

Ważny Bond Yield Formuły PDF



Formuły Przykłady z Jednostkami

Lista 10 Ważny Bond Yield Formuły

1) Aktualny Bond Yield Formuła ↻

Formuła

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

Przykład

$$0.1333 = \frac{20}{150}$$

Oceń formułę ↻

2) Przybliżenie wypukłości wiązania Formuła ↻

Formuła

$$BC_A = \frac{P_+ + P_- - 2 \cdot (P_0)}{2 \cdot P_0 \cdot (\Delta y)^2}$$

Przykład

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

Oceń formułę ↻

3) Rentowność okresu utrzymywania Formuła ↻

Formuła

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

Przykład

$$8.4 = \frac{6000 + 800 - 800}{800}$$

Oceń formułę ↻

4) Rentowność rynku pieniężnego Formuła ↻

Formuła

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

Przykład

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

Oceń formułę ↻

5) Stopa dyskonta banku Formuła ↻

Formuła

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

Przykład

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

Oceń formułę ↻

6) Wartość obligacji zerokuponowych Formuła ↻

Formuła

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

Przykład

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

Oceń formułę ↻



7) Wycena obligacji kuponowych Formuła

Oceń formułę

Formuła

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

Przykład

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

8) Wydajność do dojrzałości Formuła

Oceń formułę

Formuła

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

Przykład

$$0.0157 = \frac{20 + \left(\frac{800 - 900}{15} \right)}{\frac{800 + 900}{2}}$$

9) Yield to call w przypadku obligacji z możliwością wykupu Formuła

Oceń formułę

Formuła

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

Przykład

$$0.2523 = \left(\frac{20 + \frac{1220 - 150}{7}}{\frac{1220 + 150}{2}} \right)$$

10) Zerowa Obligacja kuponowa Efektywna rentowność Formuła

Oceń formułę

Formuła

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

Przykład

$$8.4281 = \left(\frac{800}{9} \right)^{\frac{1}{2}} - 1$$



Zmienne użyte na liście Bond Yield Formuły powyżej

- **BC_A** Przybliżenie wypukłości wiązania
- **BDY** Stopa dyskonta banku
- **C** Teoretyczna cena opcji kupna
- **C_A** Roczna stawka kuponu
- **CB** Bon kuponowy
- **CBP** Aktualna cena obligacji
- **CBY** Aktualna rentowność obligacji
- **CP** Płatność bonami
- **D** Rabat
- **DTM** Dni do dojrzałości
- **FV** Wartość nominalna
- **HPY** Rentowność okresu utrzymywania
- **Int.p** Wypłacane odsetki
- **MMY** Rentowność rynku pieniężnego
- **mt** Czas do dojrzałości
- **n** Liczba okresów
- **n_{PYr}** Liczba płatności rocznie
- **n_y** Liczba lat śledzenia wzrostu
- **P** Cena zakupu
- **P_-** Cena obligacji po obniżeniu
- **P_+** Cena obligacji po zwiększeniu
- **P_0** Wartość obligacji
- **P_{vm}** Wartość nominalna w momencie zapadalności
- **Price** Cena
- **PV** Obecna wartość
- **RoR** Stopa zwrotu
- **T** Czas na Dojrzałość
- **V** Wartość obligacji zerokuponowych
- **Yrs** Lata do dojrzałości
- **YTC** Poddaj się wezwaniu
- **YTM** Rentowność do terminu zapadalności (YTM)
- **ZCB Yield** Efektywna stopa zwrotu z obligacji zerokuponowych
- **Δ_y** Zmiana stopy procentowej



Pobierz inne pliki PDF z kategorii Ważny Inwestycja

- [Ważny Bond Yield Formuły](#) 
- [Ważny Zarządzanie rynkiem Forex Formuły](#) 

Wypróbuj nasze unikalne kalkulatory wizualne

-  [Procentowy zliczby](#) 
-  [Kalkulator NWW](#) 
-  [Ułamek prosty](#) 

UDOSTĘPNIJ ten plik PDF komuś, kto go potrzebuje!

Ten plik PDF można pobrać w tych językach

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

7/8/2024 | 6:56:51 AM UTC

