









PERFORMANCE STSENAARIUMID palju põhinevad kohta on 3X6 tähtpäevaintressiga Lepingu Libor USD.

| | | |
|---|------|---------------------------------|
| FRA Fikseeritud Intressimääraga Maksja (%): | (P) | 6% (fikseeritud jalg) |
| suurus (eurot Tinglik): | (TS) | \$1,000,000 |
| Marginaal %: | (M) | vahelise kokkuleppe osapooltele |

| OSTA/PIKK (Makstes määratud/vastuvõtmine ujuvad) Tulemuslikkuse Stsenaarium | Avatud, Hind | sulgemishind (kasvata. spread) Ujuva Jalg | Hinna muutus | Kasum/Kahjum |
|---|--------------|---|--------------|--------------|
|  Soodsad | 6% | 6.4% | 0.4% | \$4000 |
|  Mõõdukas | 6% | 6.2% | 0.2% | \$2000 |
|  Ebasoodne | 6% | 5.6% | -0.4% | -\$4000 |
|  Stressi | 6% | 5.3% | -0.7% | -\$7000 |

| MÜÜA/LÜHIKE (Maksab Ujuva/Vastuvõtmine fikseeritud) Tulemuslikkuse Stsenaarium | Avatud, Hind | sulgemishind (kasvata. spread) Ujuva Jalg | Hinna muutus | Kasum/Kahjum |
|---|--------------|---|--------------|--------------|
|  Soodsad | 6% | 5.6% | -0.4% | \$4000 |
|  Mõõdukas | 6% | 5.8% | -0.2% | \$2000 |
|  Ebasoodne | 6% | 6.4% | 0.4% | -\$4000 |
|  Stressi | 6% | 6.7% | 0.7% | -\$7000 |

Kasum ja kahjum arvutatakse eespool makstakse/laekunud 6 kuu jooksul alates tänasest. Siiski tähtpäevaintressiga lepingud on lahendatud, kui LIBOR on fikseeritud ja teada, mis on 3 kuu jooksul alates tänasest. Kõik Kasumi ja kahjumi summa on siis diskonteeritud, kasutades diskontomäära olemas, mis tavaliselt on sama, mis LIBOR eespool.