









PERFORMANCE SCENĀRIJI par vienošanos, pamatojoties uz atvasināto instrumentu kredītriska nodošanas : Kredītsaistību Nepildīšanas Mijmaiņas līgumu uz 5-Gadu vācijās valdības obligāciju "Bund" (CDS).

CD atvēršanas cenu (€) datēts 06-01-2021:	(P)	11 bāzes punktiem (b.p) jeb 0,11% gadā 1 Euro
Tirdzniecības izmērs (uz vienu nosacīto):	(N)	1,000,000 Euro nominālvērtību,
Starpību %:	(M)	100%
Maržu/samaksātā Prēmija (eur):	$MR = P \times N \times M$	€1,100

PIRKT/ILGTERMIŅA Darbības Scenārijs	Atvērt Cenu (jo bps)	Beigu Cena (t.sk. spread)	Cenu pārmaiņas (jo bps)	Peļņa/Zaudējumi
 Labvēlīgu	11	500	489	€48,900
 Mērens	11	100	89	€8,900
 Nelabvēlīgs	11	6	-5	-€500
 Stresa	11	1	-10	-€1,000

Pārdod/Īss Izpildes Scenārijs	Atvērt Cenu (bps)	Beigu Cena (t.sk. spread)	Cenu pārmaiņas (jo bps)	Peļņa/Zaudējumi
 Labvēlīgu	11	1	-10	€1,000
 Mērens	11	6	-5	€500
 Nelabvēlīgs	11	100	89	-€8,900
 Stresa	11	500	489	-€48,900

Pērk (vai, kā šajā gadījumā, pārdodot) šis produkts norāda, uzskata, ka jūs domājat, ka bāzes cena pieaugs (vai, kā šajā gadījumā, samazinājums).