









PERFORMANCE SCENARIJUS sandorj based on a 3X6 Išankstiniai palūkanų Normos Susitarimo dėl Libor USD.

FRA Fiksuotų palūkanų Mokėtojas (%):	(P)	6% (nustatytas kojos)
Prekių dydžio (per Tariamoji):	(TS)	\$1,000,000
Marža,%:	(M)	susitarimu sandorio šalių

	BUY/LONG (Mokėti fiksuotą/gavimas plūduriojantis) Veiklos Scenarijus	Atidaryti Kaina	Uždarymo Kaina (inc. spread) Kintama Kojos	Kainos pokytis	Pelno (Nuostolių)
	Palankios	6%	6.4%	0.4%	\$4000
	Saikingai	6%	6.2%	0.2%	\$2000
	Nepalankios	6%	5.6%	-0.4%	-\$4000
	Stresas	6%	5.3%	-0.7%	-\$7000

	PARDUODU/TRUMPAS(Mokėjimo Plūduriojantis/Gaunantiems fiksuotas) Veiklos Scenarijus	Atidaryti Kaina	Uždarymo Kaina (inc. spread) Kintama Kojos	Kainos pokytis	Pelno (Nuostolių)
	Palankios	6%	5.6%	-0.4%	\$4000
	Saikingai	6%	5.8%	-0.2%	\$2000
	Nepalankios	6%	6.4%	0.4%	-\$4000
	Stresas	6%	6.7%	0.7%	-\$7000

Pelno (nuostolio) apskaičiuota anksčiau mokėtinos/gautinos sumos per 6 mėnesius nuo šiandien. Tačiau, FRAs yra atsiskaitoma, kai LIBOR yra fiksuota ir žinoma, kuris 3 mėnesius nuo šiandien. Visi Pelno (nuostolių) suma yra tada, diskontuota naudojant diskonto norma, kurios paprastai yra tas pats LIBOR virš.