



Avgifts och kostnadsinformation för Swaption ATM, 2 år

Köpet avser en transaktion som ger köparen möjligheten att ingå ett Swap avtal vid optionens förfall. Optionens löptid är på två år. Den underliggande Swappen är på nominellt 10 MSEK med start om två år och löptid på tre år. Kunden betalar en premie för optionen.

Exempel transaktion

Nominellt belopp (SEK)	10 000 000
Optionens Duration / Löptid (År)	2
Swapens Duration / Löptid (År)	3
Kreditkostnader i basis points (bps)	14
Premie i SEK (inkl kreditkostnader)	89 000

Avgifter & kostnader

	Bps	Avgift i kronor	Avgift i procent av nominellt belopp
Transaktionskostnad 1 år		14 000	0,14%
Kreditkostnad (bps)	14		

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.