

## Тест 2. «Валютный рынок»

1. В какой момент риск поставки в валютной сделке, совершенной сегодня на условиях «спот», будет максимальным?

- а) сегодня;
- б) завтра;
- в) в расчетный день;
- г) останется одинаковым для всех дней.

2. Валютный дилер имеет четыре котировки четырех банков валютной пары EUR/USD:

- 1) 1.2156/1.2159;
- 2) 1.2158/1.2165;
- 3) 1.2163/1.2168;
- 4) 1.2157/1.2169.

Дилер хочет продать евро. Какую цену он выберет для продажи?

- 1) 1.2156;
- 2) 1.2165;
- 3) 1.2163;
- 4) 1.2169.

3. Клиент запрашивает у банка спот-курс EUR/JPY. Дилер банка надеется, что клиент заинтересован в покупке японской иены. Какая из следующих котировок наиболее выгодна для банка?

- а) 105.39 /43;
- б) 105.42 /47;
- в) 105.46 /50;
- г) 105.50 /55.

4. Необходимо продать австралийские доллары за швейцарские франки. Что для этого нужно сделать в первую очередь? (Отметить правильный вариант).

- а) продать австралийские доллары за доллары США по курсу Bid банка на доллары США;
- б) продать австралийские доллары и купить швейцарские франки по курсу продажи банком CHF;
- в) продать австралийские доллары и купить доллары США по курсу продажи (Ask) банком долларов США за австралийские доллары;
- г) ни одно из вышеперечисленного.

5. Банк «Санкт-Петербург» предлагает следующие спот-курсы относительно доллара США:

- 1) USD/CHF = 0.9878/82;
- 2) USD/JPY = 78.48/52;
- 3) USD/CAD = 1.0127/29;
- 4) GBP/USD = 1.4619/23.

а) по какому курсу банк покупает британские фунты? (Отметить).

б) Каков спред по швейцарским франкам? (написать).

в) по какому курсу банк продаст японские иены?

6. «Альфа-банк» дает следующие спот-курсы валют относительно доллара США:

$$\text{USD/CHF} = 0.9878/82;$$

$$\text{USD/CAD} = 1.0127/29;$$

$$\text{GBP/USD} = 1.5619/1.5623.$$

а) Каким будет кросс-курс в швейцарских франках при покупке одного канадского доллара?

7. Ряд банков предлагают следующие котировки GBP/USD и USD/CHF.

Банк	GBP/USD	USD/CHF
1	1.2619/1.2622	1.0236/1.0238
2	1.2622/1.2625	1.0238/1.0248
3	1.2618/1.2624	1.0244/1.0250
4	1.2624/1.2626	1.0239/1.0249
5	1.2623/1.2627	1.0238/1.0247

а) Какой банк вы выберете для продажи британских фунтов за американские доллары? (Написать банк и цену).

б) Какой банк вы выберете для продажи долларов за швейцарские франки? (Написать банк и цену).

**8. Ряд банков предлагают следующие котировки USD/CHF и USD/JPY.**

Банк	USD/CHF	USD/JPY
1	0.9876 / 0.9878	78.46/78.58
2	0.9874 / 0.9888	78.46/78.56
3	0.9873 / 0.9882	78.44/78.54
4	0.9877 / 0.9889	78.45/78.60
5	0.9878 / 0.9890	78.47/78.57

а) Вы хотите продать швейцарские франки за доллары США. Какой банк вы выберете? (Отметить).

б) Вы хотите продать доллары США за японские иены. Какой банк вы выберете? (Отметить)

9. Какие из перечисленных определений более всего характеризуют форвардные пункты:

- а) Количество денег, выручаемое при обмене одной валюты на другую;
- б) Разница процентных ставок по двум валютам за определенный период времени;
- в) Сила одной валюты относительно другой;
- г) Будущая стоимость валюты.

10. Клиент заключает с банком трехмесячную форвардную сделку на продажу 100 000 британских фунтов за иены. Спот-курс банка GBP/JPY = 123.33/123.43. Котировка трехмесячного форварда, предлагаемая банком равна 52/57. Какую сумму в иенах придется заплатить банку в результате осуществления сделки?

11. Спот-курс банка по EUR/USD = 1.1210 / 20. Форвардные пункты по трехмесячному форварду – 38/36. Каков будет форвардный курс EUR/USD?

- а) 1.1248 / 1.1256; б) 1.1172 / 1.2184; в) 1.1246 / 1.1258;  
г) 1.1174 / 1.1182.

12. Три банка котируют спот-курсы и форвардные пункты по USD/CNY

	Банк 1	Банк 2	Банк 3
Спот-курс	6.8962/72	6.9015/25	6.8924/34
Трехмесячный форвардный курс	12/20	14/ 10	15/9

а) Какой банк предлагает для клиентов лучшую форвардную цену на покупку китайских юаней? (Вычислить и написать).

б) Чему равно количество форвардных пунктов по лучшей форвардной цене

в) Каким будет форвардный курс?