

Tabela punktów swapowych

Obowiązuje w dniach 2018.10.29 - 2018.11.04 Opublikowane punkty swapowe są naliczane w minimalnym kroku notowań dla danego instrumentu.

Instrument	Długa pozycja	Krótka pozycja
EURUSD.pro	-10.8245	6.1401
CADCHF.pro	3.5011	-7.6183
CADJPY.pro	2.4294	-6.2647
CHFJPY.pro	-5.3938	-0.4366
EURCAD.pro	-11.9715	5.5100
EURCHF.pro	-1.2659	-4.4942
EURGBP.pro	-4.5715	1.0447
EURJPY.pro	-3.6589	-1.6342
GBPCAD.pro	-8.1482	0.9157
GBPCHF.pro	2.6506	-9.1039
GBPJPY.pro	0.4546	-6.3773
GBPUSD.pro	-8.1152	2.8744
USDCAD.pro	-0.8361	-4.9807
USDCHF.pro	6.2762	-11.4436
USDJPY.pro	5.0813	-9.8515
AUDCHF.pro	3.8025	-7.6463
AUDCAD.pro	-1.4443	-2.9149
AUDJPY.pro	2.8753	-6.4585
AUDNZD.pro	-2.1065	-3.0098
AUDUSD.pro	-2.1478	-1.0248
CHFPLN.pro	-3.8081	1.6151
EURAUD.pro	-14.1859	7.1828
EURCZK.pro	-1.9371	0.7391

EURHUF.pro	-1.5494	-0.8110
EURNOK.pro	-5.8091	1.2677
EURNZD.pro	-14.6445	7.0579
EURPLN.pro	-3.5008	1.4559
EURSEK.pro	-2.2225	-2.7426
EURTRY.pro	-512.7533	325.6565
GBPAUD.pro	-10.2321	2.3931
GBPNZD.pro	-10.2691	1.7763
GBPPLN.pro	-2.3986	0.1087
NZDJPY.pro	2.3473	-5.6550
NZDUSD.pro	-2.2550	-0.6729
USDCZK.pro	-0.0252	-1.0518
USDHUF.pro	0.7431	-2.8470
USDNOK.pro	1.0659	-5.1453
USDPLN.pro	-0.2741	-1.5634
USDSEK.pro	4.7873	-9.2471
USDTRY.pro	-408.9621	244.0711
EURZAR.pro	-55.3829	11.8159
USDZAR.pro	-37.9206	-0.4823
SILVER.pro	-1.0665	0.7577
GOLD.pro	-8.9483	6.3537
COPPER.pro	-0.4523	0.3212
EURUSD.std	-12.7237	4.2411
CADCHF.std	2.2280	-8.8915
CADJPY.std	1.0003	-7.6939
CHFJPY.std	-7.2646	-2.3075

EURCAD.std	-14.4571	3.0243
EURCHF.std	-3.1648	-6.3931
EURGBP.std	-6.0411	-0.4248
EURJPY.std	-5.7903	-3.7656
GBPCAD.std	-10.9286	-1.8649
GBPCHF.std	0.5266	-11.2281
GBPJPY.std	-1.9296	-8.7616
GBPUSD.std	-10.2396	0.7499
USDCAD.std	-3.0174	-7.1620
USDCHF.std	4.6100	-13.1100
USDJPY.std	3.2109	-11.7219
AUDCHF.std	2.6204	-8.8287
AUDCAD.std	-2.9917	-4.4626
AUDJPY.std	1.5482	-7.7856
AUDNZD.std	-3.9121	-4.8156
AUDUSD.std	-3.3301	-2.2072
CHFPLN.std	-4.4349	0.9878
EURAUD.std	-16.8626	4.5059
EURCZK.std	-2.3676	0.3086
EURHUF.std	-2.0899	-1.3517
EURNOK.std	-7.3935	-0.3169
EURNZD.std	-17.5445	4.1574
EURPLN.std	-4.2152	0.7414
EURSEK.std	-3.9544	-4.4747
EURTRY.std	-518.0076	320.3957
GBPAUD.std	-13.2264	-0.6013

GBPNZD.std	-13.5131	-1.4682
GBPPLN.std	-3.1974	-0.6907
NZDJPY.std	1.1226	-6.8798
NZDUSD.std	-3.3461	-1.7642
USDCZK.std	-0.4029	-1.4297
USDHUF.std	0.2688	-3.3215
USDNOK.std	-0.3244	-6.5358
USDPLN.std	-0.9009	-2.1903
USDSEK.std	3.2676	-10.7671
USDTRY.std	-413.5709	239.4582
EURZAR.std	-56.7565	10.4418
USDZAR.std	-39.1260	-1.6881
SILVER.std	-1.1886	0.6355
GOLD.std	-9.9729	5.3289
COPPER.std	-0.5041	0.2694
AUDCAD	-2.9917	-4.4626
AUDCHF	2.6204	-8.8287
AUDJPY	1.5482	-7.7856
AUDNZD	-3.9121	-4.8156
AUDUSD	-3.3301	-2.2072
CADCHF	2.2280	-8.8915
CADJPY	1.0003	-7.6939
CHFJPY	-7.2646	-2.3075
CHFPLN	-44.3486	9.8778
EURAUD	-16.8626	4.5059
EURCAD	-14.4571	3.0243

EURCHF	-3.1648	-6.3931
EURCZK	-23.6764	3.0857
EURGBP	-6.0411	-0.4248
EURHUF	-20.8993	-13.5166
EURJPY	-5.7903	-3.7656
EURNOK	-73.9347	-3.1691
EURNZD	-17.5445	4.1574
EURPLN	-42.1517	7.4140
EURSEK	-39.5436	-44.7465
EURTRY	-518.0076	320.3957
EURUSD	-12.7237	4.2411
EURZAR	-567.5653	104.4183
GBPAUD	-13.2264	-0.6013
GBPCAD	-10.9286	-1.8649
GBPCHF	0.5266	-11.2281
GBPJPY	-1.9296	-8.7616
GBPPLN	-31.9741	-6.9065
GBPUSD	-10.2396	0.7499
NZDJPY	1.1226	-6.8798
NZDUSD	-3.3461	-1.7642
USDCAD	-3.0174	-7.1620
USDCHF	4.6100	-13.1100
USDCZK	-4.0290	-14.2966
USDHUF	2.6877	-33.2146
USDJPY	3.2109	-11.7219
USDNOK	-3.2441	-65.3584

USDPLN	-9.0091	-21.9035
USDSEK	32.6757	-107.6709
USDTRY	-413.5709	239.4582
USDZAR	-391.2605	-16.8805
USDMXN	-58.0260	6.6668
XAGUSD	-1.1886	0.6355
XAUUSD	-9.9729	5.3289
COPPER	-0.5041	0.2694
AUDCAD.stp	-1.4443	-2.9149
AUDCHF.stp	3.8025	-7.6463
AUDJPY.stp	2.8753	-6.4585
AUDNZD.stp	-2.1065	-3.0098
AUDUSD.stp	-2.1478	-1.0248
CADCHF.stp	3.5011	-7.6183
CADJPY.stp	2.4294	-6.2647
CHFJPY.stp	-5.3938	-0.4366
CHFPLN.stp	-3.8081	1.6151
EURAUD.stp	-14.1859	7.1828
EURCAD.stp	-11.9715	5.5100
EURCHF.stp	-1.2659	-4.4942
EURGBP.stp	-4.5715	1.0447
EURJPY.stp	-3.6589	-1.6342
EURNOK.stp	-58.0911	12.6766
EURNZD.stp	-14.6445	7.0579
EURPLN.stp	-3.5008	1.4559
EURSEK.stp	-22.2250	-27.4255

EURTRY.stp	-512.7533	325.6565
EURUSD.stp	-10.8245	6.1401
GBPAUD.stp	-10.2321	2.3931
GBPCAD.stp	-8.1482	0.9157
GBPCHF.stp	2.6506	-9.1039
GBPJPY.stp	0.4546	-6.3773
GBPNZD.stp	-10.2691	1.7763
GBPPLN.stp	-2.3986	0.1087
GBPUSD.stp	-8.1152	2.8744
NZDUSD.stp	-2.2550	-0.6729
USDCAD.stp	-0.8361	-4.9807
USDCHF.stp	6.2762	-11.4436
USDHKD.stp	9.8035	-43.7891
USDJPY.stp	5.0813	-9.8515
USDNOK.stp	10.6592	-51.4528
USDPLN.stp	-0.2741	-1.5634
USDSEK.stp	47.8733	-92.4711
USDTRY.stp	-408.9621	244.0711
XAGUSD.stp	-10.6652	7.5774
XAUUSD.stp	-89.4832	63.5371
3M	-2.4647	-0.1045
AMAZON	-21.8396	-0.9257
AIG	-0.5450	-0.0231
APPLE	-2.8784	-0.1220
AT&T	-0.3876	-0.0164
BABA	-1.9042	-0.0807

BOEING	-4.7827	-0.2027
CHEVRON	-1.4863	-0.0630
CISCO	-0.5895	-0.0250
CITI	-0.8546	-0.0362
COCACOLA	-0.6114	-0.0259
EBAY	-0.3641	-0.0154
EXXONM	-1.0332	-0.0438
FACEBOOK	-1.9368	-0.0821
GE	-0.1504	-0.0064
GMOTORS	-0.4348	-0.0184
GOOGLE	-14.4395	-0.6120
IBM	-1.6621	-0.0705
INTEL	-0.6080	-0.0258
J&J	-1.8254	-0.0774
JPMORGAN	-1.3776	-0.0584
MCDONALD	-2.3096	-0.0979
MICROSFT	-1.4250	-0.0604
PFIZER	-0.5673	-0.0241
P&G	-1.1704	-0.0496
STBUCKS	-0.7735	-0.0328
WALMART	-1.3182	-0.0559
GOLDMAN	-2.8288	-0.1199
UPS	-1.4022	-0.0594
ALCOA	-0.4564	-0.0193
AMERICANEXP	-1.3485	-0.0572
BOA	-0.3515	-0.0149

CATERPILLAR	-1.5327	-0.0650
SNAP	-0.0835	-0.0035
DISNEY	-1.5080	-0.0639
FORD	-0.1195	-0.0051
FEDEX	-2.8054	-0.1189
HARLEY-DAVI	-0.4795	-0.0203
HP	-0.1949	-0.0083
NIKE	-0.9600	-0.0407
PEPSI	-1.4718	-0.0624
PM	-1.1845	-0.0502
TWITTER	-0.4314	-0.0183
VISA	-1.8351	-0.0778
PAYPAL	-1.1107	-0.0471
TESLA	-4.4046	-0.1867
NETFLIX	-3.9950	-0.1693
BASF	-3.9029	-5.4162
DTELEKOM	-0.8291	-1.1505
ALLIANZ	-10.5834	-14.6853
BAYER	-3.9814	-5.5244
BEIERSDO	-5.3796	-7.4653
DAIMLERC	-3.1215	-4.3323
DBANK	-0.5028	-0.6977
SIEMENS	-5.9439	-8.2482
LUFTHANS	-1.1095	-1.5403
CECONOMY	-0.2547	-0.3537
ADIDAS	-11.9798	-16.6336

BMW	-4.5563	-6.3242
COMMERZBANK	-0.4779	-0.6633
CONTINENTAL	-8.3608	-11.6056
HENKEL	-5.5436	-7.6929
RWE	-1.0106	-1.4027
THYSSEN	-1.0708	-1.4870
VOLKSWAGEN	-8.1979	-11.3957
BARCLAYS	-1.5180	-0.8360
GSK	-13.5157	-7.4415
M&S	-2.5807	-1.4217
RBS	-2.0471	-1.1279
ROLLS-ROYCE	-7.6192	-4.1954
RIOTINTO	-33.2193	-18.2924
SHELL	-21.5705	-11.8772
STAN	-4.7841	-2.6352
TESCO	-1.8553	-1.0219
UNILEVER	-36.4838	-20.0895
VODAFONE	-1.2897	-0.7102
SANTANDER	-0.2396	-0.3324
TELEFONICA	-0.4068	-0.5644
BBVA	-0.2969	-0.4120
IBERDOLA	-0.3688	-0.5117
REPSOL	-0.8957	-1.2433
CAIXABANK	-0.2030	-0.2817
ABERTIS	-1.0695	-1.4800
GASNATURAL	-1.2818	-1.7796

REDELECTRIC	-1.0807	-1.4995
GRIFOLS	-1.4569	-2.0241
BANKINTER	-0.4111	-0.5708
MAPFRE	-0.1495	-0.2077
ACS	-1.9142	-2.6560
AMADEUS	-4.1682	-5.7834
INDITEX	-1.4592	-2.0257
ACERINOX	-0.5874	-0.8159
AENA	-8.2154	-11.3998
BANKIA	-0.1556	-0.2161
IAG	-0.3966	-0.5504
SACYR	-0.1226	-0.1705
TECNICAS	-1.3138	-1.8248
BOGDANKA	-0.6068	-0.1263
BUDIMEX	-1.3452	-0.2809
CCC	-1.9917	-0.4140
MBANK	-4.4712	-0.9312
ASSECOPL	-0.5320	-0.1106
BZWBK	-3.8338	-0.7983
SANTANDERPL	-3.8338	-0.7983
EUROCASH	-0.2447	-0.0510
KGHM	-0.9575	-0.1992
LOTOS	-0.7763	-0.1615
MILLENNI	-0.0974	-0.0203
NETIA	-0.0527	-0.0111
ORANGEPL	-0.0504	-0.0105

PEKAO	-1.1603	-0.2414
PGE	-0.1164	-0.0242
PGNIG	-0.0698	-0.0145
PKNORLEN	-0.9984	-0.2075
PKOBP	-0.4477	-0.0930
CDPROJEKT	-1.6764	-0.3487
PZU	-0.4345	-0.0904
CYFRPLST	-0.2520	-0.0524
ALIOR	-0.6488	-0.1350
HANDLOWY	-0.7951	-0.1661
CIECH	-0.4639	-0.0965
ENERGA	-0.0907	-0.0189
INGBSK	-1.8534	-0.3878
JSW	-0.7797	-0.1622
PKPCARGO	-0.4492	-0.0942
TAURON	-0.0204	-0.0043
LPP	-87.5071	-18.2838
GETINNOBLE	-0.0061	-0.0013
ASHR.ETF	-0.3102	-0.0132
DBA.ETF	-0.2358	-0.0100
DBC.ETF	-0.2326	-0.0099
EEM.ETF	-0.5152	-0.0218
EFA.ETF	-0.8185	-0.0347
EWA.ETF	-0.2659	-0.0113
EWV.ETF	-0.6118	-0.0259
EWY.ETF	-0.7687	-0.0326

EWZ.ETF	-0.5334	-0.0226
FXI.ETF	-0.5194	-0.0220
GLD.ETF	-1.5555	-0.0659
HYG.ETF	-1.1223	-0.0476
IVV.ETF	-3.5590	-0.1509
IYR.ETF	-1.0248	-0.0434
OIH.ETF	-0.2818	-0.0120
SLV.ETF	-0.1840	-0.0078
SPY.ETF	-3.5341	-0.1498
SSO.ETF	-1.4041	-0.0596
SVXY.ETF	-0.6273	-0.0266
TBT.ETF	-0.5287	-0.0224
VNQ.ETF	-1.0286	-0.0436
VXX.ETF	-0.5335	-0.0226
XHB.ETF	-0.4350	-0.0184
XLB.ETF	-0.6777	-0.0287
XLE.ETF	-0.8857	-0.0375
XLF.ETF	-0.3366	-0.0143
XLI.ETF	-0.9208	-0.0390
XLP.ETF	-0.7180	-0.0304
XLU.ETF	-0.7118	-0.0302
XLV.ETF	-1.1652	-0.0494
XLY.ETF	-1.3778	-0.0584
BITCOIN	-129.0253	-49.5225
BTCUSD	-448.4828	-369.0225
ETHUSD	-141.7366	-116.6752

LTCUSD	-36.0203	-29.6691
BCHUSD	-30.3970	-25.0473
XRPUSD	-31.9455	-26.3282

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%

$$long\ swap = - \left(1,2114 \times \frac{(1 + (1,82\% + 0,65\%) \times \frac{1}{360})}{(1 + ((-0,5\%) - 0,65\%) \times \frac{1}{360})} - 1,2114 \right) \times 100000 = -12,1817$$

$$short\ swap = \left(1,2115 \times \frac{\left(1 + (1,74\% - 0,65\%) \times \frac{1}{360} \right)}{\left(1 + ((-0,37\%) + 0,65\%) \times \frac{1}{360} \right)} - 1,2115 \right) \times 100000 = 2,7259$$

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