

I. Vypočítejte reálnou hodnotu 3 měsíčního měnového forwardu od 01.01.2015 do 01.04.2015 a to k 01.01.2015, 01.02.2015, 01.03.2015 a 01.04.2015 z těchto údajů:

1. K 01.01.2015 platilo		
Spotový kurs	-	1:10
Úroková míra na vedlejší měnu	-	0,035
Úroková míra na hlavní měnu	-	0,041
2. K 01.02.2015 platilo		
Spotový kurs	-	1:12
Úroková míra na vedlejší měnu	-	0,030
Úroková míra na hlavní měnu	-	0,038
3. K 01.03.2015 platilo		
Spotový kurs	-	1:11
Úroková míra na vedlejší měnu	-	0,025
Úroková míra na hlavní měnu	-	0,031
4. K 01.02.2015 platilo		
Spotový kurs - 1:9		

II. Vypočítejte reálnou hodnotu úrokového forwardu 2 na 3 k 01.01.2015, 01.02.2015 a 01.03.2015 z těchto údajů:

1. K 01.01.2015 platilo		
Úroková míra na 5 měsíců	-	0,051
Úroková míra na 2 měsíce	-	0,022
2. K 01.02.2015 platilo		
Úroková míra na 4 měsíce	-	0,043
Úroková míra na 2 měsíce	-	0,018
3. K 01.03.2015 platilo		
Úroková míra na 3 měsíce	-	0,039

III. Vypočítejte cenu kupní a prodejní opce z těchto údajů:

S – 150

X – 150

r – 0,03

t – 0,25

σ – 0,10

