

מערך תרחישים במסלקת מעו"ף

דוגמא נגזרי ת"א-35 - σ	דוגמא נגזרי ת"א-35 - S	הערה	σ	S	תרחיש
20	1400.0		$\sigma_0 + \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	S_0	1
30	1400.0		$\sigma_0 - \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	S_0	2
20	1416.8		$\sigma_0 + \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1+0.1m)$	3
30	1416.8		$\sigma_0 - \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1+0.1m)$	4
20	1383.2		$\sigma_0 + \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1-0.1m)$	5
30	1383.2		$\sigma_0 - \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1-0.1m)$	6
20	1433.6		$\sigma_0 + \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1+0.2m)$	7
30	1433.6		$\sigma_0 - \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1+0.2m)$	8
20	1366.4		$\sigma_0 + \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1-0.2m)$	9
30	1366.4		$\sigma_0 - \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1-0.2m)$	10
20	1450.4		$\sigma_0 + \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1+0.3m)$	11
30	1450.4		$\sigma_0 - \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1+0.3m)$	12
20	1349.6		$\sigma_0 + \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1-0.3m)$	13
30	1349.6		$\sigma_0 - \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1-0.3m)$	14
20	1467.2		$\sigma_0 + \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1+0.4m)$	15
30	1467.2		$\sigma_0 - \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1+0.4m)$	16
20	1332.8		$\sigma_0 + \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1-0.4m)$	17
30	1332.8		$\sigma_0 - \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1-0.4m)$	18
20	1484.0		$\sigma_0 + \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1+0.5m)$	19
30	1484.0		$\sigma_0 - \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1+0.5m)$	20
20	1316.0		$\sigma_0 + \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1-0.5m)$	21
30	1316.0		$\sigma_0 - \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1-0.5m)$	22
20	1500.8		$\sigma_0 + \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1+0.6m)$	23
30	1500.8		$\sigma_0 - \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1+0.6m)$	24
20	1299.2		$\sigma_0 + \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1-0.6m)$	25
30	1299.2		$\sigma_0 - \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1-0.6m)$	26
20	1517.6		$\sigma_0 + \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1+0.7m)$	27
30	1517.6		$\sigma_0 - \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1+0.7m)$	28
20	1282.4		$\sigma_0 + \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1-0.7m)$	29
30	1282.4		$\sigma_0 - \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1-0.7m)$	30
20	1534.4		$\sigma_0 + \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1+0.8m)$	31
30	1534.4		$\sigma_0 - \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1+0.8m)$	32
20	1265.6		$\sigma_0 + \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1-0.8m)$	33
30	1265.6		$\sigma_0 - \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1-0.8m)$	34
20	1551.2		$\sigma_0 + \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1+0.9m)$	35
30	1551.2		$\sigma_0 - \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1+0.9m)$	36
20	1248.8		$\sigma_0 + \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1-0.9m)$	37
30	1248.8		$\sigma_0 - \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1-0.9m)$	38
20	1568.0		$\sigma_0 + \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1+m)$	39
30	1568.0		$\sigma_0 - \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1+m)$	40
20	1232.0		$\sigma_0 + \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1-m)$	41
30	1232.0		$\sigma_0 - \text{Max}(a, 0.2\sigma_0)$	$S_0(1-m)$	42
50	1736.0	תרחישים קיצוניים, בהם התוצאה מוכפלת ב-0.35.	$2\sigma_0$	$S_0(1+2m)$	43
50	1064.0	תרחישים קיצוניים, בהם התוצאה מוכפלת ב-0.35.	$2\sigma_0$	$S_0(1-2m)$	44
				תרחיש "שווי שוק"	45

מקרא:
 S_0 - שער הספוט האחרון שפורסם

 m - טווח תנודה מקסימלי של נכס בסיס, כמפורט בטבלה להלן

 a - תנודה מינימלית בסטיית תקן, כמפורט בטבלה להלן