

ЗАВДАННЯ ДО СЕМІНАРІВ

Завдання 1. Темы для обговорення, презентацій, доповідей.

1. Основні етапи становлення валютної системи України.
2. Проблеми формування офіційного валютного резерву в Україні.
3. Аналіз сучасних обсягів купівлі-продажу та тенденції розвитку світового валютного ринку.
4. Державні методи регулювання валютного курсу в Україні.
5. Особливості термінових валютних операцій на світових ринках.
6. Досвід діяльності Лондонської ф'ючерсної біржі.
7. Можливості проведення валютного арбітражу комерційними банками України.
8. Методи валютного регулювання економіки.
9. Девальвація та ревальвація національної грошової одиниці.
10. Валютний курс, його види та функції. Приклади розрахунку валютного курсу.
11. Дисконтна та девізна валютна політика.
12. Характеристика операцій на валютних ринках. Приклади.
13. Охарактеризуйте світові ринки золота, дорогоцінного каміння або дорогоцінних металів.

Завдання 2. Надати характеристику структурних та кон'юнктурних факторів впливу на розмір валютного курсу.

Структурні чинники	Кон'юнктурні чинники

Рис. 1. Характеристика структурних та кон'юнктурних факторів впливу на валютний курс

Завдання 3. Заповнити схему класифікації видів валютних операцій.

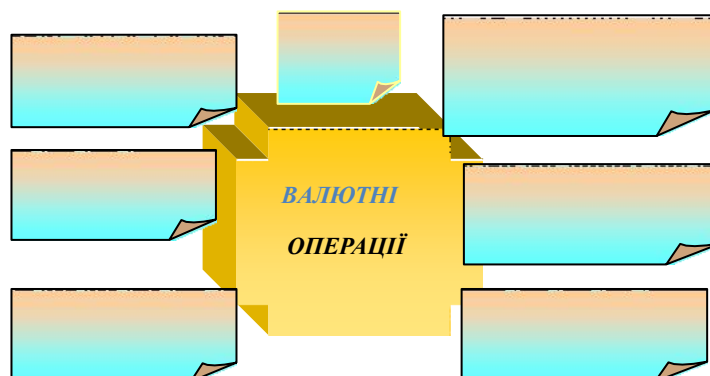


Рис. 2. Класифікація видів валютних операцій

Завдання 4. Заповнити блок-схему класифікації видів конверсійних операцій.

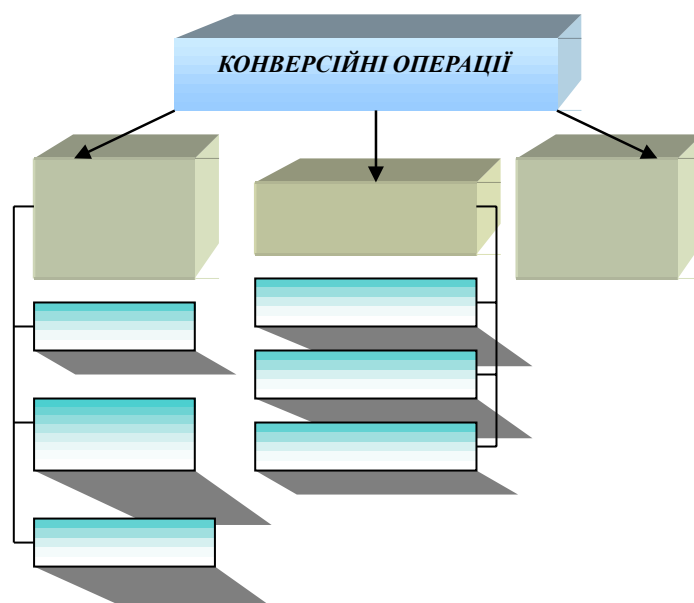


Рис. 3. Класифікація видів конверсійних операцій

Завдання 5. Українське зовнішньоторговельне підприємство придбало європейський опціон на 750 тис. євро за ціною виконання 4,1300 грн. за 1 євро з датою закінчення 25 вересня 2022 р.

Визначте прибуток (збиток) підприємства, якщо на 25 вересня 2022 р. курс грн. склав 4,1300 грн за 1 євро. Зробіть висновки про доцільність придбання опціону.

Завдання 6. Інвестор займає строкову позицію гри на підвищення 2 січня за одним березневим ф'ючерсним контрактом на японські єни (стандартна партія 12500000 ієн) за ціною 0,0096 дол. США за одну ієну. Гарантійний внесок 2700 дол. США, додаткове забезпечення – 2000 дол. США.

Скільки в інвестора залишиться на рахунку 4 січня вранці, якщо останній ієновий контракт відбувся 2 січня за ціною 0,0120 дол. США за ієну, а 3 січня – 0,0125 дол. США за ієну.

Завдання 7. За умовами контракту підприємство-експортер надає іноземному покупцеві відстрочку платежу на 80% вартості контракту на 2 роки з розрахунку 6% річних. Сума контракту складає 200 000 ЄВРО погашення кредиту відбуватиметься рівними піврічними внесками (у вигляді виписаного комплекту тратт) через півроку після поставки товару, відвантаженого одноразовою партією.

У даний момент між контрагентами ведуться переговори щодо способу нарахування процентів. Проценти можуть бути нараховані:

Із суми заборгованості до дати наступного платежу.

Від дати видачі до дати оплати чергової практики.

Підрахуванням загальної суми процентів і діленням її на рівні частини за числом трат.

Визначити:

- а) загальну суму належних до сплати процентів за всіма варіантами;
- б) найбільш вигідний варіант нарахування процентів з точки зору експортера.

Припустивши, що рівно через рік з моменту перетинання митного кордону України відбулася документальна перевірка діяльності фірми-експортера, розрахувати (на підставі сучасного законодавства України):

- а) розмір пені, що має бути сплачена підприємством на рахунок позикової інспекції;
- б) який розмір пені перераховується в 2022 р.;
- в) який максимальний розмір пені може сплатити фірма за порушення законодавчо встановлених термінів розрахунків по експортних операціях резидентів.

Завдання 8. ТОВ «Сигма» експортує товар вартістю 400 тис. дол. до Японії. Умовами контракту передбачено, що валюта платежу – долари США. Надалі вносяться зміни до контракту, згідно з якими замінюється валюта платежу: 60 % контракту оплачується в євро, а 40 % – у гривнях через партнера японській фірми в Україні за курсом НБУ на день здійснення платежу (37,2 грн. за дол.).

Чи були порушення чинного законодавства України з боку партнерів за договором, якщо вони не зверталися до відповідних органів щодо одержання будь-яких ліцензій на здійснення розрахунків? Якщо такі порушення були, то розрахувати суму санкцій, яку слід сплатити в бюджет за порушення чинного законодавства.

Завдання 9. Валютна виручка українського підприємства складає 37,5 тис. дол США. Витрати на транспортування, страхування вантажу та експедиторські витрати дорівнюють 7,5 тис дол США.

Курс гривні, що встановлюється на торгах міжбанківської валютної біржі, – 37,24 грн/дол США. Курс міжбанківського валютного ринку – 37,12 грн/дол США. Курс НБУ – 37,18 грн/дол США. Розмір комісійних банку – 1,5%.

Визначити обсяг валютної та гривневої виручки підприємства згідно з існуючим законодавством щодо валютного регулювання.

Завдання 10. Вам необхідно купити англійські фунти в обмін на один мільйон японських ієн. Банк пропонує зробити це за крос-курсом. При цьому відомо, що $GBP/USD = 1,3341 - 1,3444$ та $USD/JPY = 0,9793 - 0,9900$.

Визначити валютний курс, за яким ви будете проводити цю операцію, та суму англійських фунтів, яку ви одержите.

Завдання 11. Інвестор купує ф'ючерсний контракт на 27500 дол. США за ф'ючерсним курсом 0,93 євро з оплатою за спотовим курсом євро в гривнях. Припустимо, що в момент виконання ф'ючерсного контракту курс 1 євро дорівнює 40,6000 гривень.

Визначить суму в гривнях за яку буде поставлено інвестору 27500 дол. США.

Завдання 12. Спот-курс USD/AUD = 1,3240 – 1,3256, своп-ставки на 4 місяці 150-110, а на 5 місяців 190-120.

Необхідно визначити форвардний валютний курс через 4 місяці 18 днів.

Завдання 13. Сьогодні є можливість купувати товар у одного постачальника за 500 дол. США, а у іншого – за 400 євро. Встановлені курси валют: 37 грн/дол. США та 40 грн/євро.

Визначити:

1. У якого постачальника вигідніше придбати товар?
2. Якщо товар можна придбати в кредит під 10% річних (ставка за кредитами в доларах та євро) строком на 1 рік. Через рік курси валют прогножуються на рівні 39 грн/дол. і 42 грн/євро. У якого постачальника вигідніше придбати товар? Інфляцією знехтувати.
3. У якого постачальника вигідніше придбати на умовах п. 2, якщо річний темп інфляції прогножуються на рівні 5 %?

Завдання 14. Розрахуйте ціну однієї тройської унції золотого злитку проби 999,5. Ринкова ціна золота на Лондонському ринку дорогоцінних металів відповідає 390 дол. США за одну тройську унцію.

Завдання 15. Визначити вартість партії золота у стандартних злитках у гривнях, якщо вона має вагу у лігатурі 22 кг. Проба 999,9. Ціна золота на міжнародному ринку розрахована за ранковим “золотим” фіксіном у Лондоні відповідає 404 дол. США за одну тройську унцію. Облікова вагова одиниця банківських металів – тройська унція (31,1034807 грама). Результати визначаються з точністю до 0,001 долі тройської унції із застосуванням правил округлення. Курс долара США до гривні за котируванням НБУ складає 38,03 грн.

Завдання 16. Визначити вартість партії алмазів у гривнях, якщо при зважуванні партії алмазів показання терезів складає 410,076 карату. Визначення маси дорогоцінного каміння здійснюється без врахування більш дрібних часток карата у показаннях терезів. Вартість 1 карата складає 800 дол. США. Курс долара США до гривні за котируванням НБУ – 38,03 грн.