089	-0.0557
XLY.ETF	-1.4407	-0.0664
BITCOIN	-129.5902	-49.9322
BTCUSD	-450.4462	-370.9252
ETHUSD	-145.8500	-120.4522

LTCUSD	-37.3505	-30.7956
BCHUSD	-32.7331	-27.0504
XRPUSD	-31.0681	-25.6649

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