

Tabela punktów swapowych

Obowiązuje w dniach 2018.12.17 - 2018.12.23. Opublikowane punkty swapowe są naliczane w minimalnym kroku notowań dla danego instrumentu.

Instrument	Długa pozycja	Krótka pozycja
EURUSD.pro	-11.3078	6.4103
CADCHF.pro	3.0962	-7.5565
CADJPY.pro	1.9045	-5.9729
CHFJPY.pro	-6.0116	-0.2848
EURCAD.pro	-12.1398	4.7847
EURCHF.pro	-1.3471	-4.9344
EURGBP.pro	-4.6978	0.9435
EURJPY.pro	-3.9966	-1.6237
GBPCAD.pro	-8.0113	0.2189
GBPCHF.pro	2.5928	-9.2927
GBPJPY.pro	0.2115	-6.1334
GBPUSD.pro	-8.4774	3.3207
USDCAD.pro	-0.1859	-6.1706
USDCHF.pro	6.6296	-12.0724
USDJPY.pro	5.3810	-10.2268
AUDCHF.pro	3.2710	-8.0495
AUDCAD.pro	-2.1339	-3.6016
AUDJPY.pro	2.1679	-6.6395
AUDNZD.pro	-3.9520	-3.0742
AUDUSD.pro	-3.0098	-0.8971
CHFPLN.pro	-3.8615	1.5464
EURAUD.pro	-14.3961	5.6404

EURCZK.pro	-2.1365	0.7781
EURHUF.pro	-1.4007	-0.2111
EURNOK.pro	-5.5080	0.7734
EURNZD.pro	-15.8670	6.6393
EURPLN.pro	-3.4282	1.3092
EURSEK.pro	-2.5948	-2.5239
EURTRY.pro	-522.1352	288.7956
GBPAUD.pro	-10.2967	0.9612
GBPNZD.pro	-11.6254	1.7860
GBPLN.pro	-2.2626	0.0157
NZDJPY.pro	2.3781	-6.6210
NZDUSD.pro	-2.5718	-1.1348
USDCZK.pro	-0.0948	-1.0815
USDHUF.pro	1.0056	-2.3999
USDNOK.pro	1.9140	-6.0066
USDPLN.pro	-0.0540	-1.7784
USDSEK.pro	4.8275	-9.2546
USDTRY.pro	-417.9779	212.7214
EURZAR.pro	-53.5202	9.2114
USDZAR.pro	-35.9055	-3.0333
SILVER.pro	-1.1201	0.8121
GOLD.pro	-9.5054	6.8889
COPPER.pro	-0.4678	0.3390
EURUSD.std	-13.1978	4.5202
CADCHF.std	1.8577	-8.7951

CADJPY.std	0.4938	-7.3838
CHFJPY.std	-7.9100	-2.1833
EURCAD.std	-14.6690	2.2553
EURCHF.std	-3.2269	-6.8142
EURGBP.std	-6.1842	-0.5429
EURJPY.std	-6.1377	-3.7649
GBPCAD.std	-10.8084	-2.5785
GBPCHF.std	0.5140	-11.3717
GBPJPY.std	-2.1564	-8.5015
GBPUSD.std	-10.5677	1.2304
USDCAD.std	-2.4161	-8.4008
USDCHF.std	4.9723	-13.7298
USDJPY.std	3.4929	-12.1147
AUDCHF.std	2.0816	-9.2390
AUDCAD.std	-3.7344	-5.2023
AUDJPY.std	0.8130	-7.9944
AUDNZD.std	-5.7085	-4.8309
AUDUSD.std	-4.2058	-2.0931
CHFPLN.std	-4.4900	0.9175
EURAUD.std	-17.0296	3.0067
EURCZK.std	-2.5667	0.3478
EURHUF.std	-1.9395	-0.7500
EURNOK.std	-7.1361	-0.8548
EURNZD.std	-18.6427	3.8632
EURPLN.std	-4.1372	0.6001

EURSEK.std	-4.3056	-4.2350
EURTRY.std	-527.2204	283.7073
GBPAUD.std	-13.2092	-1.9516
GBPNZD.std	-14.6951	-1.2843
GBPPLN.std	-3.0465	-0.7686
NZDJPY.std	1.0926	-7.9065
NZDUSD.std	-3.7065	-2.2695
USDCZK.std	-0.4741	-1.4609
USDHUF.std	0.5305	-2.8751
USDNOK.std	0.4785	-7.4424
USDPLN.std	-0.6792	-2.4037
USDSEK.std	3.3189	-10.7634
USDTRY.std	-422.4597	208.2382
EURZAR.std	-54.8778	7.8534
USDZAR.std	-37.1027	-4.2306
SILVER.std	-1.2418	0.6903
GOLD.std	-10.5386	5.8556
COPPER.std	-0.5186	0.2882
AUDCAD	-3.7344	-5.2023
AUDCHF	2.0816	-9.2390
AUDJPY	0.8130	-7.9944
AUDNZD	-5.7085	-4.8309
AUDUSD	-4.2058	-2.0931
CADCHF	1.8577	-8.7951
CADJPY	0.4938	-7.3838

CHFJPY	-7.9100	-2.1833
CHFPLN	-44.9002	9.1749
EURAUD	-17.0296	3.0067
EURCAD	-14.6690	2.2553
EURCHF	-3.2269	-6.8142
EURCZK	-25.6674	3.4780
EURGBP	-6.1842	-0.5429
EURHUF	-19.3950	-7.4999
EURJPY	-6.1377	-3.7649
EURNOK	-71.3607	-8.5484
EURNZD	-18.6427	3.8632
EURPLN	-41.3717	6.0012
EURSEK	-43.0565	-42.3502
EURTRY	-527.2204	283.7073
EURUSD	-13.1978	4.5202
EURZAR	-548.7784	78.5342
GBPAUD	-13.2092	-1.9516
GBPCAD	-10.8084	-2.5785
GBPCHF	0.5140	-11.3717
GBPJPY	-2.1564	-8.5015
GBPPLN	-30.4648	-7.6864
GBPUSD	-10.5677	1.2304
NZDJPY	1.0926	-7.9065
NZDUSD	-3.7065	-2.2695
USDCAD	-2.4161	-8.4008

USDCHF	4.9723	-13.7298
USDCZK	-4.7413	-14.6091
USDHUF	5.3050	-28.7512
USDJPY	3.4929	-12.1147
USDNOK	4.7852	-74.4237
USDPLN	-6.7916	-24.0368
USDSEK	33.1891	-107.6340
USDTRY	-422.4597	208.2382
USDZAR	-371.0266	-42.3063
USDMXN	-53.8112	-0.2519
XAGUSD	-1.2418	0.6903
XAUUSD	-10.5386	5.8556
COPPER	-0.5186	0.2882
AUDCAD.stp	-2.1339	-3.6016
AUDCHF.stp	3.2710	-8.0495
AUDJPY.stp	2.1679	-6.6395
AUDNZD.stp	-3.9520	-3.0742
AUDUSD.stp	-3.0098	-0.8971
CADCHF.stp	3.0962	-7.5565
CADJPY.stp	1.9045	-5.9729
CHFJPY.stp	-6.0116	-0.2848
CHFPLN.stp	-3.8615	1.5464
EURAUD.stp	-14.3961	5.6404
EURCAD.stp	-12.1398	4.7847
EURCHF.stp	-1.3471	-4.9344

EURGBP.stp	-4.6978	0.9435
EURJPY.stp	-3.9966	-1.6237
EURNOK.stp	-55.0802	7.7344
EURNZD.stp	-15.8670	6.6393
EURPLN.stp	-3.4282	1.3092
EURSEK.stp	-25.9477	-25.2392
EURTRY.stp	-522.1352	288.7956
EURUSD.stp	-11.3078	6.4103
GBPAUD.stp	-10.2967	0.9612
GBPCAD.stp	-8.0113	0.2189
GBPCHF.stp	2.5928	-9.2927
GBPJPY.stp	0.2115	-6.1334
GBPNZD.stp	-11.6254	1.7860
GBPPLN.stp	-2.2626	0.0157
GBPUSD.stp	-8.4774	3.3207
NZDUSD.stp	-2.5718	-1.1348
USDCAD.stp	-0.1859	-6.1706
USDCHF.stp	6.6296	-12.0724
USDHKD.stp	6.5120	-40.3744
USDJPY.stp	5.3810	-10.2268
USDNOK.stp	19.1405	-60.0660
USDPLN.stp	-0.0540	-1.7784
USDSEK.stp	48.2747	-92.5459
USDTRY.stp	-417.9779	212.7214
XAGUSD.stp	-11.2005	8.1211

XAUUSD.stp	-95.0536	68.8894
3M	-2.6992	-0.0245
AMAZON	-21.9063	-0.1990
AIG	-0.5163	-0.0047
APPLE	-2.2764	-0.0207
AT&T	-0.4161	-0.0038
BABA	-2.0514	-0.0186
BOEING	-4.3872	-0.0398
CHEVRON	-1.5667	-0.0142
CISCO	-0.6304	-0.0057
CITI	-0.7573	-0.0069
COCACOLA	-0.6791	-0.0062
EBAY	-0.3979	-0.0036
EXXONM	-1.0407	-0.0095
FACEBOOK	-1.9826	-0.0180
GE	-0.0977	-0.0009
GMOTORS	-0.4831	-0.0044
GOOGLE	-14.4742	-0.1315
IBM	-1.6504	-0.0150
INTEL	-0.6586	-0.0060
J&J	-1.8277	-0.0166
JPMORGAN	-1.3808	-0.0125
MCDONALD	-2.5231	-0.0229
MICROSFT	-1.4591	-0.0133
PFIZER	-0.6034	-0.0055

P&G	-1.3301	-0.0121
STBUCKS	-0.8991	-0.0082
WALMART	-1.2642	-0.0115
GOLDMAN	-2.3780	-0.0216
UPS	-1.3578	-0.0123
ALCOA	-0.3938	-0.0036
AMERICANEXP	-1.4553	-0.0132
BOA	-0.3369	-0.0031
CATERPILLAR	-1.7450	-0.0159
SNAP	-0.0815	-0.0007
DISNEY	-1.5443	-0.0140
FORD	-0.1173	-0.0011
FEDEX	-2.5337	-0.0230
HARLEY-DAVI	-0.4776	-0.0043
HP	-0.1957	-0.0018
NIKE	-0.9984	-0.0091
PEPSI	-1.5683	-0.0142
PM	-1.1358	-0.0103
TWITTER	-0.4936	-0.0045
VISA	-1.8594	-0.0169
PAYPAL	-1.1826	-0.0107
TESLA	-5.0322	-0.0457
NETFLIX	-3.6708	-0.0334
BASF	-3.4577	-4.8131
DTELEKOM	-0.8881	-1.2370

ALLIANZ	-10.2459	-14.2640
BAYER	-3.7033	-5.1567
BEIERSDO	-5.3802	-7.4925
DAIMLERC	-2.7804	-3.8707
DBANK	-0.4507	-0.6277
SIEMENS	-5.8517	-8.1472
LUFTHANS	-1.1041	-1.5381
CECONOMY	-0.2097	-0.2921
ADIDAS	-10.9595	-15.2598
BMW	-4.3275	-6.0255
COMMERZBANK	-0.3743	-0.5212
CONTINENTAL	-7.1331	-9.9375
HENKEL	-5.6775	-7.9079
RWE	-1.1389	-1.5870
THYSSEN	-0.9099	-1.2669
VOLKSWAGEN	-8.5005	-11.8409
BARCLAYS	-1.3773	-0.7551
GSK	-13.1023	-7.1809
M&S	-2.2601	-1.2395
RBS	-1.8592	-1.0193
ROLLS-ROYCE	-7.1325	-3.9105
RIOTINTO	-33.0787	-18.1316
SHELL	-20.6543	-11.3207
STAN	-5.2158	-2.8592
TESCO	-1.7000	-0.9318

UNILEVER	-37.8795	-20.7599
VODAFONE	-1.4300	-0.7838
SANTANDER	-0.2356	-0.3281
TELEFONICA	-0.4571	-0.6364
BBVA	-0.2747	-0.3825
IBERDOLA	-0.4134	-0.5758
REPSOL	-0.8614	-1.1994
CAIXABANK	-0.1967	-0.2739
REDELECTRIC	-1.1839	-1.6488
GRIFOLS	-1.3697	-1.9083
BANKINTER	-0.4257	-0.5929
MAPFRE	-0.1385	-0.1929
ACS	-1.9335	-2.6931
AMADEUS	-3.5744	-4.9788
INDITEX	-1.3808	-1.9228
ACERINOX	-0.5013	-0.6993
AENA	-8.1521	-11.3519
BANKIA	-0.1611	-0.2245
IAG	-0.3903	-0.5436
SACYR	-0.0958	-0.1339
TECNICAS	-1.3569	-1.8929
BOGDANKA	-0.6318	-0.1319
BUDIMEX	-1.4178	-0.2964
CCC	-2.2004	-0.4578
MBANK	-4.8115	-1.0014

ASSECOPL	-0.5331	-0.1109
SANTANDERPL	-4.1264	-0.8595
EUROCASH	-0.2031	-0.0423
KGHM	-1.0226	-0.2127
LOTOS	-0.9791	-0.2036
MILLENNI	-0.1041	-0.0217
NETIA	-0.0549	-0.0115
ORANGEPL	-0.0542	-0.0113
PEKAO	-1.2114	-0.2519
PGE	-0.1203	-0.0250
PGNIG	-0.0783	-0.0163
PKNORLEN	-1.2403	-0.2578
PKOBP	-0.4625	-0.0961
CDPROJEKT	-1.5970	-0.3322
PZU	-0.4996	-0.1039
CYFRPLST	-0.2586	-0.0538
ALIOR	-0.6363	-0.1324
HANDLOWY	-0.7872	-0.1642
CIECH	-0.5342	-0.1113
INGBSK	-2.1324	-0.4439
JSW	-0.7520	-0.1565
PKPCARGO	-0.5030	-0.1053
TAURON	-0.0259	-0.0054
LPP	-87.2803	-18.1778
ASHR.ETF	-0.3170	-0.0029

DBA.ETF	-0.2385	-0.0022
DBC.ETF	-0.2127	-0.0019
EEM.ETF	-0.5482	-0.0050
EFA.ETF	-0.8315	-0.0076
EWA.ETF	-0.2760	-0.0025
EWV.ETF	-0.5541	-0.0050
EWY.ETF	-0.8081	-0.0073
EWZ.ETF	-0.5273	-0.0048
FXI.ETF	-0.5660	-0.0051
GLD.ETF	-1.6118	-0.0146
HYG.ETF	-1.1446	-0.0104
IVV.ETF	-3.6119	-0.0328
IYR.ETF	-1.1062	-0.0100
OIH.ETF	-0.2158	-0.0020
SLV.ETF	-0.1883	-0.0017
SPY.ETF	-3.5859	-0.0326
SSO.ETF	-1.3837	-0.0126
SVXY.ETF	-0.6300	-0.0057
TBT.ETF	-0.5120	-0.0047
VNQ.ETF	-1.0966	-0.0100
VXX.ETF	-0.5581	-0.0051
XHB.ETF	-0.4560	-0.0041
XLB.ETF	-0.7071	-0.0064
XLE.ETF	-0.8546	-0.0078
XLF.ETF	-0.3336	-0.0030

XLI.ETF	-0.9230	-0.0084
XLP.ETF	-0.7501	-0.0068
XLU.ETF	-0.7818	-0.0071
XLV.ETF	-1.2247	-0.0111
XLY.ETF	-1.4083	-0.0128
BITCOIN	-66.5914	-23.8208
BTCUSD	-228.3519	-185.6228
ETHUSD	-60.0735	-48.8315
LTCUSD	-19.1634	-15.6137
BCHUSD	-5.6184	-4.5832
XRPUSD	-20.2292	-16.4512

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