



Segédanyag

Kötvények értékelése – Duration

1. Feladat

Ön vásárol egy 10.000 forint névértékű, 8%-os névleges kamatozású klasszikus kötvényt, melynek lejáratáig már csak négy év van hátra. A hasonló kockázatú befektetésektől elvárt hozam 6%.

a.) Határozza meg a kötvény elméleti árfolyamát!



b.) Számítsa ki a kötvény átlagos hátralévő futamidejét, valamint értékelje a kapott eredményt!



c.) Mekkora a kötvény módosított duration-je? Értékelje a kapott eredményt!