

## Inżynieria finansowa zadania lista 2

1. Przypuśćmy, że kontrahent A zawarł procentowy kontrakt typu FRA ( $T_1=6$ ,  $T_2=9$ ) z bankiem B. Kwota kontraktu jest równa 200 tys. GBP. Kontrakt został zawarty 8 marca 2019 r. i określa dzień 8 września 2019 r. jako dzień ustalenia stopy rozliczeniowej. W dniu zawarcia kontraktu 3-miesięczna stopa LIBOR GBP wynosi 0,8549%. Określ, jaki przepływ gotówki nastąpi w terminie rozliczenia kontraktu przyjmując, że za 6 miesięcy (8 września 2019 r.) 3-miesięczna stopa LIBOR GBP:
  - a) wzrośnie do 0,97%,
  - b) zmaleje do 0,78%.
2. Przypuśćmy, że kontrahent X zawarł procentowy kontrakt typu FRA ( $T_1=3$ ,  $T_2=9$ ) z bankiem B. Kwota kontraktu jest równa 100 tys. USD. Kontrakt został zawarty 8 marca 2019 r. i określa dzień 8 czerwca 2019 r. jako dzień ustalenia stopy rozliczeniowej. W dniu zawarcia kontraktu 6-miesięczna stopa LIBOR USD wynosi 2,6850%. Określ, jaki przepływ gotówki nastąpi w terminie rozliczenia kontraktu przyjmując, że za 3 miesiące (8 czerwca 2019 r.) 6-miesięczna stopa LIBOR USD:
  - a) wzrośnie do 2,75%,
  - b) zmaleje do 2,59%.
3. Przypuśćmy, że kontrahent P zawarł procentowy kontrakt typu FRA ( $T_1=3$ ,  $T_2=6$ ) z bankiem B. Kwota kontraktu jest równa 300 tys. EUR. Kontrakt został zawarty 8 marca 2019 r. i określa dzień 8 czerwca 2019 r. jako dzień ustalenia stopy rozliczeniowej. W dniu zawarcia kontraktu 3-miesięczna stopa LIBOR EUR wynosi -0,3370%. Określ, jaki przepływ gotówki nastąpi w terminie rozliczenia kontraktu przyjmując, że za 3 miesiące (8 czerwca 2019 r.) 3-miesięczna stopa LIBOR EUR:
  - a) wzrośnie do -0,29%,
  - b) zmaleje do -0,39%.