









PERFORMANCE SKENAARIOITA sopimuksen perusteella on a 3X6 Eteenpäin Korko Sopimus Libor USD.

FRA Kiinteä Korko Maksajan (%):	(P)	6% (kiinteä jalka)
Kaupan koko (per Laskennallinen):	(TS)	\$1,000,000
Marginaali,%:	(M)	, kun sopimuksen vastapuolten välillä

	OSTA/PITKÄ (Maksaa kiinteä/vastaanottaa kelluva) Suorituskyky Skenaario	Avaa Hintaa	Päätöskurssi (inc. levitä) Kelluva Jalka	Hinta muutos	Voitto/Tappio
	Myönteinen	6%	6.4%	0.4%	\$4000
	Kohtalainen	6%	6.2%	0.2%	\$2000
	Epäsuotuisa	6%	5.6%	-0.4%	-\$4000
	Stressi	6%	5.3%	-0.7%	-\$7000

	MYYDÄ/LYHYT(Maksaa Kelluva/Vastaanottaa kiinteä) Suorituskyky Skenaario	Avaa Hintaa	Päätöskurssi (inc. levitä) Kelluva Jalka	Hinta muutos	Voitto/Tappio
	Myönteinen	6%	5.6%	-0.4%	\$4000
	Kohtalainen	6%	5.8%	-0.2%	\$2000
	Epäsuotuisa	6%	6.4%	0.4%	-\$4000
	Stressi	6%	6.7%	0.7%	-\$7000

Voitto ja tappio lasketaan edellä ovat maksullisia/saamiset 6 kuukautta alkaen tänään. Kuitenkin, Korkoterminisopimuksia ratkaistaan, kun LIBOR on kiinteä ja tunnettuja, joka on 3 kuukautta, alkaen tänään. Kaikki Voitto ja tappio diskontataan käyttämällä diskonttokorkoa saatavilla joka yleensä on sama LIBORIN edellä.