הבורסה לניירות ערך

מערך תרחישים במסלקת מעו"ף

תרחיש	S	σ	הערה	דוגמא נגזרי ת"א-35 - S	דוגמא נגזרי ת"א-35 - σ
1	S_0	σ_0+Max(a,0.2σ_0)		1400	20
2	S_0	σ_0-Max(a,0.2σ_0)		1400	30
3	S_0(1+0.1m)	σ_0+Max(a,0.2σ_0)		1416.8	20
4	S_0(1+0.1m)	σ_0-Max(a,0.2σ_0)		1416.8	30
5	S_0(1-0.1m)	σ_0+Max(a,0.2σ_0)		1383.2	20
6	S_0(1-0.1m)	σ_0-Max(a,0.2σ_0)		1383.2	30
7	S_0(1+0.2m)	σ_0+Max(a,0.2σ_0)		1433.6	20
8	S_0(1+0.2m)	σ_0-Max(a,0.2σ_0)		1433.6	30
9	S_0(1-0.2m)	σ_0+Max(a,0.2σ_0)		1366.4	20
10	S_0(1-0.2m)	σ_0-Max(a,0.2σ_0)		1366.4	30
11	S_0(1+0.3m)	σ_0+Max(a,0.2σ_0)		1450.4	20
12	S_0(1+0.3m)	σ_0-Max(a,0.2σ_0)		1450.4	30
13	S_0(1-0.3m)	σ_0+Max(a,0.2σ_0)		1349.6	20
14	S_0(1-0.3m)	σ_0-Max(a,0.2σ_0)		1349.6	30
15	S_0(1+0.4m)	σ_0+Max(a,0.2σ_0)		1467.2	20
16	S_0(1+0.4m)	σ_0-Max(a,0.2σ_0)		1467.2	30
17	S_0(1-0.4m)	σ_0+Max(a,0.2σ_0)		1332.8	20
18	S_0(1-0.4m)	σ_0-Max(a,0.2σ_0)		1332.8	30
19	S_0(1+0.5m)	σ_0+Max(a,0.2σ_0)		1484	20
20	S_0(1+0.5m)	σ_0-Max(a,0.2σ_0)		1484	30
21	S_0(1-0.5m)	σ_0+Max(a,0.2σ_0)		1316	20
22	S_0(1-0.5m)	σ_0-Max(a,0.2σ_0)		1316	30
23	S_0(1+0.6m)	σ_0+Max(a,0.2σ_0)		1500.8	20
24	S_0(1+0.6m)	σ_0-Max(a,0.2σ_0)		1500.8	30
25	S_0(1-0.6m)	σ_0+Max(a,0.2σ_0)		1299.2	20
26	S_0(1-0.6m)	σ_0-Max(a,0.2σ_0)		1299.2	30
27	S_0(1+0.7m)	σ_0+Max(a,0.2σ_0)		1517.6	20
28	S_0(1+0.7m)	σ_0-Max(a,0.2σ_0)		1517.6	30
29	S_0(1-0.7m)	σ_0+Max(a,0.2σ_0)		1282.4	20
30	S_0(1-0.7m)	σ_0-Max(a,0.2σ_0)		1282.4	30
31	S_0(1+0.8m)	σ_0+Max(a,0.2σ_0)		1534.4	20
32	S_0(1+0.8m)	σ_0-Max(a,0.2σ_0)		1534.4	30
33	S_0(1-0.8m)	σ_0+Max(a,0.2σ_0)		1265.6	20
34	S_0(1-0.8m)	σ_0-Max(a,0.2σ_0)		1265.6	30
35	S_0(1+0.9m)	σ_0+Max(a,0.2σ_0)		1551.2	20
36	S_0(1+0.9m)	σ_0-Max(a,0.2σ_0)		1551.2	30
37	S_0(1-0.9m)	σ_0+Max(a,0.2σ_0)		1248.8	20
38	S_0(1-0.9m)	σ_0-Max(a,0.2σ_0)		1248.8	30
39	S_0(1+m)	σ_0+Max(a,0.2σ_0)		1568	20
40	S_0(1+m)	σ_0-Max(a,0.2σ_0)		1568	30
41	S_0(1-m)	σ_0+Max(a,0.2σ_0)		1232	20
42	S_0(1-m)	σ_0-Max(a,0.2σ_0)		1232	30
43	S_0(1+2m)	2σ_0	תרחישים קיצוניים, בהם התוצאה מוכפלת ב-0.35.	1736	50
44	S_0(1-2m)	2σ_0	תרחישים קיצוניים, בהם התוצאה מוכפלת ב-0.35.	1064	50
45	תרחיש "שווי שוק"				

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