

Vypočítejte reálnou hodnotu měnového forwardu k 01.01.2014, k 01.02.2014, k 01.03.2014 a k 01.04.2014 když:

01.01.2014 byl spotový kurz 1:15

Úrok. míra na domácí měnu: 0,03

Úrok. míra na cizí měnu: 0,06

01.02.2014 byl spotový kurz 1:17

Úrok. míra na domácí měnu: 0,035

Úrok. míra na cizí měnu: 0,062

01.03.2014 byl spotový kurz 1:18

Úrok. míra na domácí měnu: 0,041

Úrok. míra na cizí měnu: 0,061

01.04.2014 byl spotový kurz 1:13

Splatnost forwardu je 01.04.2014