

## POT FIDE 2009 - 2010

Slouží jako zadání pro zkoušku

Vypočítejte reálnu hodnotu úrokového forwardu 3 na 6 s nominální hodnotou 1 000 000 CZK k 01.01.2008, k 01.02.2008, k 01.03.2008 a k 01.04.2008:

Sazby platné 01.01.2008:

Úroková sazba na 3 měsíce	3,28%
Úroková sazba na 6 měsíců	4,21%

Sazby platné 01.02.2008:

Úroková sazba na 2 měsíce	3,25%
Úroková sazba na 5 měsíců	4,15%

Sazby platné k 01.03.2008:

Úroková sazba na 1 měsíc	3,01%
Úroková sazba na 4 měsíce	4,02%

Sazby platné k 01.04.2008:

Úroková sazba na 3 měsíce	4,00%
---------------------------	-------