



calculatoratoz.com



unitsconverters.com

Доходность облигаций Формулы

Калькуляторы!

Примеры!

Преобразования!

Закладка calculatoratoz.com, unitsconverters.com

Самый широкий охват калькуляторов и рост - **30 000+** калькуляторов!

Расчет с разными единицами измерения для каждой переменной -

Встроенное преобразование единиц измерения!

Самая широкая коллекция измерений и единиц измерения - **250+**
измерений!



Не стесняйтесь **ПОДЕЛИТЬСЯ** этим документом с друзьями!

[Пожалуйста, оставьте свой отзыв здесь...](#)



Список 10 Доходность облигаций Формулы

Доходность облигаций

1) Банковская дисконтная доходность

$$fx \quad BDY = \left(\frac{D}{FV} \right) \cdot \left(\frac{360}{DTM} \right) \cdot 100$$

[Открыть калькулятор !\[\]\(cbe2492b119e39e02a1dab2af4a4b296_img.jpg\)](#)

$$ex \quad 2.25 = \left(\frac{0.15}{800} \right) \cdot \left(\frac{360}{3} \right) \cdot 100$$

2) Доходность денежного рынка

$$fx \quad MMY = HPY \cdot \frac{360}{mt}$$

[Открыть калькулятор !\[\]\(870f5d5e9c0d57485634be3ecf52f3ca_img.jpg\)](#)

$$ex \quad 17 = 8.5 \cdot \frac{360}{180}$$


3) Доходность до отзыва облигации, подлежащей выкупу

$$fx \quad YTC = \left(\frac{CP + \frac{C-CBP}{n_y}}{\frac{C+CBP}{2}} \right)$$

[Открыть калькулятор !\[\]\(7d1d6890825e83a6a4a51febe2dcc7f3_img.jpg\)](#)

$$ex \quad 0.252346 = \left(\frac{20 + \frac{1220-150}{7}}{\frac{1220+150}{2}} \right)$$



4) Доходность за период владения 

$$fx \quad HPY = \frac{Int.p + FV - P}{FV}$$

Открыть калькулятор 

$$ex \quad 8.4 = \frac{6000 + 800 - 80}{800}$$

5) Доходность к погашению 

$$fx \quad YTM = \frac{CP + \left(\frac{FV - Price}{Yrs} \right)}{\frac{FV + Price}{2}}$$

Открыть калькулятор 

$$ex \quad 0.015686 = \frac{20 + \left(\frac{800 - 900}{15} \right)}{\frac{800 + 900}{2}}$$

6) Оценка купонной облигации 

fx

Открыть калькулятор 

$$CB = C_A \cdot \left(\frac{1 - (1 + YTM)^{-nPYr}}{YTM} \right) + \left(\frac{P_{vm}}{(1 + YTM)^{nPYr}} \right)$$

$$ex \quad 976.7569 = 0.05 \cdot \left(\frac{1 - (1 + 0.01)^{-12}}{0.01} \right) + \left(\frac{1100}{(1 + 0.01)^{12}} \right)$$



7) Приближение выпуклости облигаций 

$$fx \quad BC_A = \frac{P_+ + P_- - 2 \cdot (P_0)}{2 \cdot P_0 \cdot (\Delta_y)^2}$$

Открыть калькулятор 

$$ex \quad 13750 = \frac{35 + 30 - 2 \cdot (5)}{2 \cdot 5 \cdot (0.02)^2}$$

8) Стоимость облигации с нулевым купоном 

$$fx \quad V = \frac{FV}{\left(1 + \frac{RoR}{100}\right)^T}$$

Открыть калькулятор 

$$ex \quad 519.6647 = \frac{800}{\left(1 + \frac{4}{100}\right)^{11}}$$

9) Текущий доход по облигациям 

$$fx \quad CBY = \frac{CP}{CBP}$$

Открыть калькулятор 

$$ex \quad 0.133333 = \frac{20}{150}$$



10) Эффективная доходность облигаций с нулевым купоном 

$$\text{fx } \text{ZCB Yield} = \left(\frac{\text{FV}}{\text{PV}} \right)^{\frac{1}{n}} - 1$$

[Открыть калькулятор !\[\]\(d3fb9f94af8b26d1c844efa9a98805b0_img.jpg\)](#)

$$\text{ex } 8.42809 = \left(\frac{800}{9} \right)^{\frac{1}{2}} - 1$$



Используемые переменные

- **BC_A** Приближение выпуклости облигаций
- **BDY** Банковская дисконтная доходность
- **C** Теоретическая цена опциона колл
- **C_A** Годовая ставка купона
- **CB** Купонная облигация
- **CBP** Текущая цена облигаций
- **CBY** Текущая доходность облигаций
- **CP** Оплата купона
- **D** Скидка
- **DTM** Дней до зрелости
- **FV** Номинальная стоимость
- **HPY** Доходность за период владения
- **$Int.p$** Выплаченные проценты
- **MMY** Доходность денежного рынка
- **mt** Время до совершеннолетия
- **n** Количество периодов
- **n_{PYr}** Количество платежей в год
- **n_y** Количество лет для отслеживания роста
- **P** Цена
- **P_-** Цена облигации при уменьшении
- **P_+** Цена облигации при увеличении
- **P_0** Стоимость облигации
- **P_{vm}** Номинальная стоимость при погашении




- **Price** Цена
- **PV** Приведенная стоимость
- **RoR** Норма прибыли
- **T** Время взросления
- **V** Стоимость облигации с нулевым купоном
- **Yrs** Годы до зрелости
- **YTC** Уступка коллу
- **YTM** Доходность к погашению (YTM)
- **ZCB Yield** Эффективная доходность облигаций с нулевым купоном
- Δ_y Изменение процентной ставки



Константы, функции, используемые измерения



Проверьте другие списки формул

- [Доходность облигаций Формулы](#) 
- [Калькулятор процентных ставок Формулы](#) 

Не стесняйтесь **ПОДЕЛИТЬСЯ** этим документом с друзьями!

PDF Доступен в

[English](#) [Spanish](#) [French](#) [German](#) [Russian](#) [Italian](#) [Portuguese](#) [Polish](#) [Dutch](#)

4/8/2024 | 3:18:44 PM UTC

[Пожалуйста, оставьте свой отзыв здесь...](#)

