





PERFORMANCE STSENAARIUMID palju põhinevad kohta Vahetuslepingud:

FX Vahetustehingute kohta EURUSD.

Arveldamine:		Spot/6 kuud
Priis (€):	(P)	1.1800
suurus:	(TS)	1,000,000€
Marginaal %:	(M)	20%
Finantsvõimendus:	(L)	1:5
normatiiv (\$):	$MR = P \times T \times M$	200,000€

	PIKK EURUSD Tulemuslikkuse Stsenaariumi	Hind muutus	Close - Hind 6 kuud	P&L (in \$)
	Soodne	2%	1.2036	19,607
	Möödukas	0.5%	1.1859	4,974
	Ebasoodne	-2%	1.1564	-20,408
	Stressi	-10%	1.0620	-111,111

Märkida, et ülaltoodud näites kirjeldatakse FX vahetustehingu asemel risti valuuta-swap. See ütles, ei ole käsundiandjat vahetada käed ja nr intresse on makstud või saadud tähtaja jooksul vahetada.

LÜHIKESE EURUSD FX VAHETUSTEHINGU seisukoht, tulemused on täpselt vastupidine need kujutatud eespool.