

Vermögen Alpha

Duration

Seite: 2

Datum...: 14.Okt.2003

per 31.Mai.2003 YTM PF: 2.2231

Zeit.....: 13:54

Bezeichnung

Währung

%-Total

D-Macauly

Dmod

Duration nach Laufzeiten

Die Duration weist sowohl die Macauley Duration als auch die Modified Duration aus.

Eine Zusammenfassung nach Laufzeiten kann frei gewählt werden.

0 - 1	10.80	0.3770	0.3741
1 - 2	10.80	1.6075	1.5846
2 - 3	9.77	2.3744	2.3266
3 - 4	10.54	3.1459	3.0830
4 - 5	21.59	4.1330	4.0310
5 - 6	15.66	4.7211	4.6090
6 - 7	10.94	5.6054	5.4498
7 - 8	6.64	6.3274	6.1665
8 - 9	1.49	7.5062	7.3307
9 - 10	1.60	8.0471	7.8600
12 - 13	0.15	9.8108	9.5051
-			
0 - 3	31.38	1.4227	1.3989
3 - 5	32.13	3.8091	3.7200
5 - 7	26.60	5.0849	4.9549
7 - 10	9.73	6.7910	6.6235
10 - 99	0.15	9.8108	9.5051