









PERFORMANCE AÐSTÆÐUR á að takast á byggt á a 3X6 Áfram

Gengi Samkomulag um Libor í DALA.

FRA Föstum Borgar (%):	(P)	6% (fastur fótinn)
Viðskipti stærð (á Fræðilegu):	(TS)	1.000.000 dala
Brún %:	(M)	við samningur milli mótaðila

KAUPA/LENGI (að Borga fastur/taka á móti fljótandi) Árangur Atburðarás	Opna Verð	að Loka Verð (inc. breiða) Fljótandi Fótinn	Verð að breyta	Hagnaður/Tap
 Góð	6%	6.4%	0.4%	\$4000
 Meðallagi	6%	6.2%	Er 0,2%	\$2000
 Óhagstæður	6%	Að 5,6%	-0.4%	-\$4000
 Streitu	6%	5.3%	-0.7%	-\$7000

SELJA/STUTT(að Borga Fljótandi/að Fá fasta) Árangur Atburðarás	Opna Verð	að Loka Verð (inc. breiða) Fljótandi Fótinn	Verð að breyta	Hagnaður/Tap
 Góð	6%	Að 5,6%	-0.4%	\$4000
 Meðallagi	6%	5.8%	-Er 0,2%	\$2000
 Óhagstæður	6%	6.4%	0.4%	-\$4000
 Streitu	6%	6.7%	0.7%	-\$7000

Hagnaði og tap reiknað ofan eru greiða/nái í 6 mánuði frá í dag. Hins vegar, FRAs eru settist þegar LIBOR er fastur og þekktur sem er 3 mánuði frá í dag. Öllum Hagnaði og tap magn eru þá afsláttur með afsláttur gengi laus sem er yfirleitt sama um LIBOR að ofan.