





PNKCI SCÉNÁŘE dohody založené na Swapy:

FX Swap na EURUSD.

Vypořádání:		Místo/6 měsíců
Prýž (€):	(P)	1.1800
velikost Obchodu:	(TS)	1,000,000eur
Marže %:	(M)	20%
Vliv:	(L)	1:5
Rozpětí Požadavku (\$):	$MR = P \times TS \times M$	200,000€

	DLOUHO EURUSD Výkon Scénář	Cenu změnit	Close Cena za 6 měsíců	P&L (v \$)
	Kladné	2%	1.2036	19,607
	Středně	0.5%	1.1859	4,974
	Nepříznivý	-2%	1.1564	-20,408
	Stresu	-10%	1.0620	-111,111

Na vědomí, že výše uvedený příklad nastiňuje FX swap místo cross currency swap. Řekl, že žádné principy výměny ruče a žádné úrokové platby jsou placené nebo přijaté v průběhu trvání swapu.

Pro KRÁTKÉ EURUSD FX SWAP pozice, výsledky jsou přesně opačné, těch popsán výše.