**Вариант 9**

1. Рассчитайте доходность к погашению облигации номинальной стоимостью 1000 руб, при цене размещения 83% от номинала, если купонный доход составляет 5% годовых, купонный период составляет 6 месяцев, при предположении, что весь купонный доход выплачивается в момент погашения вместе с номинальной стоимостью, а срок обращения составляет 2 года.

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.Номинал облигации с фиксированным купоном равен 500 руб., годовой купонный доход составляет 140 руб., срок облигации 6 лет. По какой максимальной цене в рублях следует приобрести облигацию, чтобы простая доходность составила не менее 12,83%?

4. До погашения бескупонной дисконтной облигации осталось 3 месяца. Найти рыночный курс облигации, если ставка дисконтирования выбрана 15,3%.

5. Из двух облигаций с одинаковой купонной процентной ставкой и одинаковым сроком чувствительность к колебаниям доходности больше у той, у которой:

A. Больше доходность к погашению

B. Меньше доходность к погашению

C. Зависит от ставки дисконтирования

D. Зависит от временной структуры процентных ставок

*Дать развернутый ответ*

6.Курс бескупонной облигации равен 63,2. Срок облигации (время до погашения) 3 года 8 месяцев. Каким будет курс облигации, если доходность облигации увеличится на 40 пунктов (1 пункт доходности равен 0,01%)? База: 365 дней в году.

7.Облигация с фиксированным купоном, равным 20% от номинала, куплена по курсу 93,05. Срок облигации 5 лет. Выплаты купонов происходят один раз в год. Найти дюрацию облигации в годах.

8.Чистая цена облигации с фиксированным купоном равна 256,34 рублей. Выплаты купонов производятся 4 раза в год, годовой купонный доход равен 20 рублей, купонный период 91 день. Какую полную цену в рублях должен заплатить покупатель облигации (не считая комиссионных выплат брокеру), если со времени выплаты последнего купона прошло 34 дня?