

Home work 06

Luděk Benada

October 26, 2021

Fixed Income Strategies

Na trhu jsou k dispozici tři obligace: A, B a C. U daných dluhopisu znáte následující údaje:

- A: Nominální hodnota 780.000,00, kupón 5 %, ytm 6,2 %, $T = 4$ roky.
- B: Nominální hodnota 1.250.000,00, kupón 7 %, ytm 6,8 %, $T = 13$ let.
- C: Nominální hodnota 1.250.000,00, kupón 4,5 %, ytm 8,1 %, $T = 27$ let.

Vytvořte Barbell a Bullet portfolia. U každého portfolia dále stanovte hodnotu konvexity a výnosnost (portfoliová ytm).