

Vypočítejte reálnou hodnotu měnového forwardu k 01.01.2010, k 01.02.2010, k 01.03.2010 a k 01.04.2010 když:

01.01.2010 byl spotový kurz 1:10

Úrok. míra na domácí měnu: 0,06

Úrok. míra na cizí měnu: 0,07

01.02.2010 byl spotový kurz 1:12

Úrok. míra na domácí měnu: 0,065

Úrok. míra na cizí měnu: 0,078

01.03.2010 byl spotový kurz 1:9

Úrok. míra na domácí měnu: 0,05

Úrok. míra na cizí měnu: 0,053

01.04.2010 byl spotový kurz 1:13

Splatnost forwardu je 01.04.2010