









PERFORMANCE SCENARIJEV za posel, ki temelji na a 3X6

Terminski Tečaj Sporazuma o Libor v USD.

FRA Fiksno obrestno Plačnik (%):	(P)	6% (fiksna noge)
Trgovina velikost (na Namišljene):	(TS)	\$1,000,000
Robu %:	(M),	po dogovoru med nasprotne stranke

NAKUP/LONG (Plačilo fiksni/sprejem plavajoči) Uspešnosti Scenarij	Odprte Cena	Zaključno Cena (inc. spread) , ki Plava Noge	, spremembe Cen	Dobiček/Izguba
 Ugodno	6%	6.4%	0.4%	\$4000
 Zmerno	6%	6.2%	0.2%	\$2000
 Neugodna	6%	5.6%	-0.4%	-\$4000
 Stresa	6%	5.3%	-0.7%	-\$7000

PRODAJA/KRATKE(Plačilni Plavajoče/Prejemanje fiksne) Uspešnosti Scenarij	Odprte Cena	Zaključno Cena (inc. spread) , ki Plava Noge	, spremembe Cen	Dobiček/Izguba
 Ugodno	6%	5.6%	-0.4%	\$4000
 Zmerno	6%	5.8%	-0.2%	\$2000
 Neugodna	6%	6.4%	0.4%	-\$4000
 Stresa	6%	6.7%	0.7%	-\$7000

Dobiček in izguba se izračuna zgoraj so plačljive/terjatev v 6 mesecih od danes. Vendar, FRAs, se poravnajo, ko LIBOR je določena in znana, ki je 3 mesece od danes. Vse dobičke in izgube znesek se nato diskontirati z uporabo diskontne mere, ki so običajno na voljo je enako z LIBOR zgoraj.