





## PP scenarija izvršenja transakcije na osnovu zamjene:

### Devizni swap na EURUSD.

Naselje:		spot/6 mjeseci
griže (€):	(N)	1.1800
trgovanje veličina:	(Ts)	1,000,000€
marža %:	(M)	20%
ramena:	(D)	1:5
маржинальное заhtjev (\$):	$Mr = p \times t \times M$	200,000€

---

	Long EURUSD ideju slučaju	cijena se promijeniti	Clawe cijena u 6 mjeseci	N&L (u \$)
	poticajnog	2%	1.2036	19,607
	umjereno	0.5%	1.1859	4,974
	nepovoljnim	-2%	1.1564	-20,408
	stresom	-10%	1.0620	-111,111

Za napomenuti je, da je gore navedeni primjer opisuje devizni swap umjesto cross-valutni swap. Međutim, nema принципалы ne razmjenjuju svoje ruke, i nema kamate se ne plaća, ili ne dovede u vrijeme trajanja zamjene.

Za kratke pozicije valutne swap EURUSD rezultate točno nasuprot onima koje su prikazane iznad.