

Zestaw 6 - swap stopy procentowej

1. Firma Z jest zainteresowana kredytem o zmiennej stopie procentowej. Bank A oferuje jej kredyt o zmiennej stopie $\text{WIBOR}+5\%$ lub o stałej 9% . Firma S jest zainteresowana kredytem o stałej stopie procentowej. Bank B oferuje jej kredyt o zmiennej stopie $\text{WIBOR}+3\%$ lub o stałej 10% . Firmy te decydują się zawrzeć między sobą kontrakt swap t.j. wymienić kredytami. Jak powinny wyglądać płatności między firmami, by obie po równo skorzystały na zrobionych w ten sposób oszczędnościach?
2. Firma Z jest zainteresowana kredytem o zmiennej stopie procentowej. Bank A oferuje jej kredyt o zmiennej stopie $\text{WIBOR}+\alpha$ lub o stałej r_A . Firma S jest zainteresowana kredytem o stałej stopie procentowej. Bank B oferuje jej kredyt o zmiennej stopie $\text{WIBOR}+\beta$ lub o stałej r_B . Firmy te decydują się zawrzeć między sobą kontrakt swap t.j. wymienić kredytami.
 - a) Jaki jest warunek opłacalności tej wymiany?
 - b) Jak powinny wyglądać płatności między firmami, by obie po równo skorzystały na zrobionych w ten sposób oszczędnościach?