



Avgifts och kostnadsinformation för valutaoption ATM 3 månader

Köpet avser en transaktion om nominellt 1 MUSD där kunden köper en option på att köpa USD om 3 månader och betalar i SEK. För optionen betalar kunden en premie.

Exempel transaktion

Nominellt belopp (USD)	1 000 000
Nominellt belopp (SEK)	8 100 000
Valutakurs USD/SEK (spot kurs vid transaktionstillfället)	8,1000
Duration / Löptid (månader)	3
Kreditkostnader i pips	100
Premie i SEK (inkl kreditkostnader)	150 000

Avgifter & kostnader	Bps	Avgift i kronor	Avgift i procent av nominellt belopp
Transaktionskostnad 1 år		81 000	1,000%
Kreditkostnad (pips)	100		

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.