

OPAKOVÁNÍ: B

1. Je zadán devizový kurz eura v současném (S1) a minulém (S0) období:

S0 = 27.15 CZK/EUR

S1 = 25.40 CZK/EUR

Vypočtěte následující:

- vypočtěte procentní změnu devizového kurzu eura vůči české koruně
- vypočtěte procentní změnu devizového kurzu české koruny vůči euru
- určete, která měna zhodnotila a která znehodnotila

2. Dealer banky kótuje následující kurzy eura. Vypočtěte středový kurz a zjistěte výši spreadu v procentuálním vyjádření:

CZK/EUR 25.2985 25.3735

3. Česká společnost vyvezla do Polska stavební materiál za 125 000 PLN. Ke svému provozu ale potřebuje změnit polské zloté za české koruny. Kolik budou korunové příjmy za tento vývoz? K dispozici máte následující kotace devizových kurzů:

PLN/USD 3.02 3.08

CZK/USD 19.15 19.19

4. Váš podnik dovezl ze Slovenska produkty za 1 400 000 EUR. Platbu za dovoz musíte uhradit za 30 dnů. Současný spot kurz CZK/EUR je 25,32 – 25,47. Finanční manažer podniku se obává zhodnocení EUR vůči CZK, a proto uzavře forwardový obchod. Aktuální 1m swap kurz je 68 – 46. Určete kolik podnik zaplatí v CZK, pokud se zajistí prostřednictvím forwardu. Definujte, v jakém rozmezí devizových kurzů přináší forward podniku zisk oproti nezajištěné pozici a v jakém rozmezí ztrátu.