









PERFORMANCE FORGATÓKÖNYVEK az egyezség alapján az egy 3X6 Határidős Kamatláb-Megállapodás Libor USD-ben.

FRA Fix kamatozású Fizető fél (%):	(P)	6% (fix láb)
Kereskedelmi méretű (egy Fiktív):	(TS)	\$1,000,000
Árrés %:	(M)	megállapodás szerint a szerződő felek között

VÁSÁRLÁS/HOSSZÚ (Kifizető fix/fogadó úszó) Teljesítmény Forgatókönyv	Nyitva Ár	záróár (inc. spread) Úszó Lába	Ár változás	Nyereség/Veszteség
 Kedvező	6%	6.4%	0.4%	\$4000
 Közepes	6%	6.2%	0.2%	\$2000
 Kedvezőtlen	6%	5.6%	-0.4%	-\$4000
 Stressz	6%	5.3%	-0.7%	-\$7000

ELADNI/RÖVID(Kifizető Úszó/Fogadó fix) Teljesítmény Forgatókönyv	Nyitva Ár	záróár (inc. spread) Úszó Lába	Ár változás	Nyereség/Veszteség
 Kedvező	6%	5.6%	-0.4%	\$4000
 Közepes	6%	5.8%	-0.2%	\$2000
 Kedvezőtlen	6%	6.4%	0.4%	-\$4000
 Stressz	6%	6.7%	0.7%	-\$7000

Eredménykimutatás fent kiszámított fizetendő/követelések 6 hónap múlva. Azonban FRAs rendezni, ha a LIBOR rögzített ismert, ami 3 hónap múlva. Mind a Nyereség, illetve veszteség összege, akkor kedvezményes diszkontrátával rendelkezésre, amely általában azonos a LIBOR felett.