

ESERCIZIO 3

(Questo esercizio è riservato agli studenti iscritti al terzo anno o fuoricorso)

Il Signor Rossi, ha acquistato oggi, al prezzo di **34.000 €** un titolo obbligazionario **T1** che garantisce: **12.000 €** fra **1,5 anni** e **25.000 €** fra **3 anni**. Sul mercato finanziario sono disponibili anche i seguenti titoli:

- **T2**: TCN con valore facciale **100 €** e scadenza **1 semestre**;
- **T3**: TCN con valore facciale **200 €** e scadenza **3,25 anni**.

Sul mercato finanziario vige un tasso d'interesse pari al TIR del titolo **T1**.

1. Indicare il numero di quote di **T2** e **T3** affinché il portafoglio così costruito abbia prezzo **15000 €** e duration **3 anni**.

2. Stabilire il numero di quote del titolo **T1** da aggiungere al portafoglio del punto 1. in modo da ottenere un nuovo portafoglio con duration **8 quadrimestri**.

