





PERFORMANCE SCENARIER av en avtale basert på Bytteavtaler:

FX Bytte på EURUSD.

Oppgjør:		Sted/6 måneder
Pris (€):	(S)	1.1800
Handel størrelse:	(TS)	1,000,000€
Margin:	(M)	20%
Belåning:	(L)	1:5
marginkrav (\$):	$MR = P \times TS \times M$	200,000€

	LANG EURUSD Ytelse Scenario	Pris endre	Close Pris i 6 måneder	P&L (i \$)
	Gunstig	2%	1.2036	19,607
	Moderat	0.5%	1.1859	4,974
	Ugunstige	-2%	1.1564	-20,408
	Stress	-10%	1.0620	-111,111

Å være oppmerksom på at eksempelet ovenfor skisserer en FX bytte i stedet for et kors valuta swap. Når det er sagt, ingen rektor exchange hender og ingen renter er betalt eller mottatt i løpet av perioden swap.

For en KORT EURUSD FX BYTTE posisjon, utfallet er nøyaktig det motsatte av de som er avbildet ovenfor.