

HW 06 - Fixed Income Portfolio

Ludek Benada

November 2023

Na trhu jsou k dispozici tři obligace: A, B, C. U daných dluhopisů 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 portfolio. U každého portfolia stanovte výnosnost a convexitu. Které portfolio je výhodnější a proč?