

MATEMATICA FINANZIARIA Foglio 6 a.a. 2007-2008

1) E' data la tabella tassi swap (IRS) in cui i tassi variabili si intendono su 6M e fissi sul periodo indicato

1	3,91		9	3,98
2	3,93		10	4
3	3,94		11	4,02
4	3,94		12	4,04
5	3,94		15	4,08
6	3,95		20	4,12
7	3,95		25	4,12
8	3,97		30	4,11

a) Calcolare la curva tassi interpolando opportunamente per i periodi mancanti

b) Stabilire il valore corretto dei titoli

i) 10 anni e cedola semestrale del 5 %

ii) 5 anni e cedola semestrale del 3%

c) Calcolare i nuovi tassi swap se la curva tassi si alza o si abbassa (in ogni punto) di 0.25 %

2) Effettuare lo stesso conto utilizzando la tabella A)

e separatamente i due tassi (variabili) Euribor 365/6m Euribor 360/6m

3) Provare a calcolare nello stesso modo la curva tassi nel periodo 6m-5a

utilizzando i dati della tabella B) al 31/10/2006 ,31/1/2007, 30/4/2007 .31/10/2007

Quali variazioni si possono osservare?