

Tabela punktów swapowych TMS Prime

Obowiązuje w dniach 2018.07.23- 2018.07.29. Opublikowane punkty swapowe są naliczane w minimalnym kroku notowań dla danego instrumentu.

Instrument	Długa pozycja	Krótka pozycja
EURUSD.pro	-10,3677	5,2650
CADCHF.pro	3,0066	-6,6539
CADJPY.pro	2,1357	-5,9384
CHFJPY.pro	-4,4020	-0,7623
EURCAD.pro	-12,0089	4,9152
EURCHF.pro	-1,6928	-3,7888
EURGBP.pro	-4,2777	0,3182
EURJPY.pro	-3,7918	-1,9140
GBPCAD.pro	-8,9718	1,1146
GBPCHF.pro	1,4956	-7,5690
GBPJPY.pro	-0,4517	-5,8642
GBPUSD.pro	-8,2080	2,5610
USDCAD.pro	-1,3880	-4,4930
USDCHF.pro	5,2496	-9,7973
USDJPY.pro	4,2590	-8,9816
AUDCHF.pro	3,4373	-7,3343
AUDCAD.pro	-1,6223	-3,4341
AUDJPY.pro	2,6503	-6,7403
AUDNZD.pro	-3,5329	-2,7183
AUDUSD.pro	-2,0149	-1,6450

CHFPLN.pro	-3,3266	1,3873
EURAUD.pro	-14,1800	6,1467
EURCZK.pro	-1,5665	0,1941
EURHUF.pro	-1,3403	-0,5707
EURNOK.pro	-5,4884	0,9812
EURNZD.pro	-16,1324	7,2563
EURPLN.pro	-3,4244	1,2679
EURSEK.pro	-2,3272	-2,8737
EURTRY.pro	-353,2517	209,3273
GBPAUD.pro	-11,2844	2,3762
GBPNZD.pro	-13,0715	3,2263
GBPPLN.pro	-2,5771	0,1861
NZDJPY.pro	2,6896	-6,5150
NZDUSD.pro	-1,6263	-1,7967
USDCZK.pro	0,1535	-1,2963
USDHUF.pro	0,7352	-2,3304
USDNOK.pro	0,8158	-4,5558
USDPLN.pro	-0,4330	-1,3595
USDSEK.pro	3,9779	-8,3013
USDTRY.pro	-269,6647	147,3416
EURZAR.pro	-52,6793	10,6472
USDZAR.pro	-35,8921	0,1504
SILVER.pro	-1,0146	0,6883

GOLD.pro	-8,0614	5,4662
COPPER.pro	-0,4039	0,2739
EURUSD.std	-12,3179	3,3150
CADCHF.std	1,7495	-7,9113
CADJPY.std	0,7275	-7,3467
CHFJPY.std	-6,2686	-2,6291
EURCAD.std	-14,5732	2,3507
EURCHF.std	-3,6274	-5,7234
EURGBP.std	-5,7532	-1,1574
EURJPY.std	-5,9585	-4,0808
GBPCAD.std	-11,8285	-1,7425
GBPCHF.std	-0,6597	-9,7243
GBPJPY.std	-2,8656	-8,2782
GBPUSD.std	-10,3804	0,3885
USDCAD.std	-3,5796	-6,6846
USDCHF.std	3,5962	-11,4508
USDJPY.std	2,4073	-10,8334
AUDCHF.std	2,2133	-8,5583
AUDCAD.std	-3,2446	-5,0564
AUDJPY.std	1,2795	-8,1111
AUDNZD.std	-5,3447	-4,5305
AUDUSD.std	-3,2486	-2,8787
CHFPLN.std	-3,9428	0,7707

EURAUD.std	-16,8142	3,5124
EURCZK.std	-1,9976	-0,2372
EURHUF.std	-1,8836	-1,1143
EURNOK.std	-7,0794	-0,6099
EURNZD.std	-18,9963	4,3919
EURPLN.std	-4,1400	0,5522
EURSEK.std	-4,0511	-4,5978
EURTRY.std	-357,8966	204,6807
GBPAUD.std	-14,2189	-0,5586
GBPNZD.std	-16,2620	0,0352
GBPPLN.std	-3,3741	-0,6113
NZDJPY.std	1,4289	-7,7759
NZDUSD.std	-2,7609	-2,9314
USDCZK.std	-0,2149	-1,6649
USDHUF.std	0,2709	-2,7949
USDNOK.std	-0,5438	-5,9156
USDPLN.std	-1,0445	-1,9712
USDSEK.std	2,5046	-9,7748
USDTRY.std	-273,6326	143,3725
EURZAR.std	-53,9989	9,3272
USDZAR.std	-37,0199	-0,9776
SILVER.std	-1,1435	0,5592
GOLD.std	-9,0861	4,4413

COPPER.std	-0,4552	0,2226
3M	-2,5623	0,0000
AMAZON	-23,0195	0,0000
AIG	-0,6767	0,0000
APPLE	-2,4325	0,0000
AT&T	-0,3948	0,0000
BABA	-2,3754	0,0000
BOEING	-4,5039	0,0000
CHEVRON	-1,5514	0,0000
CISCO	-0,5329	0,0000
CITI	-0,8783	0,0000
COCACOLA	-0,5746	0,0000
EBAY	-0,4339	0,0000
EXXONM	-1,0331	0,0000
FACEBOOK	-2,6642	0,0000
GE	-0,1665	0,0000
GMOTORS	-0,4998	0,0000
GOOGLE	-15,2030	0,0000
IBM	-1,8576	0,0000
INTEL	-0,6590	0,0000
J&J	-1,5975	0,0000
JPMORGAN	-1,4125	0,0000
MCDONALD	-2,0048	0,0000

MICROSFT	-1,3489	0,0000
PFIZER	-0,4737	0,0000
P&G	-0,9987	0,0000
STBUCKS	-0,6461	0,0000
WALMART	-1,1176	0,0000
GOLDMAN	-2,9403	0,0000
UPS	-1,4225	0,0000
ALCOA	-0,5116	0,0000
AMERICANEXP	-1,2711	0,0000
BOA	-0,3821	0,0000
CATERPILLAR	-1,7369	0,0000
SNAP	-0,1683	0,0000
DISNEY	-1,4147	0,0000
FORD	-0,1339	0,0000
FEDEX	-2,9824	0,0000
HARLEY-DAVI	-0,5282	0,0000
HP	-0,1963	0,0000
NIKE	-0,9766	0,0000
PEPSI	-1,4727	0,0000
PM	-1,0700	0,0000
TWITTER	-0,5511	0,0000
VISA	-1,7893	0,0000
PAYPAL	-1,1101	0,0000

TESLA	-3,9797	0,0000
NETFLIX	-4,5837	0,0000
BASF	-4,8081	0,0000
DTELEKOM	-0,8014	0,0000
ALLIANZ	-10,5718	0,0000
BAYER	-5,3902	0,0000
BEIERSDO	-5,7928	0,0000
DAIMLERC	-3,3410	0,0000
DBANK	-0,6034	0,0000
SIEMENS	-6,7926	0,0000
LUFTHANS	-1,2224	0,0000
CECONOMY	-0,4067	0,0000
ADIDAS	-11,0385	0,0000
BMW	-4,6292	0,0000
COMMERZBANK	-0,4965	0,0000
CONTINENTAL	-11,2016	0,0000
HENKEL	-6,3539	0,0000
RWE	-1,2993	0,0000
THYSSEN	-1,2999	0,0000
VOLKSWAGEN	-8,2971	0,0000
BARCLAYS	-1,5696	0,0000
GSK	-13,2304	0,0000
M&S	-2,6264	0,0000

RBS	-2,0406	0,0000
ROLLS-ROYCE	-8,3387	0,0000
RIOTINTO	-34,1399	0,0000
SHELL	-22,4957	0,0000
STAN	-5,7047	0,0000
TESCO	-2,1881	0,0000
UNILEVER	-36,7214	0,0000
VODAFONE	-1,5046	0,0000
SANTANDER	-0,2694	0,0000
TELEFONICA	-0,4283	0,0000
BBVA	-0,3475	0,0000
IBERDOLA	-0,3904	0,0000
REPSOL	-0,9774	0,0000
CAIXABANK	-0,2159	0,0000
ABERTIS	-1,0695	0,0000
GASNATURAL	-1,3663	0,0000
REDELECTRIC	-1,0596	0,0000
GRIFOLS	-1,4514	0,0000
BANKINTER	-0,4901	0,0000
MAPFRE	-0,1504	0,0000
ACS	-2,1238	0,0000
AMADEUS	-4,2651	0,0000
INDITEX	-1,6990	0,0000

ACERINOX	-0,6523	0,0000
AENA	-9,1652	0,0000
BANKIA	-0,1809	0,0000
IAG	-0,4421	0,0000
SACYR	-0,1398	0,0000
TECNICAS	-1,4770	0,0000
ASHR.ETF	-0,3316	-0,0313
DBA.ETF	-0,2213	-0,0209
DBC.ETF	-0,2149	-0,0203
EEM.ETF	-0,5579	-0,0526
EFA.ETF	-0,8639	-0,0815
EWA.ETF	-0,2898	-0,0273
EWV.ETF	-0,6405	-0,0604
EWY.ETF	-0,8411	-0,0794
EWZ.ETF	-0,4522	-0,0427
FXI.ETF	-0,5376	-0,0507
GLD.ETF	-1,4793	-0,1396
HYG.ETF	-1,0867	-0,1025
IVV.ETF	-3,5747	-0,3372
IYR.ETF	-1,0183	-0,0961
OIH.ETF	-0,3233	-0,0305
SLV.ETF	-0,1852	-0,0175
SPY.ETF	-3,5504	-0,3349

SSO.ETF	-1,4980	-0,1413
SVXY.ETF	-0,1750	-0,0165
TBT.ETF	-0,4616	-0,0436
VNQ.ETF	-1,0290	-0,0971
VXX.ETF	-0,3970	-0,0374
XHB.ETF	-0,5202	-0,0491
XLB.ETF	-0,7398	-0,0698
XLE.ETF	-0,9502	-0,0896
XLF.ETF	-0,3498	-0,0330
XLI.ETF	-0,9446	-0,0891
XLP.ETF	-0,6705	-0,0633
XLU.ETF	-0,6634	-0,0626
XLV.ETF	-1,1007	-0,1038
XLY.ETF	-1,4234	-0,1343
BITCOIN	-150,1417	-65,3416
BTCUSD	-535,6697	-450,9641
ETHUSD	-322,3789	-271,5275
LTCUSD	-58,4192	-49,2745
BCHUSD	-56,7296	-47,8864
XRPUSD	-0,3154	-0,2665

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).

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

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

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. 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