





PERFORMANCE SKENAARIOITA juttu perustuu edelleen Swap:

FX Swap - EURUSD.

Ratkaisu:		Piste/6 kk
Price (€):	(P)	1.1800
Kaupan koko:	(TS)	1,000,000€
Marginaali,%:	(M)	20%
Hyödyntää:	(L)	1:5
Marginaali Vaatimus (\$):	ARVOISA = P x TS x M	200,000€

	PITKÄ EURUSD Suorituskyky Skenaario	Hinta muutos	Close Hinta 6 kuukauden	P&L (in \$)
	Suotuisat	2%	1.2036	19,607
	Kohtalainen	0.5%	1.1859	4,974
	Kielteinen	-2%	1.1564	-20,408
	Stressi	-10%	1.0620	-111,111

Huomaa, että esimerkissä hahmotellaan FX swap sijaan cross currency swap. Se sanoi, ei rehtorien vaihto käsissä ja ei ole kiinnostusta maksut on maksettu tai vastaanotettu voimassaoloaikana vaihtaa.

LYHYEN EURUSD FX SWAP-asema, tulokset ovat täsmälleen päinvastainen niistä on kuvattu edellä.