

# Exercice: Valorisation obligation

P. Hénaff

Version: 24 févr. 2023

```
library(BondValuation)
```

## Veolia 4,625% 3/2017 (FR0011224963)

[www.boerse-frankfurt.de/bond](http://www.boerse-frankfurt.de/bond)

- Date de calcul: 17/3/2021
- Date de règlement/livraison: 18/3/2021
- Date de maturité: 30/3/2027
- Coupon: 4.625
- Convention ACT/365
- Prix (bid): 126.85
- CC: 4.46
- Rendement (bid): 0.1507 %

### Coupon Couru

```
ai <- AccrInt(  
  StartDate=as.Date("2020-03-30"),  
  EndDate=as.Date("2021-03-18"),  
  Coup=4.625,  
  CpY=1,  
  Mat=as.Date("2027-03-30"),  
  DCC=3,  
  RV=100)
```

Coupon couru = 4.473 en 353 jours.

### Rendement

```
res <- BondVal.Yield(  
  CP=126.85,  
  SETT=as.Date("2021-03-18"),  
  Em=as.Date("2017-03-30"),  
  Mat=as.Date("2027-03-30"),
```

```
CpY=1,  
Coup=4.625,  
DCC=3)
```

Rendement actuariel = 0.1507 %