





PERFORMANCE SCENARIJEV za posel, ki temelji na Zamenjav:

FX Swap na EURUSD.

Naselje:		Spot/6 mesecev
Priž (€):	(P)	1.1800
Trgovina velikost:	(TS)	1,000,000€
Robu %:	(M)	20%
finančni Vzvod:	(L)	1:5
obvezna Marža (\$):	$G = P \times T \times M,$	200,000€

	DOLGO EURUSD Uspešnosti Scenarij	Cena spremeni	Close Cene v 6 mesecih	P&L (v \$)
	Ugodno	2%	1.2036	19,607
	Zmerno	0.5%	1.1859	4,974
	Neugodna	-2%	1.1564	-20,408
	Stresa	-10%	1.0620	-111,111

Upoštevajte, da zgornji primer opisuje, je FX swap namesto cross currency swap. To je dejal, ne ravnatelj izmenjavo roke in brez obresti, plačane ali prejete v času trajanja swap.

Za KRATEK EURUSD FX SWAP položaj, so rezultati ravno nasprotni od tistih, prikazano zgoraj.