



Avgifts och kostnadsinformation för IRS SEK 2 år

Köpet avser en transaktion om nominellt 10 MSEK där kunden betalar fast ränta och erhåller rörlig ränta (3-mån Stibor) över en tidsperiod på 2 år.

Exempel transaktion

Nominellt belopp	10 000 000
Duration / Löptid (år)	2
Kreditkostnader i basis points (bps)	20

Avgifter & kostnader

	Bps	Avgifter i kronor	Avgifter i procent av nominellt belopp
Transaktionskostnad år 1		20 000	0,20%
Kreditkostnad (bps)	20		
Kreditkostnad transaktionens Löptid (år)		40 000	

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.