



Avgifts och kostnadsinformation för FX NDF USD/SEK 3 månader

Köpet avser en valutaväxling med en nominell utbyte vid tidpunkten för handel och återbetalning av samma belopp om 3 månader. Avräkning kan inte utföras i den icke-omsatta valutan, betalningen kommer att vara skillnaden mellan den förutbestämda växelkursen och den observerade valutakursen vid tidpunkten för nominell utbyte.

Exempel transaktion

Nominellt belopp (USD)	1 000 000
Nominellt belopp (SEK)	6 600 000
Duration / Löptid (månader)	3
Valutakurs USD/CNY (spot kurs vid transaktionstillfället)	6,6000
Valutakurs CNY/SEK (spot kurs vid transaktionstillfället)	1,2800
Kreditkostnader i pips	50

Avgifter & kostnader

	Bps	Avgift i kronor	Avgift i procent av nominellt belopp
Transaktionskostnad 1 år		6 400	0,12%
Kreditkostnad (pips)	50		

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.