**Задача**

На валютному ринку існує наступне котирування валют для короткотермінових угод:

Термін Долар США / Латвійська лата Долар США / Датська крона

спот 5450 – 5500 1,5040 – 1,5050

(Форвардна маржа)

1 міс 40-60 5-3

2 міс 90-130 10-8

3 міс 140-180 16-13

Визначити: курси форвард долара США до латвійської лати та до датської крони на 1, 2, 3 місяці.

**Задача**

Визначте котирування форвардного крос-курсу обміну швейцарських франків до японської єни за 9-місячним контрактом для таких вихідних даних:

швейцарський франк/долар долар/єна

курс спот 0,6524 -0,6582 127,935 – 127,990

9 міс форвардні пункти 108-115 4300 – 4200.

**Задача**

Фірмі в Норвегії через 3 міс. (91 день) необхідно 1 млн. дол.. США. Курс долара до норвезьких крон

спот 1,6920 - 1,6950

міс. 65 - 55

Визначити результат форвардної угоди по купівлі доларів, якщо курс долара через 3 міс.:

а) 1,6890 - 1,6895;

б) 1,6840 - 1,6885.

**Задача**

Курс долара США до швейцарського франку:

спот 1,2650 - 1,2685

1 міс. 112 - 108

Визначити, яким буде результат свопа з доларом США (прибуток чи збиток) у ефективність (прибутковість чи збитковість) свопа у вигляді річної ставки процентів

**Задача**

Клієнтові необхідно при отриманні валютних коштів з депозитного рахунку конвертувати їх у гривні. Щоб уникнути валютного ризику, клієнт укладає з банком 26.11.07 форвардний валютний контракт на суму 500 тис. доларів, дата розрахунків за яким настає 26.02.08, а форвардний період становить три місяці. На дату укладання угоди 26.11.07 на ринку діяли: спот-курс — 1,885 грн./дол. США; облікова ставка НБУ — 35 %; ставка за доларами США — 6,09 %.

На дату розрахунків 26.02.08 операція валютного обміну здійснюється за спот-курсом 2,0149 грн./дол. США, і клієнт одержує 1 007 450 грн.

Розрахувати валютний курс, що буде зафіксований в угоді та визначити загальну суму виплат.

**Задача**

Внутрішня процентна ставка дорівнює 12 %, іноземна процентна ставка - 7 %. Очікуване знецінення національної валюти – 3 %, а премія за ризик за національною валютою становить 2%. Визначте компенсацію, яку вимагатимуть приватні інвестори, погоджуючись з ризиком.

**Задача**

Розмір регулятивного капіталу банку становить 10 млн. грн. Вимоги банку в доларах США становлять 25 000, а в євро 15000. Зобов’язання у цих валютах — відповідно 8000 і 36000. Валютні позиції відкриті в обох валютах. Умовно прийняті наступні курси валют відповідно 1:7 та 1:5 для долару та євро відповідно. Розрахуйте загальну відкриту валютну позицію та нормативи відкритої валютної позиції.

**Задача**

На валютному ринку існує наступне котирування валют для короткотермінових угод:

Термін Долар США / Латвійська лата Долар США / Датська крона

спот 5450 – 5500 1,5040 – 1,5050

(Форвардна маржа)

1 міс 40-60 5-3

2 міс 90-130 10-8

3 міс 140-180 16-13

Визначити: курси форвард долара США до латвійської лати та до датської крони на 1, 2, 3 місяці.

**Задача**

Визначте котирування форвардного крос-курсу обміну швейцарських франків до японської єни за 9-місячним контрактом для таких вихідних даних:

швейцарський франк/долар долар/єна

курс спот 0,6524 -0,6582 127,935 – 127,990

9 міс форвардні пункти 108-115 4300 – 4200.

**Задача**

Фірмі в Норвегії через 3 міс. (91 день) необхідно продати 1 млн. дол. США. Курс долара до норвезьких крон

спот 1,6920 - 1,6950

міс. 65 - 55

Визначити результат форвардної угоди по купівлі доларів, якщо курс долара через 3 міс.:

а) 1,6890 - 1,6895;

б) 1,6840 - 1,6885.

**Задача**

Фірмі в Україні необхідно 100 тис. дол. США через 1 міс. (зо днів). Курс долара до гривні:

спот 5,52 - 5,59

1 міс 50 - 70

Опціон на купівлю 100 тис. дол. куплений за 5,66 грн. за дол. з виплатою премії 0, 40 грн. за дол.

Визначити результат угоди, якщо курс долара через 1 міс. складе:

а)5,65-5,77;

б) 5,55-5,63.

**Задача**

Клієнтові необхідно при отриманні валютних коштів з депозитного рахунку конвертувати їх у гривні. Щоб уникнути валютного ризику, клієнт укладає з банком 26.11.07 форвардний валютний контракт на суму 500 тис. доларів, дата розрахунків за яким настає 26.02.08, а форвардний період становить три місяці. На дату укладання угоди 26.11.07 на ринку діяли: спот-курс — 1,885 грн./дол. США; облікова ставка НБУ — 35 %; ставка за доларами США — 6,09 %.

На дату розрахунків 26.02.08 операція валютного обміну здійснюється за спот-курсом 2,0149 грн./дол. США, і клієнт одержує 1 007 450 грн.

Розрахувати валютний курс, що буде зафіксований в угоді та визначити загальну суму виплат.

**Задача**

Учаснику валютного ринку-імпортеру для оплати договору необхідно 10 000 євро, для чого він повинен продати 7142 дол. (за курсом $1 = 1,4001 євро). Опишіть дії учасники валютного ринку для отримання прибутку та від чого вони залежатимуть.

**Задача**

Брокер прийняв замовлення від клієнта на укладення три місячного ф’ючерсного контракту на купівлю 1 000 доларів США за ціною 3,40 грн. за долар США. Визначити, яку суму гарантійної застави вносить брокер за рахунок коштів клієнта.