

**РЫНОК ЦЕННЫХ БУМАГ Самостоятельная работа студентов №5
Облигации. Определение доходности облигаций. Расчет текущей
стоимости облигации методом дисконтирования денежных потоков**

СРС №5 (вариант №1)

1. Определите, какую цену должен заплатить покупатель за облигацию 26.05.2003.г, если известно, что курсовая стоимость – 95%. Номинал –2000 руб., дата выплаты купона –19.07.2003г, купонный период 182 дня, ставка купонного дохода – 20% годовых.
2. Рассчитайте рыночную стоимость облигации номиналом 20 000 руб. с выплатой ежегодного купонного 12% дохода и сроком погашения через 3 года, если ставка процента по вкладу в банке составляет 14% годовых?
3. Рассчитайте рыночную стоимость облигации номиналом 18 000 руб. с выплатой ежегодного купонного 11% дохода и сроком погашения через 3 года, если ставка процента по вкладу в банке составляет 13% годовых?
4. Определите купонную и текущую доходность облигации, если рыночная цена составляет 800 рублей, сумма выплачиваемых за год процентов (купонного дохода) 75 рублей, номинальная стоимость облигации – 850 рублей.
5. Определите полную доходность облигации, если известны следующие показатели: облигация приобретена с дисконтом 20 рублей, продана с дисконтом 6 рублей, купонный доход 30% годовых, номинал – 1200 рублей, купонный период 365 дней, число лет владения облигацией 3 года.
6. Необходимо принять решение о том, имеет ли смысл покупать облигации номиналом 10000 руб., по цене 9500 руб. с выплатной ежегодного купонного 10-процентного дохода и сроком погашения через 3 года, если ставка процента в банке по вкладу сроком на 3 года составляет 11% годовых.
7. Определите стоимость продажи бескупонной дисконтной облигации при депозитной ставке банка 14% годовых, номинал 1200 руб., если срок до погашения – 2 года.

РЫНОК ЦЕННЫХ БУМАГ Облигации. Определение доходности облигаций. Расчет текущей стоимости облигации методом дисконтирования денежных потоков
СРС №5 (вариант №2)

1. Определите, какую цену должен заплатить покупатель за облигацию 26.05.2003.г, если известно, что курсовая стоимость – 93%. Номинал –1500 руб., дата выплаты купона –19.07.2003г, купонный период 182 дня, ставка купонного дохода – 25% годовых.
2. Рассчитайте рыночную стоимость облигации номиналом 19000 руб. с выплатой ежегодного купонного 11% дохода и сроком погашения через 3 года, если ставка процента по вкладу в банке составляет 13% годовых?
3. Рассчитайте рыночную стоимость облигации номиналом 20000 руб. с выплатой ежегодного купонного 12% дохода и сроком погашения через 3 года, если ставка процента по вкладу в банке составляет 14% годовых?
4. Определите купонную и текущую доходность облигации, если рыночная цена составляет 900 рублей, сумма выплачиваемых за год процентов (купонного дохода) 85 рублей, номинальная стоимость облигации – 960 рублей.
5. Определите полную доходность облигации, если известны следующие показатели: облигация приобретена с дисконтом 22 рублей, продана с дисконтом 8 рублей, купонный доход 25% годовых, номинал – 1400 рублей, купонный период 365 дней, число лет владения облигацией 3 года.
6. Необходимо принять решение о том, имеет ли смысл покупать облигации номиналом 10000 руб., по цене 9300 руб. с выплатной ежегодного купонного 12-процентного дохода и сроком погашения через 3 года, если ставка процента в банке по вкладу сроком на 3 года составляет 13% годовых.
7. Определите стоимость продажи бескупонной дисконтной облигации при депозитной ставке банка 13% годовых, номинал 1400 руб., если срок до погашения – 2 года.

РЫНОК ЦЕННЫХ БУМАГ Облигации. Определение доходности облигаций. Расчет текущей стоимости облигации методом дисконтирования денежных потоков

СРС №5 (вариант №3)

1. Определите, какую цену должен заплатить покупатель за облигацию 26.05.2003.г, если известно, что курсовая стоимость – 92,5%. Номинал –1200 руб., дата выплаты купона –19.07.2003г, купонный период 182 дня, ставка купонного дохода – 20% годовых.
2. Рассчитайте рыночную стоимость облигации номиналом 1600 руб. с выплатой ежегодного купонного 10% дохода и сроком погашения через 3 года, если ставка процента по вкладу в банке составляет 14% годовых?
3. Рассчитайте рыночную стоимость облигации номиналом 1900 руб. с выплатой ежегодного купонного 10% дохода и сроком погашения через 3 года, если ставка процента по вкладу в банке составляет 13% годовых?
4. Определите купонную и текущую доходность облигации, если рыночная цена составляет 750 рублей, сумма выплачиваемых за год процентов (купонного дохода) 70 рублей, номинальная стоимость облигации – 800 рублей.
5. Определите полную доходность облигации, если известны следующие показатели: облигация приобретена с дисконтом 18 рублей, продана с дисконтом 11 рублей, купонный доход 22% годовых, номинал – 1300 рублей, купонный период 365 дней, число лет владения облигацией 3 года.
6. Необходимо принять решение о том, имеет ли смысл покупать облигации номиналом 12000 руб., по цене 11000 руб. с выплатной ежегодного купонного 11-процентного дохода и сроком погашения через 3 года, если ставка процента в банке по вкладу сроком на 3 года составляет 14% годовых.
7. Определите стоимость продажи бескупонной дисконтной облигации при депозитной ставке банка 12% годовых, номинал 1100 руб., если срок до погашения – 2 года.

РЫНОК ЦЕННЫХ БУМАГ Облигации. Определение доходности облигаций. Расчет текущей стоимости облигации методом дисконтирования денежных потоков
СРС №5 (вариант №4)

1. Определите, какую цену должен заплатить покупатель за облигацию 26.04.2003г, если известно, что курсовая стоимость – 91,5%. Номинал –1000 руб., дата выплаты купона –19.07.2003г, купонный период 182 дня, ставка купонного дохода – 15% годовых.
2. Рассчитайте рыночную стоимость облигации номиналом 18 000 руб. с выплатой ежегодного купонного 11% дохода и сроком погашения через 3 года, если ставка процента по вкладу в банке составляет 12% годовых?
3. Рассчитайте рыночную стоимость облигации номиналом 17 000 руб. с выплатой ежегодного купонного 12% дохода и сроком погашения через 3 года, если ставка процента по вкладу в банке составляет 14% годовых?
4. Определите купонную и текущую доходность облигации, если рыночная цена составляет 749 рублей, сумма выплачиваемых за год процентов (купонного дохода) 65 рублей, номинальная стоимость облигации – 800 рублей.
5. Определите полную доходность облигации, если известны следующие показатели: облигация приобретена с дисконтом 15,75 рублей, продана с дисконтом 5,25 рублей, купонный доход 20% годовых, номинал – 1000 рублей, купонный период 365 дней, число лет владения облигацией 3 года.
6. Необходимо принять решение о том, имеет ли смысл покупать облигации номиналом 10000 руб., по цене 9500 руб. с выплатной ежегодного купонного 8-процентного дохода и сроком погашения через 3 года, если ставка процента в банке по вкладу сроком на 3 года составляет 10% годовых.
7. Определите стоимость продажи бескупонной дисконтной облигации при депозитной ставке банка 12% годовых, номинал 1000 руб., если срок до погашения – 2 года.