









## PNKCI SCÉNÁŘE obchod se sídlem na to 3X6 Forwardové úrokové míře Dohody o Libor v USD.

<b>FRA Pevná Sazba Plátce (%):</b>	(P)	6% (fixní nohu)
<b>velikost Obchodu (za Nominální):</b>	(TS)	\$1,000,000
<b>Marže %:</b>	(M)	na základě dohody mezi smluvními stranami

	KOUPIT/LONG (Platí fixní/příjem plovoucí) Výkon Scénář	Otevřete Cena	Uzavírací Cena (vč. spread) Plovoucí Nohu	změna Cena	Zisk/Ztráta
	Příznivá	6%	6.4%	0.4%	\$4000
	Mírný	6%	6.2%	0.2%	\$2000
	Nepříznivých	6%	5.6%	-0.4%	-\$4000
	Stresu	6%	5.3%	-0.7%	-\$7000

	PRODEJ/SHORT(Platí Plovoucí/Příjem pevné) Výkon Scénář	Otevřete Cena	Uzavírací Cena (vč. spread) Plovoucí Nohu	změna Cena	Zisk/Ztráta
	Příznivá	6%	5.6%	-0.4%	\$4000
	Mírný	6%	5.8%	-0.2%	\$2000
	Nepříznivých	6%	6.4%	0.4%	-\$4000
	Stresu	6%	6.7%	0.7%	-na\$7000

Výkaz zisku a ztráty vypočtené výše jsou splatné/pohledávky do 6 měsíců od dnešního dne. Nicméně, FRAs jsou vypořádány, jakmile LIBOR je pevný a známý, který je 3 měsíce ode dneška. Všechny výkazy Zisku a ztrát jsou pak diskontovány s použitím diskontní sazby k dispozici, což je obvykle stejný LIBOR výše.