

Tabela punktów swapowych TMS Prime

Obowiązuje w dniach 2018.09.17 - 2018.09.23. Opublikowane punkty swapowe są naliczane w minimalnym kroku notowań dla danego instrumentu.

Instrument	Długa pozycja	Krótka pozycja
EURUSD.pro	-10.1992	5.2618
CADCHF.pro	2.8812	-6.4328
CADJPY.pro	1.9346	-5.8523
CHFJPY.pro	-4.6256	-0.5480
EURCAD.pro	-11.2583	4.3224
EURCHF.pro	-1.2186	-3.8122
EURGBP.pro	-4.5782	0.9310
EURJPY.pro	-3.5534	-1.9762
GBPCAD.pro	-7.2403	-0.2921
GBPCHF.pro	2.6380	-8.0974
GBPJPY.pro	0.6579	-6.6469
GBPUSD.pro	-7.3058	1.9583
USDCAD.pro	-1.0129	-4.9199
USDCHF.pro	5.3609	-9.6638
USDJPY.pro	4.3857	-9.1141
AUDCHF.pro	3.3657	-7.0121
AUDCAD.pro	-1.3757	-3.6343
AUDJPY.pro	2.5893	-6.6299
AUDNZD.pro	-3.3368	-2.1845
AUDUSD.pro	-2.0132	-1.5948
CHFPLN.pro	-3.4282	1.4838
EURAUD.pro	-14.3929	6.2043
EURCZK.pro	-1.6905	0.3360
EURHUF.pro	-1.2454	-0.5733

EURNOK.pro	-4.4969	-0.0665
EURNZD.pro	-15.9655	8.4033
EURPLN.pro	-3.3129	1.2205
EURSEK.pro	-2.1518	-2.9812
EURTRY.pro	-582.0746	264.0133
GBPAUD.pro	-10.3829	1.4617
GBPNZD.pro	-11.6167	3.4236
GBPPLN.pro	-2.1891	-0.0880
NZDJPY.pro	3.0450	-6.1727
NZDUSD.pro	-1.2409	-1.5514
USDCZK.pro	0.0000	-1.1593
USDHUF.pro	0.7819	-2.3388
USDNOK.pro	1.5978	-5.5021
USDPLN.pro	-0.3921	-1.3984
USDSEK.pro	4.1157	-8.5082
USDTRY.pro	-457.6823	184.8401
EURZAR.pro	-58.5782	13.5099
USDZAR.pro	-40.2768	1.6287
SILVER.pro	-0.9294	0.6307
GOLD.pro	-7.8513	5.3238
COPPER.pro	-0.3864	0.2620
EURUSD.std	-12.1420	3.3190
CADCHF.std	1.6464	-7.6679
CADJPY.std	0.5016	-7.2854
CHFJPY.std	-6.5597	-2.4823
EURCAD.std	-13.7884	1.7922
EURCHF.std	-3.0934	-5.6871
EURGBP.std	-6.0515	-0.5424

EURJPY.std	-5.7290	-4.1519
GBPCAD.std	-10.0630	-3.1152
GBPCHF.std	0.5463	-10.1892
GBPJPY.std	-1.7694	-9.0744
GBPUSD.std	-9.4734	-0.2093
USDCAD.std	-3.1833	-7.0903
USDCHF.std	3.7526	-11.2721
USDJPY.std	2.5195	-10.9804
AUDCHF.std	2.2118	-8.1663
AUDCAD.std	-2.9332	-5.1918
AUDJPY.std	1.2500	-7.9692
AUDNZD.std	-5.1570	-4.0048
AUDUSD.std	-3.2092	-2.7908
CHFPLN.std	-4.0612	0.8505
EURAUD.std	-17.1002	3.4970
EURCZK.std	-2.1149	-0.0884
EURHUF.std	-1.7869	-1.1149
EURNOK.std	-6.0935	-1.6633
EURNZD.std	-18.9222	5.4461
EURPLN.std	-4.0250	0.5083
EURSEK.std	-3.8965	-4.7263
EURTRY.std	-588.1449	257.9302
GBPAUD.std	-13.4033	-1.5590
GBPNZD.std	-14.9156	0.1243
GBPPLN.std	-2.9834	-0.8827
NZDJPY.std	1.8188	-7.3990
NZDUSD.std	-2.3359	-2.6465
USDCZK.std	-0.3640	-1.5234

USDHUF.std	0.3174	-2.8034
USDNOK.std	0.2283	-6.8718
USDPLN.std	-1.0029	-2.0094
USDSEK.std	2.6191	-10.0052
USDTRY.std	-462.8871	179.6270
EURZAR.std	-60.0383	12.0492
USDZAR.std	-41.5292	0.3758
SILVER.std	-1.0475	0.5124
GOLD.std	-8.8494	4.3256
COPPER.std	-0.4355	0.2129
3M	-2.6948	0.0000
AMAZON	-25.5021	0.0000
AIG	-0.6906	0.0000
APPLE	-2.8975	0.0000
AT&T	-0.4354	0.0000
BABA	-2.1347	0.0000
BOEING	-4.6629	0.0000
CHEVRON	-1.5209	0.0000
CISCO	-0.6141	0.0000
CITI	-0.9143	0.0000
COCACOLA	-0.5959	0.0000
EBAY	-0.4417	0.0000
EXXONM	-1.0743	0.0000
FACEBOOK	-2.1029	0.0000
GE	-0.1644	0.0000
GMOTORS	-0.4487	0.0000
GOOGLE	-15.2607	0.0000
IBM	-1.9219	0.0000

INTEL	-0.5900	0.0000
J&J	-1.8077	0.0000
JPMORGAN	-1.4708	0.0000
MCDONALD	-2.0841	0.0000
MICROSFT	-1.4687	0.0000
PFIZER	-0.5567	0.0000
P&G	-1.0832	0.0000
STBUCKS	-0.7093	0.0000
WALMART	-1.2254	0.0000
GOLDMAN	-2.9702	0.0000
UPS	-1.5610	0.0000
ALCOA	-0.5543	0.0000
AMERICANEXP	-1.4198	0.0000
BOA	-0.3934	0.0000
CATERPILLAR	-1.8774	0.0000
SNAP	-0.1204	0.0000
DISNEY	-1.4153	0.0000
FORD	-0.1226	0.0000
FEDEX	-3.3095	0.0000
HARLEY-DAVI	-0.5736	0.0000
HP	-0.2148	0.0000
NIKE	-1.0818	0.0000
PEPSI	-1.4844	0.0000
PM	-1.0278	0.0000
TWITTER	-0.3901	0.0000
VISA	-1.9155	0.0000
PAYPAL	-1.1761	0.0000
TESLA	-3.8239	0.0000

NETFLIX	-4.7235	0.0000
BASF	-4.5374	0.0000
DTELEKOM	-0.8063	0.0000
ALLIANZ	-10.8454	0.0000
BAYER	-4.1895	0.0000
BEIERSDO	-5.7198	0.0000
DAIMLERC	-3.2394	0.0000
DBANK	-0.5717	0.0000
SIEMENS	-6.3653	0.0000
LUFTHANS	-1.3343	0.0000
CECONOMY	-0.3933	0.0000
ADIDAS	-12.1915	0.0000
BMW	-4.8164	0.0000
COMMERZBANK	-0.5178	0.0000
CONTINENTAL	-8.8410	0.0000
HENKEL	-6.0285	0.0000
RWE	-1.2519	0.0000
THYSSEN	-1.1127	0.0000
VOLKSWAGEN	-8.3148	0.0000
BARCLAYS	-1.5083	0.0000
GSK	-13.0674	0.0000
M&S	-2.5236	0.0000
RBS	-2.1791	0.0000
ROLLS-ROYCE	-8.5979	0.0000
RIOTINTO	-31.7321	0.0000
SHELL	-21.7907	0.0000
STAN	-5.3616	0.0000
TESCO	-2.0660	0.0000

UNILEVER	-37.4514	0.0000
VODAFONE	-1.4852	0.0000
SANTANDER	-0.2527	0.0000
TELEFONICA	-0.3910	0.0000
BBVA	-0.3214	0.0000
IBERDOLA	-0.3679	0.0000
REPSOL	-0.9923	0.0000
CAIXABANK	-0.2417	0.0000
ABERTIS	-1.0695	0.0000
GASNATURAL	-1.3729	0.0000
REDELECTRIC	-1.0572	0.0000
GRIFOLS	-1.3858	0.0000
BANKINTER	-0.4558	0.0000
MAPFRE	-0.1493	0.0000
ACS	-2.1886	0.0000
AMADEUS	-4.6123	0.0000
INDITEX	-1.5419	0.0000
ACERINOX	-0.6876	0.0000
AENA	-8.7036	0.0000
BANKIA	-0.1996	0.0000
IAG	-0.4500	0.0000
SACYR	-0.1528	0.0000
TECNICAS	-1.5881	0.0000
BOGDANKA	-0.6454	0.0000
BUDIMEX	-1.1365	0.0000
CCC	-2.4613	0.0000
MBANK	-4.5279	0.0000
ASSECOPL	-0.5000	0.0000

BZWBK	-4.1219	0.0000
EUROCASH	-0.2219	0.0000
KGHM	-0.9439	0.0000
LOTOS	-0.8405	0.0000
MILLENNI	-0.0930	0.0000
NETIA	-0.0516	0.0000
ORANGEPL	-0.0490	0.0000
PEKAO	-1.2165	0.0000
PGE	-0.0998	0.0000
PGNIG	-0.0682	0.0000
PKNORLEN	-1.1405	0.0000
PKOBP	-0.4542	0.0000
PZU	-0.4425	0.0000
CYFRPLST	-0.2477	0.0000
ALIOR	-0.6930	0.0000
HANDLOWY	-0.7599	0.0000
CIECH	-0.5242	0.0000
ENERGA	-0.0837	0.0000
INGBSK	-2.0144	0.0000
JSW	-0.7563	0.0000
PKPCARGO	-0.5201	0.0000
TAURON	-0.0191	0.0000
LPP	-99.7570	0.0000
GETINNOBLE	-0.0068	0.0000
ASHR.ETF	-0.3076	-0.0221
DBA.ETF	-0.2211	-0.0159
DBC.ETF	-0.2229	-0.0160
EEM.ETF	-0.5434	-0.0391

EFA.ETF	-0.8649	-0.0622
EWA.ETF	-0.2831	-0.0204
EWV.ETF	-0.6611	-0.0475
EWY.ETF	-0.8623	-0.0620

Maksymalna wielkość marży na stopę procentową przy kalkulacji punktów swapowych została określona w Tabeli Opłat i Prowizji TMS Trader. Do ustalenia w/w Punktów Swapowych TMS Brokers zastosował marżę w wysokości:

TMS Prime	
Wysokość prowizji na stopy procentowe uwzględniana przy kalkulacji punktów swapowych	
EURTRY.std, USDTRY.std, EURZAR.std, USDZAR.std, EURTRY.pro, USDTRY.pro, EURZAR.pro, USDZAR.pro	4,00%
Akcje i ETF'y	2,50%
Pozostałe FX(.pro) oraz COPPER.pro, GOLD.pro, SILVER.pro	0,35%
Pozostałe FX(.std) oraz COPPER.std, GOLD.std, SILVER.std	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).

$$long\ swap = -(kurs\ spot_{BID} \times \frac{(1 + (stopa\ \% \text{ waluty kwotowanej}_{ASK} + marża) \times \frac{1}{T})}{(1 + (stopa\ \% \text{ waluty bazowej}_{BID} - marża) \times \frac{1}{T})}) - kurs\ spot_{BID} \times \text{mnożnik}$$

$$short\ swap = (kurs\ spot_{ASK} \times \frac{(1 + (stopa\ \% \text{ waluty kwotowanej}_{BID} - marża) \times \frac{1}{T})}{(1 + (stopa\ \% \text{ waluty bazowej}_{ASK} + marża) \times \frac{1}{T})}) - kurs\ spot_{ASK} \times \text{mnożnik}$$

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%

$$long\ swap = - \left(1,2114 \times \frac{(1 + (1,82\% + 0,65\%) \times \frac{1}{360})}{(1 + ((-0,5\%) - 0,65\%) \times \frac{1}{360})} - 1,2114 \right) \times 100000 = -12,1817$$

$$short\ swap = \left(1,2115 \times \frac{\left(1 + (1,74\% - 0,65\%) \times \frac{1}{360} \right)}{\left(1 + ((-0,37\%) + 0,65\%) \times \frac{1}{360} \right)} - 1,2115 \right) \times 100000 = 2,7259$$

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