









## PNKCI SCÉNÁŘE dohody založené na derivátové nástroje k převodu úvěrového rizika : Credit Default Swap na 5-Leté německé státní dluhopisy "Bund" (CD).

CD otevírací cena (€) ze dne 06-01-2021:	(P)	o 11 bazických bodů (bps) nebo 0.11% za 1 Euro
velikost Obchodu (za nominální):	(N)	1,000,000 Eur nominální hodnota
Marže %:	(M)	100%
Marže Požadavek/zaplacené Pojistné (eur):	$MR = P \times N \times M$	€1,100

KOUPIT/DLOUHÝ Výkon Scénář	Otevřete Cena (v bps)	Uzavírací Cena (vč. spread)	změna Ceny (v bps)	Zisk/Ztráta
 Příznivé	11	500	489	€48,900
 Mírné	11	100	89	€8,900
 Nepříznivé	11	6	-5	-Eur500
 Stresu	11	1	-10	-€1,000

Prodej/Krátké Představení Scénář	Otevřete Cena (v bps)	Uzavírací Cena (vč. spread)	změna Ceny (v bps)	Zisk/Ztráta
 Příznivé	11	1	-10	€1,000
 Mírné	11	6	-5	€500
 Nepříznivé	11	100	89	-€8,900
 Stresu	11	500	489	-€48,900

Nákup (nebo, případně může být, prodej) tento produkt označuje názor, že si myslíte, že základní cena zvýší (nebo, případně může být, pokles).