

Tabela punktów swapowych

Obowiązuje w dniach 2024.01.22 – 2024.01.28 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	3.12%	-5.17%
AUDNZD	-2.20%	0.08%
AUDUSD	-2.02%	-0.10%
CADCHF	2.15%	-4.21%
CADJPY	3.79%	-5.82%
CHFJPY	0.60%	-2.74%
CHFPLN	-3.89%	2.29%
EURAUD	-1.47%	-0.65%
EURCAD	-2.17%	0.03%
EURCHF	0.79%	-3.45%
EURGBP	-2.31%	0.18%
EURHUF	-7.70%	5.49%
EURJPY	2.73%	-4.79%
EURNOK	-1.65%	-0.47%
EURNZD	-2.61%	0.47%
EURPLN	-2.25%	-0.46%
EURSEK	-1.06%	-1.06%
EURTRY	-43.11%	33.54%
EURUSD	-2.72%	0.01%
GBPAUD	-0.22%	-1.86%
GBPCAD	-0.91%	-1.18%
GBPCHF	2.29%	-4.34%
GBPJPY	3.64%	-6.23%
GBPNZD	-1.06%	-0.46%
GBPPLN	-1.00%	-1.66%
GBPUSD	-1.46%	-1.21%
SILVER	-7.11%	3.51%
NZDCAD	-0.32%	-1.19%
NZDCHF	2.86%	-4.35%
NZDJPY	4.21%	-6.23%

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	-6.25%	4.09%
USDJPY	3.75%	-6.34%
USDMXN	-10.41%	1.41%
USDNOK	-0.28%	-1.79%
USDPLN	-0.88%	-1.78%
USDSEK	0.30%	-2.37%
USDTRY	-41.18%	31.77%
USDZAR	-7.34%	-1.62%

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.

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

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

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

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