





## PUTFÖRANDE SCENARIER i en affär som bygger på Swappar:

### FX Swap på EURUSD.

<b>Lösning:</b>		Spot/6 månader
<b>Pris (€):</b>	(P)	1.1800
<b>Handel storlek:</b>	(TS)	1,000,000€
<b>Marginal %:</b>	(M)	20%
<b>Hävstång:</b>	(L)	1:5
<b>- Marginal (\$):</b>	$MR = P \times TS \times M \times$	200,000€

---

	<b>LÅNG EURUSD Prestanda Scenario</b>	<b>Pris ändra</b>	<b>Close Priset i 6 månader</b>	<b>P&amp;L (i \$)</b>
	Gynnsamma	2%	1.2036	19,607
	Måttliga	0,5 Procent	1.1859	4,974
	Ogynnsamma	-2%	1.1564	-20,408
	Stress	-10%	1.0620	-111,111

Observera att exemplet ovan beskriver en FX-swap istället för en swap. Som sagt, ingen uppdragsgivare utbyte händer och inga räntor betalas eller erhållas under tiden för swap (växlingsutrymme).

För en KORT EURUSD FX-SWAP position, resultaten är raka motsatsen till de som avbildas ovan.