









PERFORMANCE SCENÁRE obchodu založené na a 3X6 Forward Rate Agreement on Libor v USD.

FRA Pevnou úrokovou Sadzbou Platiteľa (%):	(P)	6% (pevná noha)
veľkosť Obchodu (za Dohodnuté):	(TS)	\$1 000 000 sk
Rozpätie %:	(M)	na základe dohody medzi zmluvnými stranami

KÚPIŤ/LONG (Platenia pevný/prijímanie plávajúce) Výkon Scenár	Otvoriť Cenou	záverečná Cena (inc. spread) Plávajúce Nohu	zmena Ceny	Zisk/Strata
 Priaznivý	6%	6.4%	0.4%	\$4000
 Stredne	6%	6.2%	0,2% Do	\$2000
 Nepriaznivých	6%	5.6%	-0.4%	-\$4000
 Stres	6%	5.3%	-0.7%	-\$7000

PREDAJ/KRÁTKE(Platenia Plávajúce/Prijem pevné) Výkon Scenár	Otvoriť Cenou	záverečná Cena (inc. spread) Plávajúce Nohu	zmena Ceny	Zisk/Strata
 Priaznivý	6%	5.6%	-0.4%	\$4000
 Stredne	6%	5.8%	-0,2% Do	\$2000
 Nepriaznivých	6%	6.4%	0.4%	-\$4000
 Stres	6%	6.7%	0.7%	-\$7000

Výkaz ziskov a strát vypočítané vyššie sú splatné/pohľadávky do 6 mesiacov od dnes. Avšak, Fra sú vyplácané raz LIBOR je pevný a známy, ktorá je 3 mesiace od dnes. Všetky zisky a straty sú potom diskontované použitím diskontnej sadzbe, ktorá je zvyčajne rovnaký LIBOR vyššie.