



Avgifts och kostnadsinformation FRA, 3 månader

Transaktionen avser att kunden köper en tremånaders Forward Rate Agreement med nominellt belopp om 10 MSEK med start om sex månader.

Exempel transaktion

| | |
|--------------------------------------|------------|
| Nominellt belopp | 10 000 000 |
| Duration / Löptid (månader) | 3 |
| Kreditkostnader i basis points (bps) | 1 |

Kreditkostnaden i kronor beräknas med hänsyn tagit till transaktionens duration.

| Avgifter & kostnader | Bps | Avgifter i kronor | Avgifter i procent av nominellt belopp |
|---------------------------------|-----|-------------------|--|
| Transaktionskostnad år 1 | | 250 | 0,0025% |
| Kreditkostnad (bps) | 1 | | |

I kreditkostnad ingår distributions- och kapitalkostnader enligt kapitaltäckningsregelverken. XVA är ett samlingsnamn på några typer av kostnader exempelvis CVA, KVA, FVA m.m. XVA varierar beroende på produkt, löptid & kreditvärdighet och är därför olika transaktion för transaktion.

I detta exempel tas ej hänsyn till marknadsvärdesförändringar på transaktionen såsom förändringar av valutakurser eller räntor. Marknadsvärdet på transaktionen varierar över tid. Det finns olika variationer på produkten så priset kan variera beroende på vilken typ som efterfrågas.