

Tabela punktów swapowych

Obowiązuje w dniach 2024.02.12 – 2024.02.18 Opublikowane punkty swapowe są naliczane w punktach procentowych w skali roku.

| FOREX | | |
|------------|---------------|----------------|
| Instrument | Długa pozycja | Krótka pozycja |
| GOLD | -7.11% | 3.51% |
| AUDCAD | -1.76% | -0.36% |
| AUDCHF | 1.47% | -3.55% |
| AUDJPY | 3.11% | -5.17% |
| AUDNZD | -2.20% | 0.08% |
| AUDUSD | -2.02% | -0.10% |
| CADCHF | 2.15% | -4.21% |
| CADJPY | 3.78% | -5.81% |
| CHFJPY | 0.59% | -2.73% |
| CHFPLN | -4.01% | 2.41% |
| EURAUD | -1.46% | -0.66% |
| EURCAD | -2.16% | 0.03% |
| EURCHF | 0.79% | -3.46% |
| EURGBP | -2.30% | 0.17% |
| EURHUF | -6.97% | 4.77% |
| EURJPY | 2.73% | -4.79% |
| EURNOK | -1.64% | -0.48% |
| EURNZD | -2.61% | 0.47% |
| EURPLN | -2.37% | -0.34% |
| EURSEK | -1.05% | -1.07% |
| EURTRY | -44.58% | 35.00% |
| EURUSD | -2.71% | 0.00% |
| GBPAUD | -0.22% | -1.86% |
| GBPCAD | -0.91% | -1.18% |
| GBPCHF | 2.29% | -4.34% |
| GBPJPY | 3.63% | -6.23% |
| GBPNZD | -1.06% | -0.46% |
| GBPPLN | -1.12% | -1.54% |
| GBPUSD | -1.46% | -1.21% |
| SILVER | -7.11% | 3.51% |
| NZDCAD | -0.32% | -1.19% |
| NZDCHF | 2.86% | -4.35% |
| NZDJPY | 4.20% | -6.22% |

OANDA TMS Brokers S.A. (dawniej: Dom Maklerski TMS Brokers S.A.) Złote Tarasy (Budynek Skylight), ul. Złota 59, 00-120 Warszawa tel. (22) 27 66 200, fax (22) 27 66 202, dommaklerski@tms.pl, www.tms.pl

OANDA TMS Brokers podlega nadzorowi Komisji Nadzoru Finansowego. Spółka zarejestrowana przez Sąd Rejonowy m.st. Warszawy w Warszawie, XII Wydział Gospodarczy Krajowego Rejestru Sądowego pod numerem KRS 0000204776
 Kapitał zakładowy: 3.537.560 zł, kapitał wpłacony: 3.537.560 zł, NIP: 526-27-59-131, REGON: 015715078

| | | |
|--------|---------|--------|
| NZDUSD | -0.87% | -1.21% |
| USDCAD | -0.79% | -1.29% |
| USDCHF | 2.41% | -4.45% |
| USDHUF | -5.53% | 3.39% |
| USDJPY | 3.74% | -6.33% |
| USDMXN | -10.41% | 1.41% |
| USDNOK | -0.28% | -1.79% |
| USDPLN | -1.00% | -1.65% |
| USDSEK | 0.30% | -2.38% |
| USDTRY | -42.64% | 33.21% |
| USDZAR | -7.31% | -1.65% |

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 | |
| TRY, ZAR ,MXN | 4.00% |
| Pozostałe FX | 0.40% |
| GOLD, SILVER | 1.80% |

Wzory na obliczanie punktów swapowych CFD opartych o waluty.

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

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

long swap - wartość % punktów swap naliczanych dla pozycji długiej;

short swap – wartość % punktów swap naliczanych dla pozycji krótkiej;

marża – wielkość prowizji, jaką TMS Brokers nakłada na stopę procentową;

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 | 360 | 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 | 360 | 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 |

OANDA TMS Brokers S.A. (dawniej: Dom Maklerski TMS Brokers S.A.) Złote Tarasy (Budynek Skylight), ul. Złota 59, 00-120 Warszawa tel. (22) 27 66 200, fax (22) 27 66 202, dommaklerski@tms.pl, www.tms.pl

OANDA TMS Brokers podlega nadzorowi Komisji Nadzoru Finansowego. Spółka zarejestrowana przez Sąd Rejonowy m.st. Warszawy w Warszawie, XII Wydział Gospodarczy Krajowego Rejestru Sądowego pod numerem KRS 0000204776
 Kapitał zakładowy: 3.537.560 zł, kapitał wpłacony: 3.537.560 zł, NIP: 526-27-59-131, REGON: 015715078

| | | | |
|-----|-----------------------|-----|--|
| HKD | HDDR1Z Curncy | 360 | Hong Kong Dollar 1 Week Deposit |
| TRY | BISTTREF | 360 | Turkish Lira Overnight Reference Rate |
| MXN | MXNI1M CMPN Curncy | 360 | Mexican Peso 1 Month Froward Implied Yeld |

Przykład.

Kalkulacja dla EURUSD

Marża waluty bazowej i kwotowanej: 0,4%

stopa % waluty bazowej BID : -0,64%

stopa % waluty bazowej ASK : -0,43%

stopa % waluty kwotowanej BID : 1,1%

stopa % waluty kwotowanej ASK : 1,15%

$$long\ swap\ \% = -\left(\frac{(1+(1,15\%+0,4\%))}{(1+((-0,64\%)-0,4\%))}\right) + 1 = -2,61\%$$

$$short\ swap\ \% = \left(\frac{(1+(1,1\%-0,4\%))}{(1+((-0,43\%)+0,4\%))}\right) - 1 = 0,73\%$$

Wzory na obliczanie punktów swapowych dla CFD, indeksów cashowych, surowców cashowych.

$$long\ swap\ \% = -(stopa\ \% + marża)$$

$$short\ swap\ \% = stopa\ \% - marża$$

Przykład.

Silver

Stopa procentowa – 0,8%

Marża – 1,8 %

long swap % = -(0,8 % + 1,8%)= -2,6%

short swap % = 0,8% - 1,8% = -1%

long swap % - wartość % punktów swap naliczanych dla pozycji długiej;

short swap % – wartość % punktów swap naliczanych dla pozycji krótkiej;

marża – wielkość prowizji, jaką TMS Brokers nakłada na stopę procentową;

stopa % waluty kwotowanej BID,ASK - dla wyznaczania stopy procentowej TMS Brokers przyjmuje wartości indeksów przedstawionych w poniższej tabeli:

| Waluta | Ticker w Bloomberg | Konwencja liczenia dni (T) | Opis |
|---------------|---------------------------|-----------------------------------|---------------------------------|
| USD | SOFRRATE Index | 360 | SOFR |
| EUR | ESTRON Index | 360 | ESTR |
| PLN | WIBR1M Index | 360 | GPW Benchmark WIBOR PLN 1 Month |
| GBP | SONIO/N Index | 360 | SONIA |