

Tabela punktów swapowych

Obowiązuje w dniach 2019.03.18 - 2019.03.24 Opublikowane punkty swapowe są naliczane w minimalnym kroku notowań dla danego instrumentu.

Instrument	Długa pozycja	Krótka pozycja
EURUSD.pro	-11.4509	6.3404
CADCHF.pro	3.3780	-6.9445
CADJPY.pro	2.2082	-6.1602
CHFJPY.pro	-4.7064	-0.5264
EURCAD.pro	-12.3120	5.0429
EURCHF.pro	-1.4197	-4.0066
EURGBP.pro	-4.6494	0.7024
EURJPY.pro	-3.9384	-2.0748
GBPCAD.pro	-8.6577	0.5679
GBPCHF.pro	2.6343	-8.6719
GBPJPY.pro	0.1856	-6.8744
GBPUSD.pro	-9.0772	3.4098
USDCAD.pro	-0.1850	-5.7724
USDCHF.pro	6.7503	-11.1947
USDJPY.pro	5.4498	-10.3730
AUDCHF.pro	3.8505	-7.2083
AUDCAD.pro	-1.3940	-3.1038
AUDJPY.pro	2.8176	-6.5380
AUDNZD.pro	-2.3567	-2.6731
AUDUSD.pro	-2.4288	-0.7306
CHFPLN.pro	-3.3754	1.4472
EURAUD.pro	-14.4210	6.7896

EURCZK.pro	-2.0798	0.9119
EURHUF.pro	-1.3269	-1.1963
EURNOK.pro	-6.0991	1.3436
EURNZD.pro	-14.7837	6.6583
EURPLN.pro	-3.3574	1.1415
EURSEK.pro	-3.1100	-2.0057
EURTRY.pro	-496.8841	309.5772
GBPAUD.pro	-10.8003	2.3095
GBPNZD.pro	-11.0142	1.9610
GBPLN.pro	-2.2952	-0.1788
NZDJPY.pro	2.5527	-6.2551
NZDUSD.pro	-2.4998	-0.6489
USDCZK.pro	-0.0251	-0.9285
USDHUF.pro	1.0454	-3.1755
USDNOK.pro	1.4431	-5.3474
USDPLN.pro	0.0711	-1.8966
USDSEK.pro	4.6321	-8.8304
USDTRY.pro	-393.5882	230.5367
EURZAR.pro	-56.0686	10.0159
USDZAR.pro	-37.8299	-2.2448
SILVER.pro	-1.1983	0.8791
GOLD.pro	-10.1913	7.4722
COPPER.pro	-0.5044	0.3699
EURUSD.std	-13.3437	4.4477
CADCHF.std	2.1269	-8.1957

CADJPY.std	0.8136	-7.5549
CHFJPY.std	-6.5642	-2.3843
EURCAD.std	-14.8333	2.5214
EURCHF.std	-3.3126	-5.8995
EURGBP.std	-6.0671	-0.7154
EURJPY.std	-6.0484	-4.1848
GBPCAD.std	-11.5811	-2.3558
GBPCHF.std	0.4395	-10.8667
GBPJPY.std	-2.2610	-9.3211
GBPUSD.std	-11.2718	1.2149
USDCAD.std	-2.4051	-7.9925
USDCHF.std	5.0836	-12.8613
USDJPY.std	3.5920	-12.2308
AUDCHF.std	2.6658	-8.3931
AUDCAD.std	-2.9721	-4.6820
AUDJPY.std	1.4969	-7.8588
AUDNZD.std	-4.0812	-4.3976
AUDUSD.std	-3.6136	-1.9153
CHFPLN.std	-4.0015	0.8205
EURAUD.std	-17.0835	4.1270
EURCZK.std	-2.5072	0.4844
EURHUF.std	-1.8507	-1.7202
EURNOK.std	-7.7112	-0.2687
EURNZD.std	-17.5386	3.9031
EURPLN.std	-4.0688	0.4300

EURSEK.std	-4.8539	-3.7498
EURTRY.std	-502.0606	304.4007
GBPAUD.std	-13.8874	-0.7779
GBPNZD.std	-14.2084	-1.2339
GBPPLN.std	-3.1199	-1.0040
NZDJPY.std	1.2764	-7.5316
NZDUSD.std	-3.6448	-1.7940
USDCZK.std	-0.4013	-1.3049
USDHUF.std	0.5842	-3.6368
USDNOK.std	0.0237	-6.7670
USDPLN.std	-0.5552	-2.5231
USDSEK.std	3.0966	-10.3661
USDTRY.std	-398.1434	225.9817
EURZAR.std	-57.4344	8.6500
USDZAR.std	-39.0325	-3.4474
SILVER.std	-1.3262	0.7511
GOLD.std	-11.2794	6.3841
COPPER.std	-0.5583	0.3160
AUDCAD	-2.9721	-4.6820
AUDCHF	2.6658	-8.3931
AUDJPY	1.4969	-7.8588
AUDNZD	-4.0812	-4.3976
AUDUSD	-3.6136	-1.9153
CADCHF	2.1269	-8.1957
CADJPY	0.8136	-7.5549

CHFJPY	-6.5642	-2.3843
CHFPLN	-40.0155	8.2047
EURAUD	-17.0835	4.1270
EURCAD	-14.8333	2.5214
EURCHF	-3.3126	-5.8995
EURCZK	-25.0720	4.8442
EURGBP	-6.0671	-0.7154
EURHUF	-18.5070	-17.2018
EURJPY	-6.0484	-4.1848
EURNOK	-77.1121	-2.6871
EURNZD	-17.5386	3.9031
EURPLN	-40.6878	4.3000
EURSEK	-48.5391	-37.4978
EURTRY	-502.0606	304.4007
EURUSD	-13.3437	4.4477
EURZAR	-574.3436	86.5004
GBPAUD	-13.8874	-0.7779
GBPCAD	-11.5811	-2.3558
GBPCHF	0.4395	-10.8667
GBPJPY	-2.2610	-9.3211
GBPPLN	-31.1991	-10.0396
GBPUSD	-11.2718	1.2149
NZDJPY	1.2764	-7.5316
NZDUSD	-3.6448	-1.7940
USDCAD	-2.4051	-7.9925

USDCHF	5.0836	-12.8613
USDCZK	-4.0135	-13.0486
USDHUF	5.8420	-36.3679
USDJPY	3.5920	-12.2308
USDNOK	0.2366	-67.6705
USDPLN	-5.5522	-25.2310
USDSEK	30.9661	-103.6609
USDTRY	-398.1434	225.9817
USDZAR	-390.3249	-34.4742
USDMXN	-56.1983	5.3115
XAGUSD	-1.3262	0.7511
XAUUSD	-11.2794	6.3841
COPPER	-0.5583	0.3160
AUDCAD.stp	-1.3940	-3.1038
AUDCHF.stp	3.8505	-7.2083
AUDJPY.stp	2.8176	-6.5380
AUDNZD.stp	-2.3567	-2.6731
AUDUSD.stp	-2.4288	-0.7306
CADCHF.stp	3.3780	-6.9445
CADJPY.stp	2.2082	-6.1602
CHFJPY.stp	-4.7064	-0.5264
CHFPLN.stp	-3.3754	1.4472
EURAUD.stp	-14.4210	6.7896
EURCAD.stp	-12.3120	5.0429
EURCHF.stp	-1.4197	-4.0066

EURGBP.stp	-4.6494	0.7024
EURJPY.stp	-3.9384	-2.0748
EURNOK.stp	-60.9906	13.4358
EURNZD.stp	-14.7837	6.6583
EURPLN.stp	-3.3574	1.1415
EURSEK.stp	-31.0997	-20.0571
EURTRY.stp	-496.8841	309.5772
EURUSD.stp	-11.4509	6.3404
GBPAUD.stp	-10.8003	2.3095
GBPCAD.stp	-8.6577	0.5679
GBPCHF.stp	2.6343	-8.6719
GBPJPY.stp	0.1856	-6.8744
GBPNZD.stp	-11.0142	1.9610
GBPPLN.stp	-2.2952	-0.1788
GBPUSD.stp	-9.0772	3.4098
NZDUSD.stp	-2.4998	-0.6489
USDCAD.stp	-0.1850	-5.7724
USDCHF.stp	6.7503	-11.1947
USDHKD.stp	19.8417	-53.6375
USDJPY.stp	5.4498	-10.3730
USDNOK.stp	14.4309	-53.4743
USDPLN.stp	0.0711	-1.8966
USDSEK.stp	46.3208	-88.3045
USDTRY.stp	-393.5882	230.5367
XAGUSD.stp	-11.9827	8.7911

XAUUSD.stp	-101.9132	74.7225
3M	-2.8789	-0.0105
AMAZON	-23.6936	-0.0868
AIG	-0.6094	-0.0022
APPLE	-2.5769	-0.0094
AT&T	-0.4244	-0.0016
BABA	-2.5031	-0.0092
BOEING	-5.2432	-0.0192
CHEVRON	-1.7339	-0.0064
CISCO	-0.7363	-0.0027
CITI	-0.9017	-0.0033
COCACOLA	-0.6269	-0.0023
EBAY	-0.5022	-0.0018
EXXONM	-1.1093	-0.0041
FACEBOOK	-2.2969	-0.0084
GE	-0.1380	-0.0005
GMOTORS	-0.5268	-0.0019
GOOGLE	-16.4752	-0.0604
IBM	-1.9295	-0.0071
INTEL	-0.7514	-0.0028
J&J	-1.9044	-0.0070
JPMORGAN	-1.4740	-0.0054
MCDONALD	-2.5637	-0.0094
MICROSFT	-1.6037	-0.0059
PFIZER	-0.5782	-0.0021

P&G	-1.4195	-0.0052
STBUCKS	-0.9778	-0.0036
WALMART	-1.3597	-0.0050
GOLDMAN	-2.7430	-0.0101
UPS	-1.5157	-0.0056
ALCOA	-0.3850	-0.0014
AMERICANEXP	-1.5711	-0.0058
BOA	-0.4053	-0.0015
CATERPILLAR	-1.8358	-0.0067
SNAP	-0.1543	-0.0006
DISNEY	-1.5910	-0.0058
FORD	-0.1167	-0.0004
FEDEX	-2.4629	-0.0090
HARLEY-DAVI	-0.5065	-0.0019
HP	-0.2224	-0.0008
NIKE	-1.2012	-0.0044
PEPSI	-1.5990	-0.0059
PM	-1.2573	-0.0046
TWITTER	-0.4322	-0.0016
VISA	-2.1521	-0.0079
PAYPAL	-1.3936	-0.0051
TESLA	-3.8126	-0.0140
NETFLIX	-5.0043	-0.0183
BASF	-3.8922	-5.4392
DTELEKOM	-0.8992	-1.2568

ALLIANZ	-11.6105	-16.2269
BAYER	-3.9124	-5.4675
BEIERSDO	-5.0648	-7.0801
DAIMLERC	-2.9739	-4.1561
DBANK	-0.4707	-0.6579
SIEMENS	-5.6865	-7.9463
LUFTHANS	-1.2057	-1.6854
CECONOMY	-0.2860	-0.3999
ADIDAS	-12.0566	-16.8543
BMW	-4.3012	-6.0115
COMMERZBANK	-0.4425	-0.6191
CONTINENTAL	-8.2559	-11.5398
HENKEL	-5.1876	-7.2533
RWE	-1.3007	-1.8190
THYSSEN	-0.7511	-1.0504
VOLKSWAGEN	-8.5862	-12.0053
BARCLAYS	-1.4685	-0.8051
GSK	-13.3609	-7.3250
M&S	-2.4076	-1.3207
RBS	-2.4244	-1.3295
ROLLS-ROYCE	-8.0219	-4.3992
RIOTINTO	-37.4018	-20.5072
SHELL	-21.2448	-11.6505
STAN	-5.5001	-3.0164
TESCO	-2.0484	-1.1233

UNILEVER	-37.8663	-20.7618
VODAFONE	-1.2768	-0.7001
SANTANDER	-0.2569	-0.3591
TELEFONICA	-0.4551	-0.6361
BBVA	-0.3156	-0.4411
IBERDOLA	-0.4450	-0.6220
REPSOL	-0.8806	-1.2309
CAIXABANK	-0.1758	-0.2459
REDELECTRIC	-1.1132	-1.5563
GRIFOLS	-1.3922	-1.9469
BANKINTER	-0.4117	-0.5757
MAPFRE	-0.1479	-0.2068
ACS	-2.2804	-3.1871
AMADEUS	-3.9107	-5.4659
INDITEX	-1.5034	-2.1023
ACERINOX	-0.5383	-0.7532
AENA	-9.4060	-13.1507
BANKIA	-0.1428	-0.1997
IAG	-0.3706	-0.5179
SACYR	-0.1326	-0.1862
TECNICAS	-1.3592	-1.9040
BOGDANKA	-53.4230	-11.1093
BUDIMEX	-149.4937	-31.2427
CCC	-240.9140	-50.1392
MBANK	-507.4619	-105.6975

ASSECOPL	-60.9658	-12.6879
SANTANDERPL	-441.4488	-91.8433
EUROCASH	-25.5886	-5.3249
KGHM	-115.5230	-24.0329
LOTOS	-105.2581	-21.8746
MILLENNI	-10.3897	-2.1653
NETIA	-5.6939	-1.1969
ORANGEPL	-6.2270	-1.2959
PEKAO	-126.5819	-26.3184
PGE	-12.0230	-2.4999
PGNIG	-7.2648	-1.5103
PKNORLEN	-115.3529	-23.9740
PKOBP	-44.1789	-9.1843
CDPROJEKT	-212.6712	-44.2016
PZU	-47.7178	-9.9147
CYFRPLST	-30.0348	-6.2485
ALIOR	-71.5710	-14.8792
HANDLOWY	-78.4899	-16.3518
CIECH	-66.2400	-13.7836
INGBSK	-219.3633	-45.8510
JSW	-67.9187	-14.1323
PKPCARGO	-47.8085	-9.9666
TAURON	-2.3955	-0.4990
LPP	-9561.6986	-1989.7808
ASHR.ETF	-0.3884	-0.0014

DBA.ETF	-0.2305	-0.0008
DBC.ETF	-0.2203	-0.0008
EEM.ETF	-0.5963	-0.0022
EFA.ETF	-0.9023	-0.0033
EWA.ETF	-0.2966	-0.0011
EWV.ETF	-0.5973	-0.0022
EWY.ETF	-0.8580	-0.0031
EWZ.ETF	-0.6045	-0.0022
FXI.ETF	-0.6151	-0.0023
GLD.ETF	-1.7015	-0.0062
HYG.ETF	-1.1869	-0.0043
IVV.ETF	-3.9352	-0.0144
IYR.ETF	-1.1901	-0.0044
OIH.ETF	-0.2350	-0.0009
SLV.ETF	-0.1983	-0.0007
SPY.ETF	-3.8935	-0.0143
SSO.ETF	-1.6214	-0.0059
SVXY.ETF	-0.7380	-0.0027
TBT.ETF	-0.4830	-0.0018
VNQ.ETF	-1.1866	-0.0043
VXXB.ETF	-0.3952	-0.0014
XHB.ETF	-0.5250	-0.0019
XLB.ETF	-0.7666	-0.0028
XLE.ETF	-0.9064	-0.0033
XLF.ETF	-0.3684	-0.0013

XLI.ETF	-1.0247	-0.0038
XLP.ETF	-0.7564	-0.0028
XLU.ETF	-0.8052	-0.0030
XLV.ETF	-1.2728	-0.0047
XLY.ETF	-1.5302	-0.0056
BITCOIN	-81.8443	-28.4282
BTCUSD	-279.3238	-225.9987
ETHUSD	-96.4191	-78.0275
LTCUSD	-41.2028	-33.4187
BCHUSD	-11.1883	-9.0951
XRPUSD	-22.0512	-17.8389

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