





## PP сценарии за изпълнение на операциите въз основа на неизпълнение:

### Валутен суап на EURUSD.

Селище:		spot/6 месеца
гориз (€):	(H)	1.1800
търговия размер:	(Kг)	1,000,000€
марж %:	(M)	20%
рамото:	(Д)	1:5
изискването (\$):	$LI = p \times c \times M$	200,000€

---

	Лонг EURUSD представа случай	цената варира	Клое цена в 6 месеца	Н&Л (в \$)
	благоприятна	2%	1.2036	19,607
	умерена	0.5%	1.1859	4,974
	неблагоприятни	-2%	1.1564	-20,408
	стреса	-10%	1.0620	-111,111

Да се отбележи, че горният пример описва валутен суап вместо кръст-валутен суап. Въпреки това, няма принципалы не се обменят с ръце, и без лихвените плащания, които не са платени или не са получени в рамките на срока на действие на суап.

За къси позиции за валутен суап EURUSD резултатите са точно противоположни на тези, които са показани по-горе.