

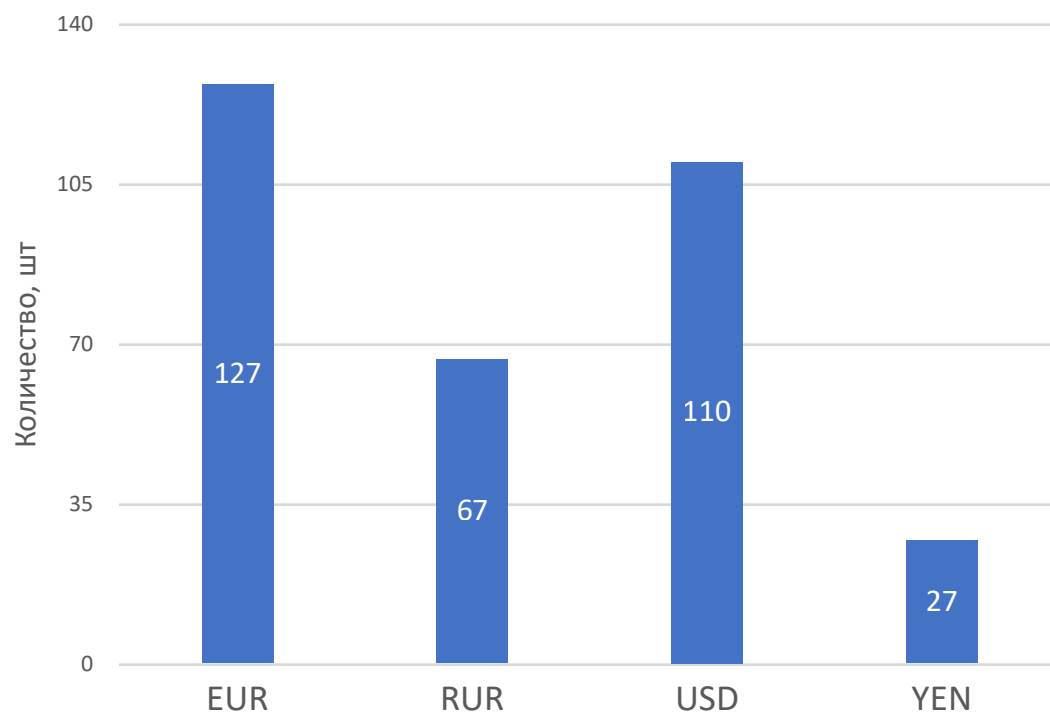
Анализ облигаций SkyFinance

Содержание

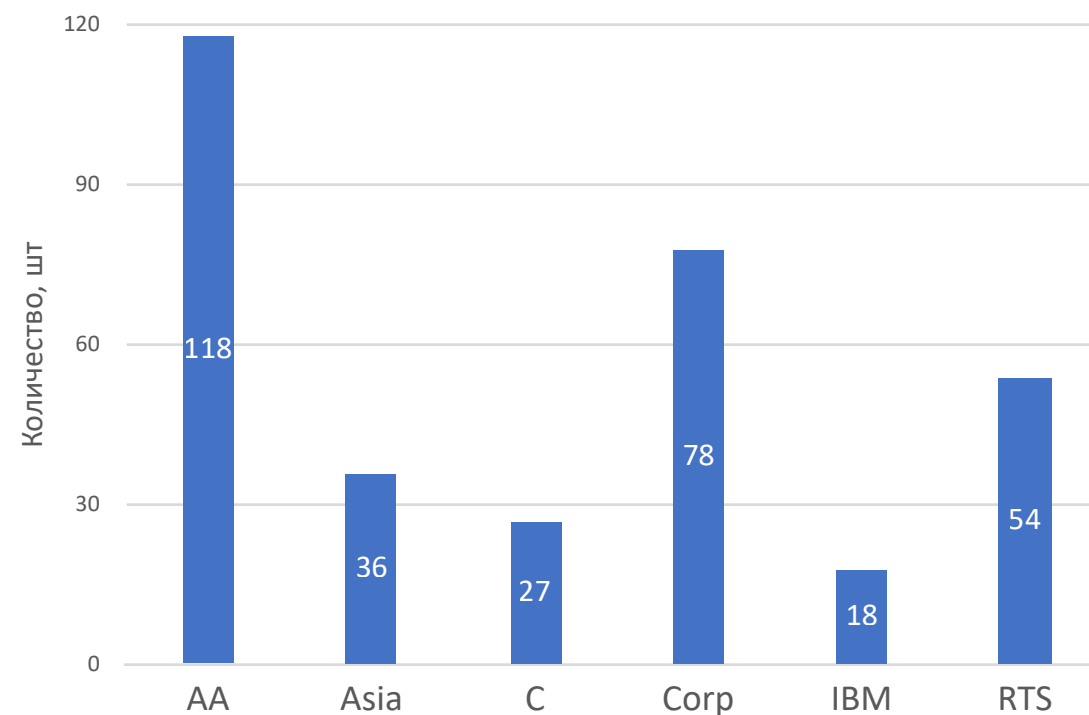
- Распределение облигаций по типам и валютам
- Оценки рисков
- Прогнозы
- Калькулятор доходности
- Выводы

Распределение количества облигаций

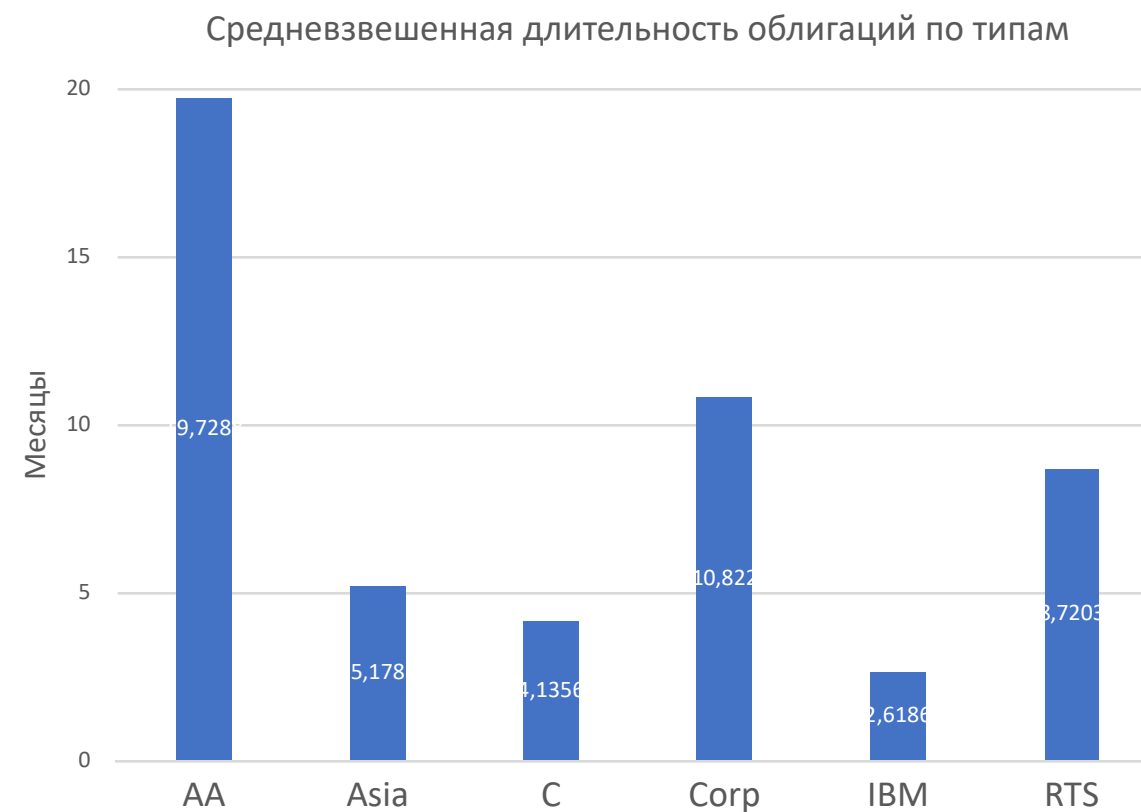
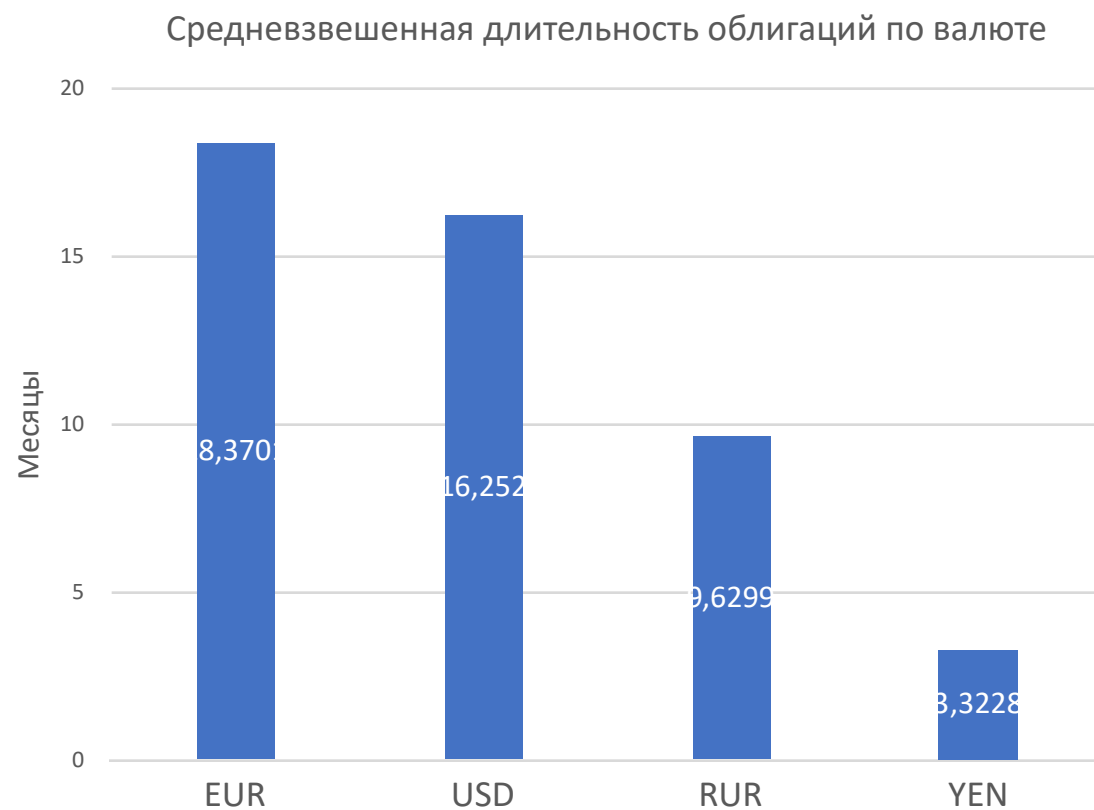
Распределение облигаций по валюте



Распределение облигаций по типам

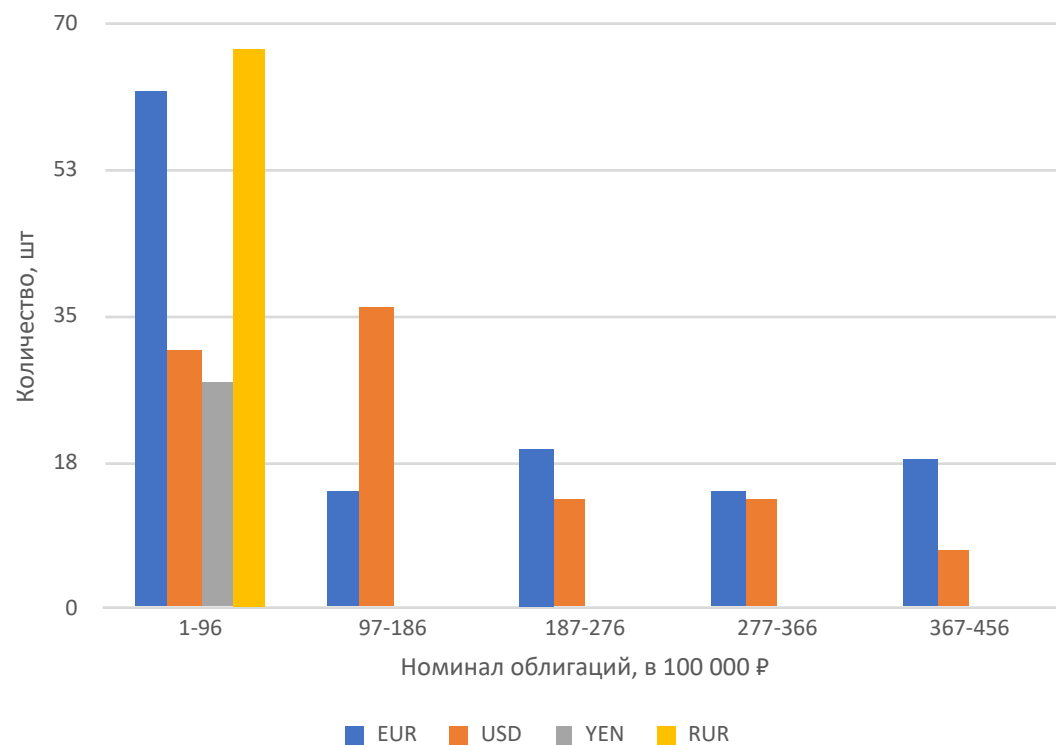


Средневзвешенная длительность срока облигаций

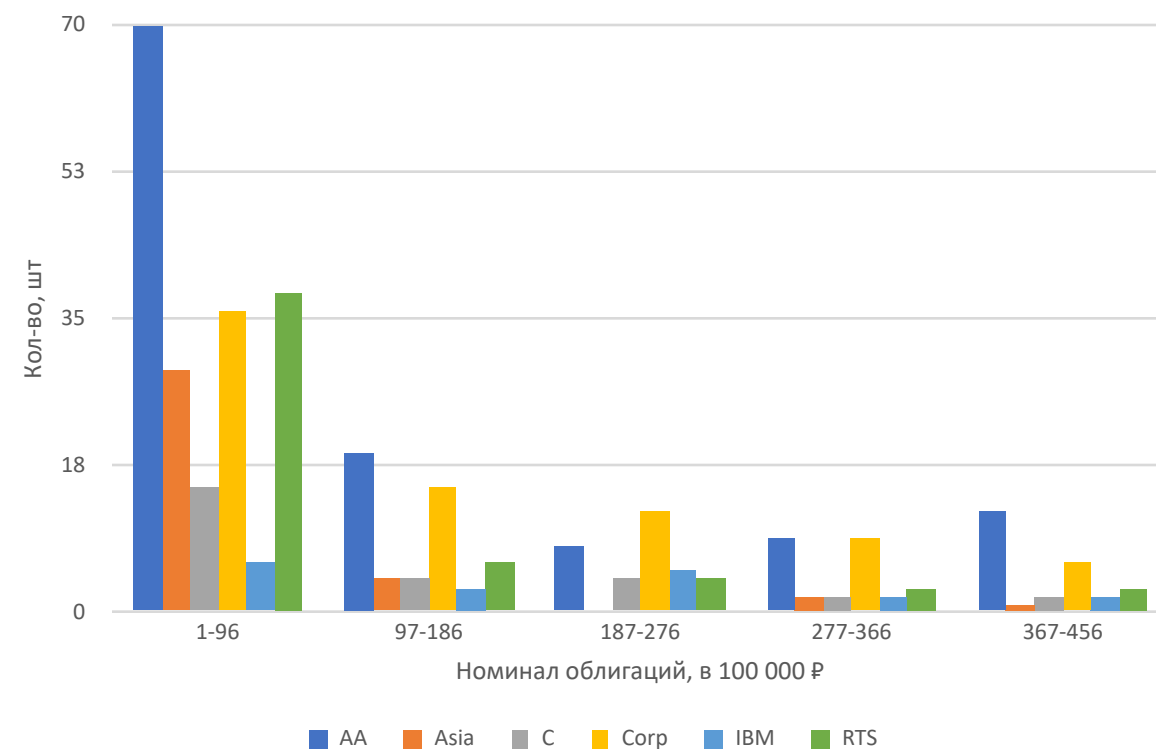


Распределение номиналов облигаций

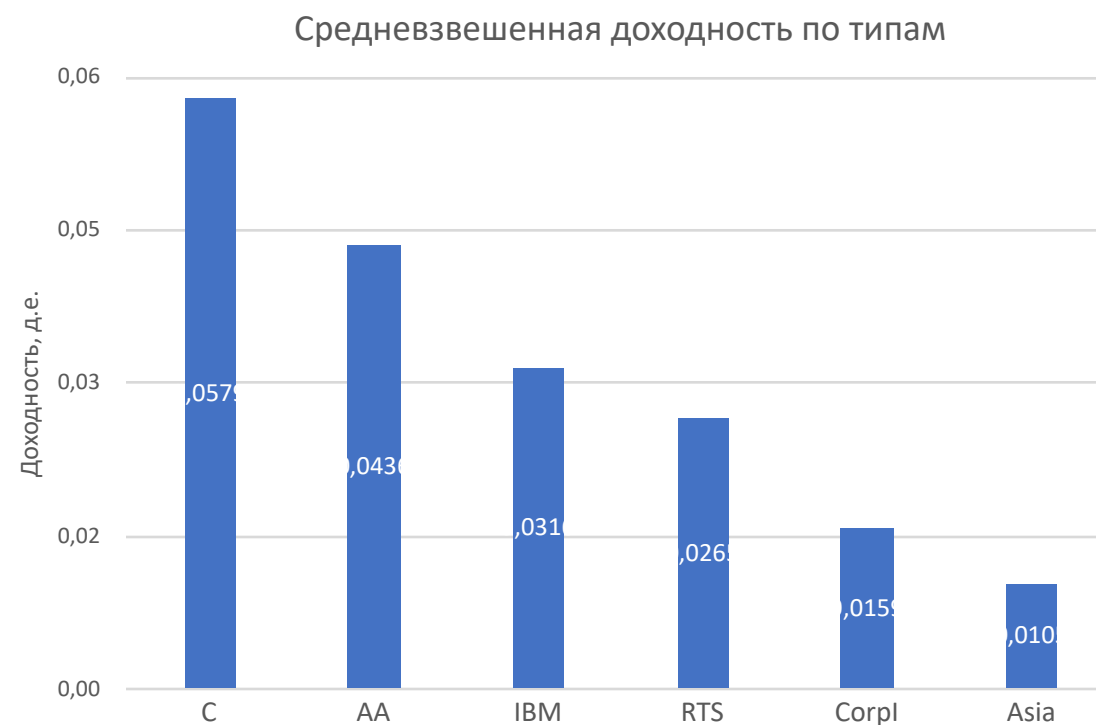
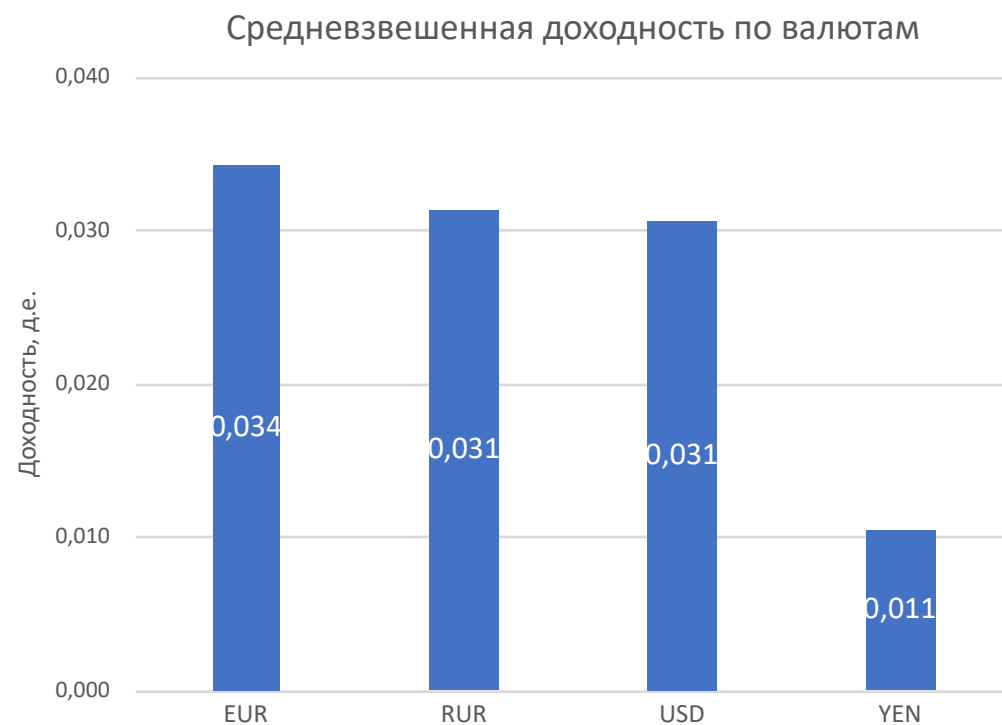
Распределение номиналов облигаций по валютам



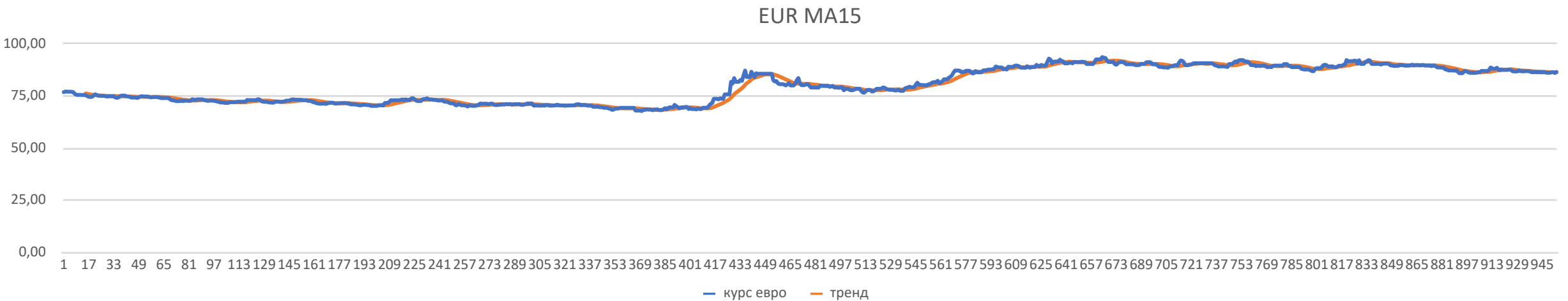
Распределение номиналов облигаций по типам



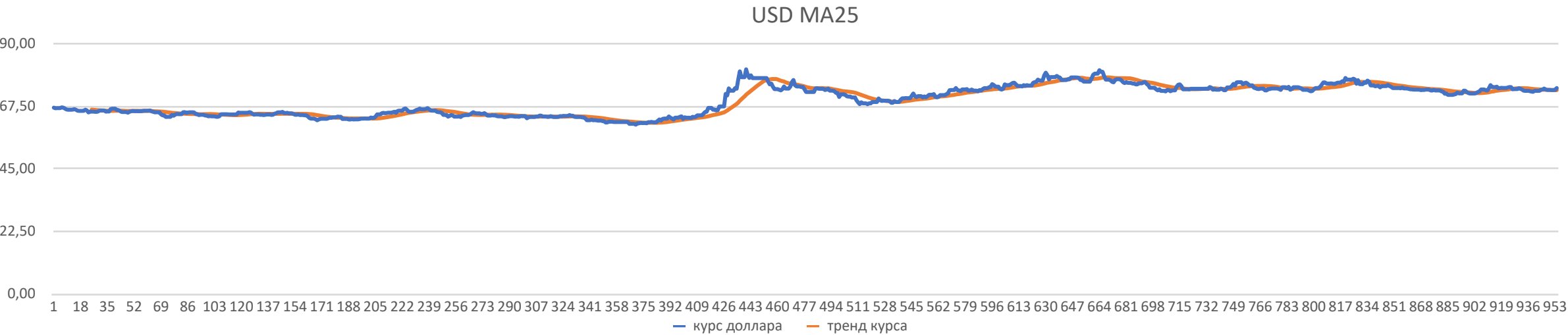
Распределение средневзвешенной доходности облигаций



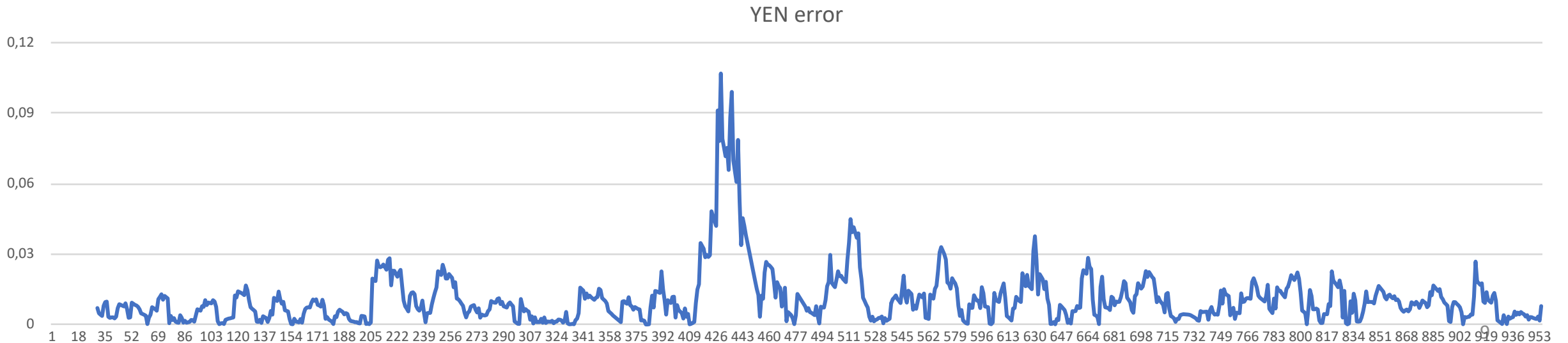
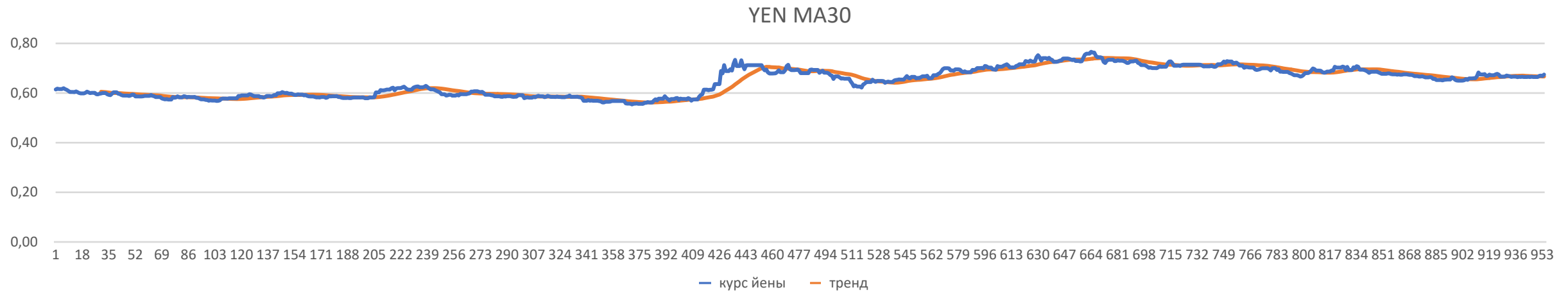
Рискованность облигаций, евро



Рискованность облигаций, доллар



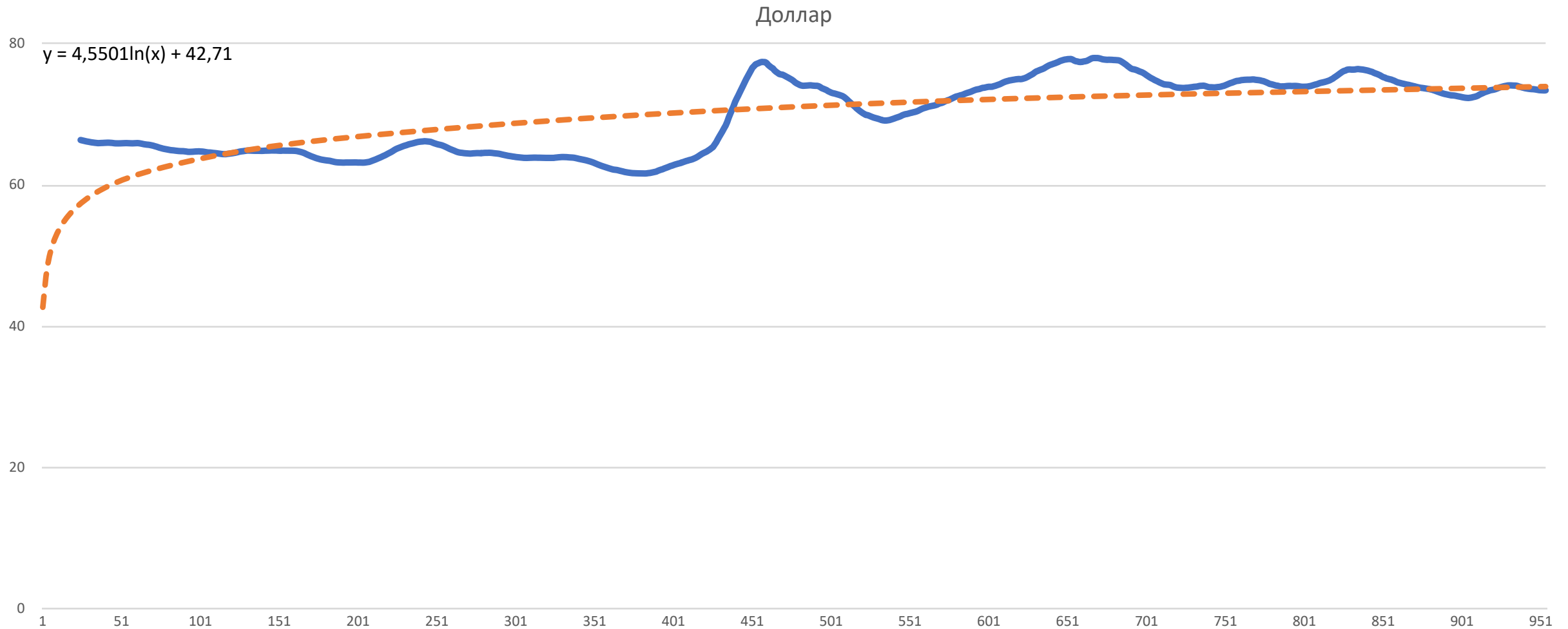
Рискованность облигаций, йена



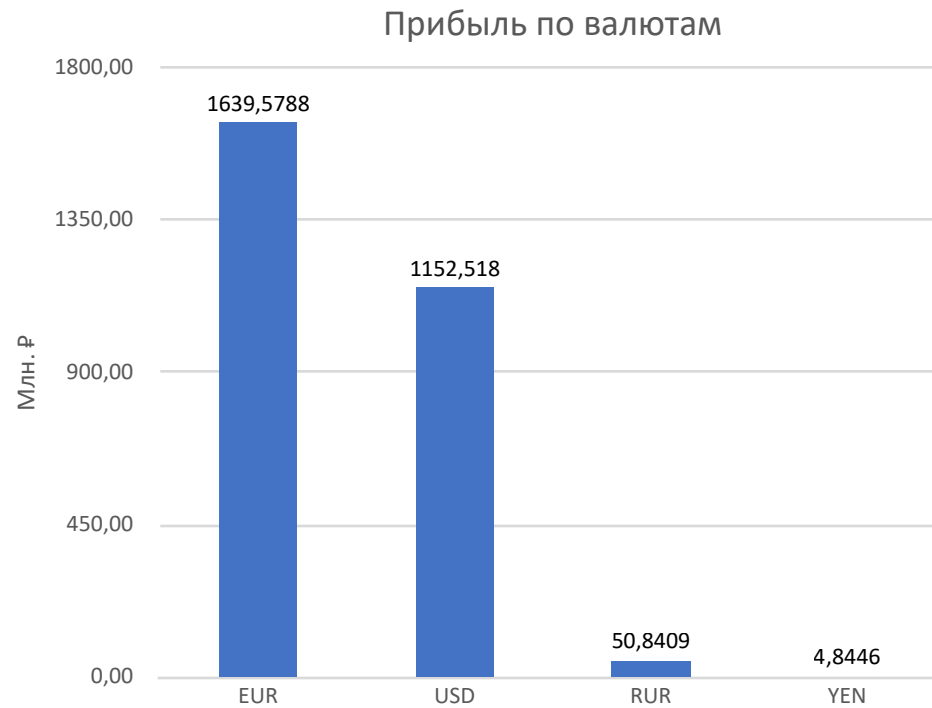
Рискованность валют vs Доходность

Валюта	Процентная ставка	Волатильность (нормированное стандартное отклонение)
EUR	0.03428	1.16
USD	0.03195	1.14
YEN	0.01080	1.09

Прогноз валютных курсов



Прибыль облигаций, в рублях



Суммарная прибыль: 2,847,782,330 ₹

Калькулятор доходности

Калькулятор		Дефолтные параметры			
<input checked="" type="checkbox"/> Сегодня		Облигации	<input checked="" type="checkbox"/>	Валюта	<input checked="" type="checkbox"/>
2021-04-03	Дата (год-месяц-день)	AA	0.970	EUR	0.980
		C	1.000	RUR	0.930
2,029,135,314	Получили, Р	Corp	0.980	USD	0.970
		IBM	0.990	YEN	0.995
760,563,493	Получим, Р	Asia	0.950		
		RTS	1.000		
	Получим на месяц...				
75,761,764	1	Дисконт-фактор			0.004
71,996,478	2				
62,399,901	4	Поля, доступные для редактирования выделены бледно-морковным			
49,531,770	6				
36,609,445	9				
0					
464,264,135					

Выводы

- Чем выше волатильность валюты, тем меньше процентная ставка
- Облигации в йенах наиболее надежные, а в евро – наименее
- Наиболее выгодными являются облигации в евро и долларах, т.к. у них наибольшая доходность