

Importante Valores de renta fija Fórmulas PDF



Fórmulas Ejemplos con unidades

Lista de 14 Importante Valores de renta fija Fórmulas

1) Ajuste de convexidad Fórmula ↻

Fórmula

$$CA = BC \cdot \left(\Delta y^2 \right) \cdot 100$$

Ejemplo

$$0.28 = 7 \cdot \left(0.02^2 \right) \cdot 100$$

Evaluar fórmula ↻

2) Interés acumulado Fórmula ↻

Fórmula

$$AI = \frac{F \cdot C \cdot D}{M \cdot T}$$

Ejemplo

$$5.1099 = \frac{1500 \cdot 0.06 \cdot 31}{3 \cdot 182}$$

Evaluar fórmula ↻

3) Pérdida esperada Fórmula ↻

Fórmula

$$EL = DP \cdot LSD$$

Ejemplo

$$0.04 = 0.05 \cdot 0.80$$

Evaluar fórmula ↻

4) Precio del bono rescatable Fórmula ↻

Fórmula

$$CBP = NCBP - COP$$

Ejemplo

$$59 = 65 - 6$$

Evaluar fórmula ↻

5) Precio del bono vendible Fórmula ↻

Fórmula

$$PBP = NPBP + POP$$

Ejemplo

$$90 = 85.5 + 4.5$$

Evaluar fórmula ↻

6) Precio limpio Fórmula ↻

Fórmula

$$P_{\text{clean}} = P_{\text{dirty}} - AI$$

Ejemplo

$$57.5 = 63 - 5.5$$

Evaluar fórmula ↻

7) Precio sucio Fórmula ↻

Fórmula

$$P_{\text{dirty}} = P_{\text{clean}} + AI$$

Ejemplo

$$63 = 57.5 + 5.5$$

Evaluar fórmula ↻



8) Prima de conversión Fórmula

Fórmula

$$CP = CV - MP_{CB}$$

Ejemplo

$$5 = 100 - 95$$

Evaluar fórmula 

9) Rendimiento equivalente al bono semestral Fórmula

Fórmula

$$BEY_{\text{semi-annual}} = Y_{\text{semi-annual}} \cdot 2$$

Ejemplo

$$7000 = 3500 \cdot 2$$

Evaluar fórmula 

10) Rendimiento Nominal Fórmula

Fórmula

$$NY = \left(\frac{AIP}{F} \right) \cdot 100$$

Ejemplo

$$4 = \left(\frac{60}{1500} \right) \cdot 100$$

Evaluar fórmula 

11) Severidad de la pérdida Fórmula

Fórmula

$$LS = 1 - RR$$

Ejemplo

$$0.12 = 1 - 0.88$$

Evaluar fórmula 

12) Tasa de conversión Fórmula

Fórmula

$$CR = \frac{P_{vm}}{CP_{equity}}$$

Ejemplo

$$2 = \frac{1100}{550}$$

Evaluar fórmula 

13) Tasa de interés flotante Fórmula

Fórmula

$$FIR = R_{ref} + FS$$

Ejemplo

$$25 = 10 + 15$$

Evaluar fórmula 

14) Valor de conversión Fórmula

Fórmula

$$CV = P \cdot CR$$

Ejemplo

$$100 = 50 \cdot 2$$

Evaluar fórmula 



Variables utilizadas en la lista de Valores de renta fija Fórmulas anterior

- **AI** Interés acumulado
- **AIP** Pagos totales de intereses anuales
- **BC** Convexidad de Bond
- **BEY_{semi-annual}** Rendimiento equivalente al bono semestral
- **C** Tasa de cupón anual total
- **CA** Ajuste de convexidad
- **CBP** Precio del bono rescatable
- **COP** Precio de la opción de compra
- **CP** Prima de conversión
- **CP_{equity}** Precio de conversión del capital
- **CR** Tasa de conversión
- **CV** Valor de conversión
- **D** Días desde la última fecha de pago
- **DP** Probabilidad de incumplimiento
- **EL** Pérdida esperada
- **F** Valor nominal
- **FIR** Tasa de interés flotante
- **FS** Spread fijo
- **LS** Gravedad de la pérdida
- **LSD** Severidad de la pérdida en caso de incumplimiento
- **M** Número de pagos de cupones por año
- **MP_{CB}** Precio de mercado del bono convertible
- **NCBP** Precio del bono no rescatable
- **NPBP** Precio del bono no vendible
- **NY** Rendimiento Nominal
- **P** Precio de mercado por acción
- **P_{clean}** Precio limpio
- **P_{dirty}** Precio sucio
- **P_{vm}** Valor nominal al vencimiento
- **PBP** Precio del bono vendible
- **POP** Precio de opción de venta
- **R_{ref}** Tasa de referencia
- **RR** Índice de recuperación
- **T** Periodo de acumulación
- **Y_{semi-annual}** Rendimiento por período semestral



- Δy Cambio de rendimiento



Descargue otros archivos PDF de Importante Financiero

- [Importante Bancario Fórmulas](#) 
- [Importante Equidad Fórmulas](#) 
- [Importante Gestión de Instituciones Financieras Fórmulas](#) 
- [Importante Modelización y valoración financiera Fórmulas](#) 
- [Importante Valores de renta fija Fórmulas](#) 
- [Importante Banca de inversión Fórmulas](#) 
- [Importante Fusiones y adquisiciones Fórmulas](#) 
- [Importante Finanzas pública Fórmulas](#) 
- [Importante Gestión Financiera Estratégica Fórmulas](#) 
- [Importante Impuesto Fórmulas](#) 

Pruebe nuestras calculadoras visuales únicas

-  [Aumento porcentual](#) 
-  [Calculadora MCD](#) 
-  [Fracción mixta](#) 

¡COMPARTE este PDF con alguien que lo necesite!

Este PDF se puede descargar en estos idiomas.

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

7/9/2024 | 6:32:31 AM UTC

