

# HW 08 - Fixed Income Portfolio

Ludek Benada

November 2023

Uvažujte druhý příklad ze semináře číslo 8.

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*)?