

HW 07 - Fixed Income Portfolio

Ludek Benada

November 2023

Uvažujte druhý příklad ze semináře číslo 7.

Vypočítejte strukturu dluhopisového portfolia založenou na **cenové identitě** pasiv a aktiv, dále nalezněte dluhopisové portfolio ($w_i - C \& D$) v souladu s **durační identitou**.

1. Které z těchto dvou portfolií je výhodnější s ohledem na výnosově-rizikový profil.
2. Jaká rizikovost lepšího portfolia je vůči riziku závazků (*co je rizikovější*)?