

SOLUZIONE NUMERICA TEMA T3 (del 15-2-2023)
con importi arrotondati al centesimo di Euro e tassi al decimillesimo (basis point)

Esercizio 1(a): 158.68

Esercizio 1(b): 5668.40

| Esercizio 2(a): | j | t_j | R_j | I_j | C_j | Q_j |
|------------------------|-----|-------|----------|---------|-------|--------|
| | 0 | 0 | 4761.90 | 4761.90 | 0 | 100000 |
| | 1 | 1 | 14285.71 | 4285.71 | 10000 | 90000 |
| | 2 | 2 | 13809.52 | 3809.52 | 10000 | 80000 |
| | 3 | 3 | 13333.33 | 3333.33 | 10000 | 70000 |
| | 4 | 4 | 11446 | 1446 | 10000 | 60000 |
| | 5 | 4.5 | 11205 | 1205 | 10000 | 50000 |
| | 6 | 5 | 10964 | 964 | 10000 | 40000 |
| | 7 | 5.5 | 10723 | 723 | 10000 | 30000 |
| | 8 | 6 | 10482 | 482 | 10000 | 20000 |
| | 9 | 6.5 | 10241 | 241 | 10000 | 10000 |
| | 10 | 7 | 10000 | 0 | 10000 | 0 |

Esercizio 2(b): usufrutto 3454.34, nuda proprietà 56051.40

Esercizio 3(a): 153.28

Esercizio 3(b): 4.7307 (= duration all'1-11-2022 – 100/365)

Esercizio 3(c): 4.7143 (= duration al 9-2-2023 – 6/365)

Esercizio 4: Il VAN in 0 = 4.90 (a), 3.16 (b), 4.39 (c). Tutte le operazioni risultano accettabili con
(a) \succ (c) \succ (b)