









PERFORMANCE SCENĀRIJI par vienošanos, kas balstīta uz a 3X6 nestandardizētiem procentu Likmes Nākotnes Līgumu par Libor USD.

FRA Fiksētas Likmes Maksātāja (%):	(P),	6% (fiksētā kāju)
Tirdzniecības izmērs (uz vienu Nosacīto):	(TS)	\$1,000,000
Rezerve %:	(M)	pēc vienošanās starp darījumu partneriem

PIRKT/ILGTERMIŅA (Maksājot fiksēto/saņemšana peldošās) Darbības Scenārijs	Atvērt Cenu	Slēgšanas Cenu (inc. spread) Peldošās Kāju	Cenu izmaiņas	Peļņa/Zaudējumi
 Labvēlīgu	6%	6.4%	0.4%	\$4000
 Vidēji	6%	6.2%	0.2%	\$2000
 Nelabvēlīgs	6%	5.6%	-0.4%	-\$4000
 Stress	6%	5.3%	-0.7%	-\$7000

PĀRDOD/ĪSU (Maksājot Peldošās/, kas Saņem fiksēto) Darbības Scenārijs	Atvērt Cenu	Slēgšanas Cenu (inc. spread) Peldošās Kāju	Cenu izmaiņas	Peļņa/Zaudējumi
 Labvēlīgu	6%	5.6%	-0.4%	\$4000
 Vidēji	6%	5.8%	-0.2%	\$2000
 Nelabvēlīgs	6%	6.4%	0.4%	-\$4000
 Stress	6%	6.7%	0.7%	-\$7000

Peļņas un zaudējumu aprēķina iepriekš, ir kreditoru/debitoru 6 mēnešus no šodienas. Tomēr, Nestandardizētu tiek slēgtas, kad LIBOR ir noteikts un zināms, kas ir 3 mēnešus no šodienas. Visi Peļņas un zaudējumu summa pēc tam tiek diskontētas, izmantojot diskonta likmi, kas ir pieejami, kas parasti ir vienāds ar LIBOR iepriekš.