

Tabela punktów swapowych TMS Trader

Obowiązuje w dniach 2018.05.28- 2018.06.03. Opublikowane punkty swapowe są naliczane w minimalnym kroku notowań dla danego instrumentu.

Instrument	Długa pozycja	Krótka pozycja
AUDCAD	-3,2749	-5,1861
AUDCHF	1,8869	-8,4355
AUDJPY	0,5741	-7,3259
AUDNZD	-5,8975	-3,9326
AUDUSD	-3,3818	-2,8569
CADCHF	1,2839	-7,7361
CADJPY	-0,1168	-6,5211
CHFJPY	-6,7142	-2,0956
CHFPLN	-41,4913	9,247
EURAUD	-15,1824	2,1385
EURCAD	-13,237	0,8405
EURCHF	-3,3553	-6,2453
EURCZK	-181,2345	-42,8279
EURGBP	-5,5457	-1,3291
EURHUF	-21,7186	-14,1896
EURJPY	-6,0111	-3,8543
EURNOK	-70,4109	-7,9428
EURNZD	-18,1616	3,7262
EURPLN	-42,0481	5,8412
EURSEK	-38,9579	-47,7815

EURTRY	-318,3471	171,2239
EURUSD	-11,515	2,3937
EURZAR	-491,3903	80,6037
GBPAUD	-12,9489	-1,6319
GBPCAD	-10,8006	-3,0456
GBPCHF	-0,5224	-10,2047
GBPJPY	-3,2242	-7,7798
GBPPLN	-35,7425	-4,7233
GBPUSD	-9,8304	-0,3461
NZDJPY	1,1598	-7,4661
NZDUSD	-2,5271	-3,2991
USDCAD	-3,4644	-6,893
USDCHF	3,1569	-11,1809
USDCZK	-2,1444	-16,613
USDHUF	-1,9793	-28,2549
USDJPY	1,4879	-9,7167
USDNOK	-10,6837	-54,7956
USDPLN	-13,6199	-16,6572
USDSEK	20,0236	-92,5697
USDTRY	-245,4763	120,1027
USDZAR	-346,2438	-3,8069
USDMXN	-62,6963	11,1585
XAGUSD	-1,1245	0,4988

XAUUSD	-8,8708	3,9311
COPPER	-0,4685	0,2076
3M	-2,474	0
AMAZON	-20,0113	0
AIG	-0,6625	0
APPLE	-2,3439	0
AT&T	-0,404	0
BABA	-2,4761	0
BOEING	-4,4753	0
CHEVRON	-1,5189	0
CISCO	-0,5376	0
CITI	-0,8506	0
COCACOLA	-0,527	0
EBAY	-0,4714	0
EXXONM	-0,9783	0
FACEBOOK	-2,2985	0
GE	-0,1818	0
GMOTORS	-0,476	0
GOOGLE	-13,4695	0
IBM	-1,7855	0
INTEL	-0,6891	0
J&J	-1,5093	0
JPMORGAN	-1,3751	0

MCDONALD	-2,028	0
MICROSFT	-1,223	0
PFIZER	-0,4435	0
P&G	-0,9237	0
STBUCKS	-0,72	0
WALMART	-1,025	0
GOLDMAN	-2,9217	0
UPS	-1,4357	0
ALCOA	-0,5956	0
AMERICANEXP	-1,2569	0
BOA	-0,3748	0
CATERPILLAR	-1,9378	0
SNAP	-0,1331	0
DISNEY	-1,2705	0
FORD	-0,143	0
FEDEX	-3,1267	0
HARLEY-DAVI	-0,526	0
HP	-0,1928	0
NIKE	-0,8984	0
PEPSI	-1,247	0
PM	-0,9988	0
TWITTER	-0,4181	0
VISA	-1,6312	0

PAYPAL	-1,0063	0
TESLA	-3,4667	0
NETFLIX	-4,3666	0
BASF	-5,088	0
DTELEKOM	-0,779	0
ALLIANZ	-10,944	0
BAYER	-5,8804	0
BEIERSDO	-5,8081	0
DAIMLERC	-3,7606	0
DBANK	-0,6073	0
SIEMENS	-6,7253	0
LUFTHANS	-1,4552	0
CECONOMY	-0,4902	0
ADIDAS	-11,3723	0
BMW	-5,1785	0
COMMERZBANK	-0,5897	0
CONTINENTAL	-13,0585	0
HENKEL	-6,1996	0
RWE	-1,1711	0
THYSSEN	-1,2557	0
VOLKSWAGEN	-9,9485	0
BARCLAYS	-1.7212	0.0000
GSK	-12.2523	0.0000

M&S	-2.4464	0.0000
RBS	-2.4053	0.0000
ROLLS-ROYCE	-7.0098	0.0000
RIOTINTO	-35.8823	0.0000
SHELL	-22.5091	0.0000
STAN	-6.1787	0.0000
TESCO	-2.0489	0.0000
UNILEVER	-34.2769	0.0000
VODAFONE	-1.6028	0.0000
SANTANDER	-0,2866	0
TELEFONICA	-0,451	0
BBVA	-0,3586	0
IBERDOLA	-0,3689	0
REPSOL	-0,9167	0
CAIXABANK	-0,2253	0
ABERTIS	-1,0707	0
GASNATURAL	-1,244	0
REDELECTRIC	-0,9803	0
GRIFOLS	-1,4593	0
BANKINTER	-0,4915	0
MAPFRE	-0,1611	0
ACS	-2,0965	0
AMADEUS	-3,9677	0

INDITEX	-1,6513	0
ACERINOX	-0,6626	0
AENA	-9,6422	0
BANKIA	-0,2011	0
IAG	-0,467	0
SACYR	-0,146	0
TECNICAS	-1,5194	0
BOGDANKA	-0,5586	0
BUDIMEX	-1,8193	0
CCC	-3,1146	0
MBANK	-4,8705	0
ASSECOPL	-0,4646	0
BZWBK	-4,0561	0
EUROCASH	-0,2628	0
KGHM	-1,0197	0
LOTOS	-0,6261	0
MILLENNI	-0,0944	0
NETIA	-0,055	0
ORANGEPL	-0,0559	0
PEKAO	-1,2987	0
PGE	-0,1046	0
PGNIG	-0,0692	0
PKNORLEN	-0,9627	0

PKOBP	-0,4424	0
PZU	-0,436	0
CYFRPLST	-0,2935	0
ALIOR	-0,8047	0
HANDLOWY	-0,9029	0
CIECH	-0,6857	0
ENERGA	-0,1015	0
INGBSK	-2,1959	0
JSW	-0,9435	0
PKPCARGO	-0,4923	0
TAURON	-0,0227	0
LPP	-106,5625	0
GETINNOBLE	-0,0119	0
ASHR.ETF	-0,3711	-0,0435
DBA.ETF	-0,2407	-0,0282
DBC.ETF	-0,224	-0,0263
EEM.ETF	-0,5771	-0,0676
EFA.ETF	-0,8729	-0,1023
EWA.ETF	-0,2808	-0,0329
EWV.ETF	-0,5721	-0,067
EWY.ETF	-0,9216	-0,108
EWZ.ETF	-0,4631	-0,0543
FXI.ETF	-0,5859	-0,0687

GLD.ETF	-1,5319	-0,1795
HYG.ETF	-1,0635	-0,1246
IVV.ETF	-3,4073	-0,3992
IYR.ETF	-0,9585	-0,1123
OIH.ETF	-0,3368	-0,0395
SLV.ETF	-0,1931	-0,0226
SPY.ETF	-3,3838	-0,3965
SSO.ETF	-1,3879	-0,1626
SVXY.ETF	-0,168	-0,0197
TBT.ETF	-0,4651	-0,0545
VNQ.ETF	-0,9665	-0,1132
VXX.ETF	-0,4256	-0,0499
XHB.ETF	-0,4954	-0,0581
XLB.ETF	-0,7336	-0,086
XLE.ETF	-0,9271	-0,1086
XLF.ETF	-0,346	-0,0406
XLI.ETF	-0,9414	-0,1103
XLP.ETF	-0,62	-0,0727
XLU.ETF	-0,6275	-0,0735
XLV.ETF	-1,0316	-0,1209
XLY.ETF	-1,3196	-0,1546
BITCOIN	-136,8222	-65,4979
BTCUSD	-498,4667	-427,1428

ETHUSD	-369,1521	-316,3842
LTCUSD	-77,6622	-66,6147
BCHUSD	-63,8754	-54,8473
XRPUSD	-0,3924	-0,3363

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 Trader

Wysokość prowizji na stopy procentowe uwzględniana przy kalkulacji punktów swapowych	
EURTRY, USDTRY, EURZAR, USDZAR, USDMXN	4,00%
Akcje i ETF'y	2,50%
Pozostałe FX oraz COPPER, XAGUSD, XAUUSD	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).

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

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

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