





PERFORMANCE SCENARIER af en aftale baseret på Swaps:

FX Swap på EURUSD.

Løsning:		Spot/6 måneder
Pris (€):	(P)	1.1800
Handel størrelse:	(TS)	1,000,000€
Margin %:	(M)	20%
Gearing:	(L)	1:5
Margin Krav (\$):	$MR = P \times TS \times M$	200,000€

	LANG EURUSD Performance Scenarie	Pris ændre	Close Pris i 6 måneder	S&L (i \$)
	Gunstige	2%	1.2036	19,607
	Moderate	0.5%	1.1859	4,974
	Ugunstig	-2%	1.1564	-20,408
	Stress	-10%	1.0620	-111,111

Bemærk, at ovenstående eksempel beskriver en FX swap i stedet for en cross-currency swap. Som sagt, er der ingen skoleledere udveksling hænder, og ingen renter er betalt eller modtaget i løbet af swap.

For en KORT EURUSD FX SWAP position, de resultater er præcis den modsatte af dem, der er afbildet ovenfor.