





PERFORMANCE SCENARIO 'S van een deal gebaseerd op Swaps:

FX Swap op EURUSD.

Afwikkeling:		Spot/6 maanden
Prijs (€):	(P)	1.1800
Handel grootte:	(TS)	1,000,000€
Marge %:	(M)	20%
Leverage:	(L)	1:5
Marge Eis (\$):	de HEER = P x TS x M	200,000€

	LONG EURUSD Prestaties Scenario	Prijs wijzigen	Close Prijs in 6 maanden	P&L (in \$)
	Gunstige	2%	1.2036	19,607
	Matig	0.5%	1.1859	4,974
	Ongunstig	-2%	1.1564	-20,408
	Stress	-10%	1.0620	-111,111

Om op te merken dat het bovenstaande voorbeeld beschrijft een FX-swap in plaats van een cross currency swap. Dat gezegd, niet opdrachtgevers exchange handen en geen rente betalingen worden betaald of ontvangen wordt gedurende de looptijd van de swap.

Voor een KORTE EURUSD FX-SWAP-positie, de resultaten zijn precies het tegenovergestelde van die afgebeeld boven.