Задача.   
Трейдер купує 300 єврооблігацій, номінальна вартість кожної $1000. Облігації мають 10%-купон, а трейдер сплачує ціну 95%. З дня останньої виплати відсотків минуло 220 днів. Розрахуйте повні витрати трейдера.

300\*1000\*0,95 = 285000

300\*0,1\*1000\*220/360 = 18333,37

285000+18333,37

Задача.  
Скільки потрібно продати євро, щоб купити 1235 доларів. Якщо курс продажу євро 31,25 грн., а курс купівлі долара 27,17 грн.

1235\*27,17 = 33554,95 грн.

33554,94/31,25 = 1073,76 євро

Задача.   
Визначити крос-курси купівлі та продажу EUR/CAD, якщо USD/CAD = 1,0855-1,0963, а EUR/USD = 1,3588 – 1,3689.

Визнаємо крос курс

1,0855\*1,3588 = 1,4749

1,0963\*1,3689 = 1,5007

Крос курс EUR/CAD = 1,4749 – 1,5007

Задача.  
1. Розрахувати форвардний курс через 3 місяці та 5 днів, якщо спот- курс USD/CHF дорівнює 1,5905-1,5915, своп-ставки на 3 місяці 170-165, на 4 місяці - 220-210.