

# Gestion de Portefeuille

## Exo 8: Valorisation d'une obligation

P. Hénaff

Version: 17 Dec 2024

```
library(BondValuation)
```

## 1 Données

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 %

## 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`.