









## PERFORMANCE SCENARIER af en aftale baseret på en 3X6 Frem Sats Aftale om Libor i USD.

<b>FRA Fast Rente Betaleren (%):</b>	(P)	6% (faste ben)
<b>Handel størrelse (pr Fiktive):</b>	(TS)	\$1,000,000
<b>Margin %:</b>	(M)	efter aftale mellem modparterne

	<b>KØB/LANG (Betalers fast/modtagelse af flydende) Performance Scenarie</b>	<b>Åbn Pris</b>	<b>slutkurs (inc. spread) Flydende Ben</b>	<b>prisændringer</b>	<b>Gevinst/Tab</b>
	Gunstige	6%	6.4%	0.4%	\$4000
	Moderate	6%	6.2%	0.2%	\$2000
	Ugunstig	6%	5.6%	-0.4%	-\$4000
	Stress	6%	5.3%	-0.7%	-\$7000

	<b>SÆLGER/KORT(Betalende Flydende/Modtager fast) Performance Scenarie</b>	<b>Åbn Pris</b>	<b>slutkurs (inc. spread) Flydende Ben</b>	<b>prisændringer</b>	<b>Gevinst/Tab</b>
	Gunstige	6%	5.6%	-0.4%	\$4000
	Moderate	6%	5.8%	-0.2%	\$2000
	Ugunstig	6%	6.4%	0.4%	-\$4000
	Stress	6%	6.7%	0.7%	-\$7000

Fortjeneste og tab, som beregnet ovenfor, er der betales/tilgodehavende i 6 måneder fra i dag. Men FRAs er afregnet, når LIBOR er fast og kendt, som er 3 måneder fra i dag. Al Profit og tab beløb er derefter ved tilbagediskontering af diskontoen til rådighed, som normalt er den samme i LIBOR ovenfor.