





PERFORMANCE FORGATÓKÖNYVEK ügy alapján a Swap:

FX - Swap az EURUSD.

Település:		Hely/6 hónapon
Prizs (€):	(P)	1.1800
Kereskedelmi méret:	(TS)	1,000,000€
Árrés %:	(M)	20%
Tőkeáttétel:	(L)	1:5
Margin Követelmény (\$):	$MR = P \times TS \times M$	200,000€

	HOSSZÚ EURUSD Teljesítmény Forgatókönyv	Ár változás	Close Ár 6 hónap	P&L (a \$)
	Kedvező	2%	1.2036	19,607
	Mérsékelt	, 0,5% - Os	1.1859	4,974
	Kedvezőtlen	-2%	1.1564	-20,408
	Stressz	-10%	1.0620	-111,111

Megjegyezni, hogy a fenti példa felvázolja egy FX-swap, ahelyett, hogy egy cross currency swap. Azt mondta, nem megbízók cserélnek gazdát, s nem érdekel a kifizetések fizetett vagy kapott a futamidő alatt a csere.

Egy RÖVID EURUSD FX-SWAP helyzetben, az eredmények pontosan az ellenkezője az is látható fent.