

## Рформирането на сценарии на сделката, въз основа оп на предната споразумение за лихвен процент Libor 3X6 в доларина САЩ .

FRA Fixed Rate Увреждания (%):	(P)	6% (fixed leg)
търговски размер (в условни единици):	(TS)	\$ 1,000,000
Margin %:	(M)	по споразумение между контрагентите

Купува/дълги плащане (фиксирана и получаването на плаващи) изпълнението на сценарий	на отваряне , цената	на затваряне цена (с ВКЛ. спред) плаващ крак	цената ще се промени	Печалба/загуба
 изгодни	6%	6.4%	0.4%	\$4000
 умерена	6%	6.2%	0.2%	\$2000
 неблагоприятни	6%	5.6%	-0.4%	-\$4000
 напрежение	6%	5.3%	-0.7%	-\$7000

Продава/къса(плащане на плаващи получаване/фиксирана) изпълнението на сценарий	на отваряне , цената	на затваряне цена (с ВКЛ. спред) плаващ крак	цената ще се промени	Печалба/загуба
 изгодни	6%	5.6%	-0.4%	\$4000
 умерена	6%	5.8%	-0.2%	\$2000
 Неблагоприятни	6%	6.4%	0.4%	-\$4000
 Напрежение	6%	6.7%	0.7%	-\$7000

Печалба и загуба, изчислена по-горе, са предмет на плащане/получаване в рамките на 6 месеца, считано от днес. Въпреки това, Fra се решават, след като LIBOR е определен и известен, че е 3

месеца от днес. Всички суми печалбата и загубата след това обстоятелства с помощта на достъпна дисконтовия процент, който обикновено съвпада с таблицата по-горе процент LIBOR.