





PERFORMANCE SCENÁRE obchodu založené na Swapy:

FX Swap na EURUSD.

Vysporiadanie:		Spot/6 mesiacov
Sryžou (€):	(P)	1.1800
Obchodu veľkosť:	(TS)	1,000,000€
Prirážka %:	(M)	20%
Pákový efekt:	(L)	1:5
Maržu (\$):	$P \times TS \times M \times L$	200,000€

	DLHO EURUSD Výkon Scenár	Cenu zmeniť	Close Cena za 6 mesiacov	P&L (v \$)
	Priaznivý	2%	1.2036	19,607
	Stredne	0.5%	1.1859	4,974
	Nepriaznivých	-2%	1.1564	-20,408
	Stres	-10%	1.0620	-111,111

Na vedomie, že vyššie uvedený príklad popisuje FX swap namiesto cross currency swap. To znamená, že, žiadne princípy výmeny ruky a č úrokové platby sú zaplatené alebo prijaté počas doby trvania swapu.

Na KRÁTKY EURUSD FX SWAP pozície, výsledky sú presne opak toho, tie popísaný vyššie.