









## PERFORMANCE STSENAARIUMID palju põhinevad kohta tuletisinstrumendi puhul krediidiriski ülekandmist : Krediidiriski Vahetustehingute kohta, 5-Aasta saksa valitsuse võlakirjade "Bund" (CD-d).

CD - alghinnaga (€) kuupäev 06-01-2021:	(P)	11 baaspunkti (bps) või 0.11% aastas, 1 Euro
suurus (eurot tinglik):	(N)	1,000,000 Eurot, nimiväärtus
Marginaal %:	(M)	100%
normatiiv/Premium tasutud (€):	MR = P x N x M	€1,100

OSTA/LONG Performance Stsenaarium	Avatud, Hind (in bps)	aktsia sulgemishind (kasvata. spread)	Hinna muutuse kohta (bps)	Kasum/Kahjum
 Soodne	11	500	489	€48,900
 Mõõdukas	11	100	89	€8,900
 Ebasoodne	11	6	-5	-€500
 Stressi	11	1	-10	-Eurot,1,000

Müüa/Lühike Tulemuslikkuse Stsenaarium	Avatud, Hind (bps)	aktsia sulgemishind (kasvata. spread)	Hinna muutuse kohta (bps)	Kasum/Kahjum
 Soodne	11	1	-10	€1,000
 Mõõdukas	11	6	-5	€500
 Ebasoodne	11	100	89	-€8,900
 Stressi	11	500	489	-€48,900

Ostes (või, vastavalt olukorrale, müük) see toode näitab, et sa arvad, et alusvara hind suureneb (või, olenevalt asjaoludest, vähendada).