



KTH Matematik

5B1574 Portföljteori och riskvärdering

Laboration 1

Sista inlämningstid är på föreläsningen klockan 15.00 den 26/9 2006.

Nedanstående uppgifter löses lämpligen med ett kalkylprogram, typ Excel eller också med fördel med Matlab (i vilket det finns datumfunktioner (datenum, datestr m.fl.) och även linjär regression (polyfit)).

1. Lös uppgift 4.4 i Investment Science "(Spot rate project) It is November ...". Tips: Lös uppgift 4.3 först. Det handlar om att konstruera nollkupongare genom att bilda en linjär kombination av olika obligationer.
2. Aktuella räntor på statsobligationer och statsskuldväxlar hittar du på börsens hemsida, www.stockholmsborsen.se. Villkoren för obligationerna och växlarna, t.ex. förfallodagar, kupongräntor och räntebetalningsdagar för dessa finns på Riksgäldskontorets hemsida, www.rgk.se.

Beräkna dagens pris, kurs och upplupen ränta för de noterade statsobligationerna.

En väl genomförd laboration med välpresenterade resultat ger 2 poäng på tentamen.