

Importante Rendimento obbligazionario Formule PDF



**Formule
Esempi
con unità**

Lista di 10 Importante Rendimento obbligazionario Formule

1) Approssimazione della convessità dei legami Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula

2) Rendimento alla scadenza Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula

3) Rendimento da richiedere per un'obbligazione richiamabile Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula

4) Rendimento da sconto bancario Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula

5) Rendimento del mercato monetario Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula



6) Rendimento del periodo di detenzione Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

7) Rendimento effettivo della cedola zero Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

8) Rendimento obbligazionario corrente Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

9) Valore dell'obbligazione zero Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

10) Valutazione delle obbligazioni con cedola Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 



Variabili utilizzate nell'elenco di Rendimento obbligazionario Formule sopra

- **BC_A** Approssimazione della convessità dei legami
- **BDY** Rendimento da sconto bancario
- **C** Prezzo teorico dell'opzione call
- **C_A** Tasso della cedola annuale
- **CB** Cedola obbligazionaria
- **CBP** Prezzo attuale delle obbligazioni
- **CBY** Rendimento obbligazionario attuale
- **CP** Pagamento del buono
- **D** Sconto
- **DTM** Giorni alla maturità
- **FV** Valore nominale
- **HPY** Rendimento del periodo di detenzione
- **Int.p** Interessi pagati
- **MMY** Rendimento del mercato monetario
- **mt** Tempo fino alla maturità
- **n** Numero di periodi
- **n_{PYr}** Numero di pagamenti all'anno
- **n_y** Numero di anni per monitorare la crescita
- **P** Prezzo d'acquisto
- **P_-** Prezzo dell'obbligazione quando viene decrementato
- **P_+** Prezzo dell'obbligazione quando incrementato
- **P_0** Valore obbligazionario
- **P_{vm}** Valore nominale alla scadenza
- **Price** Prezzo
- **PV** Valore attuale
- **RoR** Tasso di rendimento
- **T** Tempo alla maturità
- **V** Valore delle obbligazioni a cedola zero
- **Yrs** Anni alla maturità
- **YTC** Resa alla chiamata
- **YTM** Rendimento alla scadenza (YTM)
- **ZCB Yield** Rendimento effettivo delle obbligazioni a cedola zero
- **Δ_y** Variazione del tasso di interesse



Scarica altri PDF Importante Investimento

- **Importante Rendimento obbligazionario Formule** 
- **Importante Gestione del Forex Formule** 

Prova i nostri calcolatori visivi unici

-  **Percentuale del numero** 
-  **Calcolatore mcm** 
-  **Frazione semplice** 

Per favore CONDIVIDI questo PDF con qualcuno che ne ha bisogno!

Questo PDF può essere scaricato in queste lingue

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

7/8/2024 | 6:56:44 AM UTC

