

Belangrijk Bond yield Formules Pdf



Formules Voorbeelden met eenheden

Lijst van 10 Belangrijk Bond yield Formules

1) Bankkortingsrendement Formule ↗

Formule

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

Voorbeeld

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

Evalueer de formule ↗

2) Benadering van convexiteit van obligaties Formule ↗

Formule

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

Voorbeeld

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

Evalueer de formule ↗

3) Geldmarktrendement Formule ↗

Formule

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

Voorbeeld

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

Evalueer de formule ↗

4) Huidige obligatie opbrengst Formule ↗

Formule

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

Voorbeeld

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

Evalueer de formule ↗

5) Nul Coupon Bond Effectief rendement Formule ↗

Formule

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

Voorbeeld

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

Evalueer de formule ↗

6) Nul Coupon obligatie Waarde Formule ↗

Formule

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

Voorbeeld

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

Evalueer de formule ↗



7) Opbrengst naar Looptijd Formule

Formule

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

Voorbeeld

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

Evalueer de formule 

8) Opbrengst van de holdingperiode Formule

Formule

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

Voorbeeld

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

Evalueer de formule 

9) Opbrengst voor call voor opvraagbare obligaties Formule

Formule

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

Voorbeeld

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

Evalueer de formule 

10) Waardering van couponobligaties Formule

Formule

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

Evalueer de formule 

Voorbeeld

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



Variabelen gebruikt in lijst van Bond yield Formules hierboven

- **BC_A** Benadering van convexiteit van obligaties
- **BDY** Bankkortingsrendement
- **C** Theoretische prijs van calloptie
- **C_A** Jaarlijkse couponrente
- **CB** Couponobligatie
- **CBP** Huidige obligatieprijs
- **CBY** Huidig obligatierendement
- **CP** Coupon betaling
- **D** Korting
- **DTM** Dagen tot volwassenheid
- **FV** Nominale waarde
- **HPY** Opbrengst van de holdingperiode
- **$Int.p$** Betaalde rente
- **MMY** Geldmarktrendement
- **mt** Tijd tot volwassenheid
- **n** Aantal perioden
- **n_{PYr}** Aantal betalingen per jaar
- **n_y** Aantal jaren om de groei te volgen
- **P** Aankoopprijs
- **P_-** Obligatieprijs wanneer verlaagd
- **P_+** Obligatieprijs indien verhoogd
- **P_0** Obligatiewaarde
- **P_{vm}** Nominale waarde op de vervaldag
- **$Price$** Prijs
- **PV** Huidige waarde
- **RoR** Rendement
- **T** Tijd tot volwassenheid
- **V** Waarde van nulcouponobligaties
- **Yrs** Jaren tot volwassenheid
- **YTC** Opgave aan oproep
- **YTM** Opbrengst naar volwassenheid (YTM)
- **ZCB Yield** Effectief rendement op nulcouponobligaties
- **Δ_y** Verandering in rentetarief



Download andere Belangrijk Investering pdf's

- [Belangrijk Bond yield Formules](#) 
- [Belangrijk Forex-beheer Formules](#) 

Probeer onze unieke visuele rekenmachines

-  [Percentage van nummer](#) 
-  [KGV rekenmachine](#) 
-  [Simpele fractie](#) 

DEEL deze PDF met iemand die hem nodig heeft!

Deze PDF kan in deze talen worden gedownload

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

7/8/2024 | 6:56:55 AM UTC

