

Werkblad - Swappunten

Doel

Met het werkblad Swappunten kan het aantal swappunten worden berekend voor een FX swap. De swappunten drukken het renteverskil uit tussen twee valuta's.

Werking

In dit werkblad moet je de volgende zaken invoeren:

- FX spotkoers
- Rentepercentage van de base currency (meestal euro)
- Rentepercentage van de quoted currency (de vreemde valuta t.o.v. de euro)
- De looptijd van de FX swap in dagen
- De jaarbasis die samenhangt met de daycount convention van beide valuta's

Hieronder zijn wij uitgegaan van de FX swap in paragraaf 18.2. De FX spotkoers is 1,4285 en de looptijd is 61 dagen (van 1 juni tot 1 augustus). De jaarbasis van euro en US dollars is 360 omdat in beide landen op de geldmarkt de daycount convention 'actual/360' wordt gebruikt. De rentepercentages hebben wij zelf verzonnen.

Het renteverskil van 0,62% over 61 dagen wordt 'vertaald' naar 15 swappunten (0,0015).

FX spot rate	1,4285
Rentepercentage base currency	2,50%
Rentepercentage quoted currency	3,12%
Aantal dagen	61
Jaarbasis base currency	360
Jaarbasis quoted currency	360
Swappunten	0,0015