









PERFORMANCE XENARJI ta'negozju bbażati fuq a 3X6 Quddiem

Rata tal-Ftehim dwar l-Libor fil-USD.

FRA Rata Fissa Iħallas (%):	(P)	6% (fiss-sieq)
- daqs tal-Kummerċ (per Kuncettwali):	(TS)	\$1,000,000
Margni %:	(M)	fuq il-ftehim bejn l-kontropartijiet

JIXTRU/TWIL (Hlas fiss/jirċievu f'wiċċ l-ilma) tal-Prestazzjoni tax-Xenarju	Miftuħa Prezz	tal-Għeluq tal-Prezzijiet (inc. tixrid) F'wiċċ l-ilma tar-Riġel	bidla fil-Prezz	ta'Qliġh/Telf
 Favorevoli	6%	6.4%	0.4%	\$4000
 Moderat	6%	6.2%	0.2%	\$2000
 Sfavorevoli	6%	5.6%	-0.4%	-\$4000
 - Istress	6%	5.3%	-0.7%	-\$7000

JBIEGĦU/QASIR(Hlas Varjabbli/Jirċievu fiss) tal-Prestazzjoni tax-Xenarju	Miftuħa Prezz	tal-Għeluq tal-Prezzijiet (inc. tixrid) F'wiċċ l-ilma tar-Riġel	bidla fil-Prezz	ta'Qliġh/Telf
 Favorevoli	6%	5.6%	-0.4%	\$4000
 Moderat	6%	5.8%	-0.2%	\$2000
 Sfavorevoli	6%	6.4%	0.4%	-\$4000
 - Istress	6%	6.7%	0.7%	-\$7000

Il-profitt u telf ikkalkulat hawn fuq huma pagabbli/riċevibbli fil-6 xhur mil-lum. Madankollu, FRAs huma mħallsa darba l-LIBOR huwa fiss u magħrufa li huwa 3 xhur mil-lum. L-Qliġh u t-telf l-ammont huma mbagħad mnaqqsa bl-użu skont rata disponibbli li normalment huwa l-istess ta' l-LIBOR hawn fuq.