









## PUTFÖRANDE SCENARIER i en affär som bygger på en 3X6 Forward Rate Agreement på Libor i USD.

<b>FRA Fast Ränta som Betalaren (%):</b>	(P)	6% (fast benet)
<b>Handel storlek (per Nominella):</b>	(TS)	\$1,000,000
<b>Marginal %:</b>	(M)	efter överenskommelse mellan motparter

	<b>KÖPA/LÅNG (Betalas mot flytande) Prestanda Scenario</b>	<b>Öppet Pris</b>	<b>Slutkurs (inkl. spridning) Flytande Ben</b>	<b>prisförändring</b>	<b>Vinst/Förlust</b>
	Gynnsamma	6%	6.4%	0.4%	\$4000
	Måttlig	6%	6.2%	0,2%, Till	\$2000
	Ogynnsamma	6%	5.6%	-0.4%	-\$4000
	Betona	6%	5.3%	-0.7%	-\$7000

	<b>SÄLJA/KORT (Betala Flytande/ta Emot fast) Prestanda Scenario</b>	<b>Öppet Pris</b>	<b>Slutkurs (inkl. spridning) Flytande Ben</b>	<b>prisförändring</b>	<b>Vinst/Förlust</b>
	Gynnsamma	6%	5.6%	-0.4%	\$4000
	Måttlig	6%	5.8%	-0.2%	\$2000
	Ogynnsamma	6%	6.4%	0.4%	-\$4000
	Betona	6%	6,7% Och	0.7%	-\$7000

Vinst och förlust beräknas ovan betalas/återfås i 6 månader från och med idag. Men Fra är fast när LIBOR är fast och känd som är 3 månader från och med idag. All Vinst och förlust belopp diskonteras sedan med hjälp av diskonteringsräntan som finns och som oftast är samma i LIBOR ovan.