

Эта часть работы выложена в ознакомительных целях. Если вы хотите получить работу полностью, то приобретите ее воспользовавшись формой заказа на странице с готовой работой:

<https://studservis.ru/kontrolnaya-rabota/75294>

Тип работы: Контрольная работа

Предмет: Мировая экономика

На основании данных о валютных операциях организации (согласно номеру варианта), определить:

1. итоговые валютные позиции
2. валютный риск
- 3) балансирующую валютную позицию
- 4) выполнить выравнивание валютной позиции

Собственный капитал банка 952 642 000 рублей.

Приемлемый уровень хеджа -20% от СК. По валютам первой категории -15%, второй -10%, третьей -5%.

Справочно: курсы к RUR

USD 60.51-60.55

EUR 71.66-71.87

CNY (10) 53.51-54.72

JPY (100) 66.58-67.21

CHF 74. 89-75.10

Варианты:

Номер варианта Номера операций

7 50, 3, 9, 88, 53, 1, 58, 81, 2, 33, 97, 44, 5, 62, 66, 22, 95, 77, 82, 28

Перечень операций:

Номер Валюта Сумма операции банка Тип операции

50 CNY 215896 Покупка

3 JPY 1 372 709 Продажа

9 USD 331 981 Покупка

88 EUR 667543 Продажа

53 EUR 632531 Продажа

1 USD 1 580 000 Покупка

58 CNY 398043 Покупка

81 USD 500369 Покупка

2 EUR 507 395 Продажа

33 CNY 900728 Продажа

97 EUR 574310 Покупка

44 USD 656627 Покупка

5 USD 240 410 Покупка

62 JPY 390343 Продажа

66 JPY 208497 Покупка

22 JPY 972035 Продажа

95 EUR 280595 Покупка

77 CNY 665156 Покупка

82 EUR 250167 Продажа

28 USD 451489 Покупка

РЕШЕНИЕ:

1. Итоговые валютные позиции

Валютная позиция – позиция валютного риска, который может возникнуть вследствие резкого изменения валютных курсов.

Валютная позиция определяется соотношением активов и пассивов, выраженных в одной и той же иностранной валюте.

Валютная позиция определяется отдельно по каждой иностранной валюте, в которой выражены активы или пассивы. Количество валютных позиций равна количеству валют, входящих в состав мультивалютного портфеля банка.

Отразим все операции организации за текущий операционный день отдельно по каждой иностранной валюте.

1.1. USD

Номер операции из задания ПОКУПКА

buy «+» ПРОДАЖА

sell «-»

9 +331.981

1 +1.580.000

81 +500.369

44 +656.627

5 +240.410

28 +451.489

Итого +3.760.876

Итоговая валютная позиция

+3.760.876

Открытая длинная валютная позиция

1.2. EUR

Номер операции из задания ПОКУПКА

buy «+» ПРОДАЖА

sell «-»

88 -667.543

53 -632.531

2 -507.395

97 +574.310

95 +280.595

82 -250.167

Итого +854.905 -2.057.636

Итоговая валютная позиция

-1.202.731

Открытая короткая валютная позиция

-

Эта часть работы выложена в ознакомительных целях. Если вы хотите получить работу полностью, то приобретите ее воспользовавшись формой заказа на странице с готовой работой:

<https://stuservis.ru/kontrolnaya-rabota/75294>