

Gestion de Portefeuille

Exo 8: Valorisation d'une obligation

P. Hénaff

Version: 16 Dec 2024

```
library(BondValuation)
```

1 Données

Veolia 4,625% 3/2017 (FR0011224963)

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 %

2 Questions

- 2.1 Calculer le coupon couru à la date de règlement/livraison avec la fonction `AccInt` de la librairie `BondValuation`.
- 2.2 Vérifier le calcul du rendement actuariel à l'aide de la fonction `BondVal.Yield` de la librairie `BondValuation`.