



Avgifts och kostnadsinformation för XCCY IRS USD/SEK OTC 5år

Köpet avser en transaktion om nominellt 10 MUSD där kunden erhåller ränta för det nominella beloppet i USD och betalar ränta för det nominella beloppet i SEK under 2 år.

Exempel transaktion

Nominellt belopp (USD)	10 000 000
Nominellt belopp (SEK)	81 000 000
Duration / Löptid (år)	5
Valutakurs USD/SEK (spot kurs vid transaktionstillfället)	8,1000
Kreditkostnader i basis points (bps)	80

Avgifter & kostnader

	Bps	Avgift i kronor	Avgift i procent av nominellt belopp
Transaktionskostnad 1 år		648 000	0,80%
Kreditkostnad (bps)	80		
Kreditkostnad transaktionens Löptid (år)		3 240 000	

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.