

Test di Matematica Finanziaria

1) Data la struttura dei tassi

$$i(0, 0.5) = 3,5\% \quad i(0, 1) = 3,75\% \quad i(0, 1.5) = 4,01\% \quad i(0, 2) = 4,3\%$$

il prezzo di uno ZCB emesso tra 1 anno e durata 1 anno e valore nominale 100 è

1. 95,91
2. 98,06
3. 95,37
4. 97,81

2) Considerando un portafoglio di valore $V = 125000$ e duration $D = 2.5$ con struttura di tassi piatta e $\lambda = 5\%$, quanto varia approssimativamente il valore di portafoglio se il tasso diventa 5.1% ?

1. diminuisce di 892.86
2. aumenta di 297.62
3. aumenta di 892.86
4. diminuisce di 297.62

3) Dato un BTP con scadenza 4 anni, cedola semestrale, $TAN = 6\%$, determinare la sua duration adottando una struttura dei tassi piatta con $\lambda = 6\%$

1. 2.79
2. 1.91
3. 4.39
4. 3.61