

NFEAFIX: Методика расчёта вменённой доходности.

Формула для расчёта стартовой даты (3М): DfAddPeriod("RUS, USA";TOM;"3M";"DMC:MOD"), где DMC:MOD — конвенция переноса даты платежа.

Вменённая доходность: $(3M \text{ FWD} * (1 + 3M \text{ PAR} * (3M \text{ DATE-TOM}) / 360) / \text{REF} - 1) * 365 / (3M \text{ DATE-TOM}) * 100$, где:

3M FWD — ставка по трёхмесячному форварду,

3M PAR – 3-месячная номинальная доходность, интерполированная на основе 1W-3M LIBOR,

6M-5Y ZERO,

3M DATE — конечная дата,

REF = фиксинг по USD/RUB от MOEX, значение 6-го ФИДа на РИКе <USDFIXME.RTS>