

POT ACP2 2009 - 2010

Slouží jako zadání pro zkoušku

Vypočítejte ke dni vypořádání čistou cenu, AÚV, hrubou cenu, duraci a modifikovanou duraci dluhopisu s následujícími parametry:

Datum emise	01.01.2005
Vypořádání	31.03.2005
První kupon	01.01.2006
Maturita	01.01.2008
Kupon	5,25%
Výnos	3,16%
Nominál	100,00 EUR
Frekvence kupónu	1/1
Úroková základna	30/360 Americká metoda

Poznámka – cenu dluhopisu počítejte podle metody 30/360 USA!2