









PERFORMANCE SCENARIO 'S van een deal is gebaseerd op een 3 × 6 Forward Rate Agreement (over Libor in USD).

FRA Fixed Rate Payer (%):	(P)	6% (vaste been)
Handel grootte (per Fictieve):	(TS)	van \$1.000.000
Marge %:	(M)	bij de overeenkomst tussen tegenpartijen

	KOPEN/LANGE (het Betalen van vaste en/of variabele) Prestaties Scenario	Open Koers	Slotkoers (inc. spread) Drijvende Been	verandering van Prijs	Winst/Verlies
	Gunstige	6%	6.4%	0.4%	\$4000
	Matig	6%	6.2%	0.2%	\$2000
	Ongunstige	6%	5.6%	-0.4%	-\$4000
	Stress	6%	5.3%	-0.7%	-\$7000

	VERKOPEN/KORTE (te Betalen Variabele en/of vaste) Prestaties Scenario	Open Koers	Slotkoers (inc. spread) Drijvende Been	verandering van Prijs	Winst/Verlies
	Gunstige	6%	5.6%	-0.4%	\$4000
	Matig	6%	5.8%	-0.2%	\$2000
	Ongunstige	6%	6.4%	0.4%	-\$4000
	Stress	6%	6.7%	0.7%	-\$7000

De winst- en verliesrekening berekend boven zijn payable/receivable in 6 maanden van vandaag. Echter, termijncontracten met rentevaststelling na afloop worden afgerekend wanneer de LIBOR is een vaste en bekende 3 maanden van vandaag. Alle Winst en verlies worden vervolgens contant gemaakt tegen de disconteringsvoet beschikbaar die meestal dezelfde is van de LIBOR boven.