

HW3

0313405_資財 07_呂京祐

```
C:\Windows\system32\cmd.exe
D:\105Fall\財務工程導論\HomeWork\Financial-Engineering-HW\HW3>python HW3.docx
D:\105Fall\財務工程導論\HomeWork\Financial-Engineering-HW\HW3>python HW3.py
設定期數6期,Face_value=100,Market_yeild=0.08
當債券支付的債息為0,則存續期間為:6.0000
當債券支付的債息為0.08,則存續期間為:4.9927
->債息提高,存續期間下降,因本金佔現值的比例變小
當債券支付的債息為0.01,則存續期間為:5.8139
->債息下降,存續期間上升,因本金佔現值的比例變大
當殖利率變動一個basis point時,價格變動的百分比為:-0.0462287%
D:\105Fall\財務工程導論\HomeWork\Financial-Engineering-HW\HW3>
```