

Importante Titoli a reddito fisso Formule PDF



**Formule
Esempi
con unità**

Lista di 14
Importante Titoli a reddito fisso Formule

1) Gravità della perdita Formula ↻

Formula

$$LS = 1 - RR$$

Esempio

$$0.12 = 1 - 0.88$$

Valutare la formula ↻

2) Interessi maturati Formula ↻

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula ↻

3) Perdita attesa Formula ↻

Formula

$$EL = DP \cdot LSD$$

Esempio

$$0.04 = 0.05 \cdot 0.80$$

Valutare la formula ↻

4) Premio di conversione Formula ↻

Formula

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

Esempio

$$5 = 100 - 95$$

Valutare la formula ↻

5) Prezzo delle obbligazioni putabili Formula ↻

Formula

$$PBP = NPBP + POP$$

Esempio

$$90 = 85.5 + 4.5$$

Valutare la formula ↻

6) Prezzo delle obbligazioni richiamabili Formula ↻

Formula

$$CBP = NCBP - COP$$

Esempio

$$59 = 65 - 6$$

Valutare la formula ↻

7) Prezzo pulito Formula ↻

Formula

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

Esempio

$$57.5 = 63 - 5.5$$

Valutare la formula ↻



8) Prezzo sporco Formula

Formula

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

Esempio

$$63 = 57.5 + 5.5$$

Valutare la formula 

9) Rapporto di conversione Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

10) Regolazione della convessità Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

11) Rendimento nominale Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

12) Rendimento semestrale equivalente alle obbligazioni Formula

Formula

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

Esempio

$$7000 = 3500 \cdot 2$$

Valutare la formula 

13) Tasso di interesse variabile Formula

Formula

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

Esempio

$$25 = 10 + 15$$

Valutare la formula 

14) Valore di conversione Formula

Formula

$$CV = P \cdot CR$$

Esempio

$$100 = 50 \cdot 2$$

Valutare la formula 



Variabili utilizzate nell'elenco di Titoli a reddito fisso Formule sopra

- **AI** Interessi maturati
- **AIP** Totale pagamenti di interessi annuali
- **BC** Convessità di Bond
- **BEY_{semi-annual}** Rendimento semestrale equivalente alle obbligazioni
- **C** Tasso cedolare annuale totale
- **CA** Regolazione della convessità
- **CBP** Prezzo delle obbligazioni richiamabili
- **COP** Prezzo dell'opzione call
- **CP** Premio di conversione
- **CP_{equity}** Prezzo di conversione delle azioni
- **CR** Rapporto di conversione
- **CV** Valore di conversione
- **D** Giorni dall'ultima data di pagamento
- **DP** Probabilità di default
- **EL** Perdita attesa
- **F** Valore nominale
- **FIR** Tasso di interesse variabile
- **FS** Spread fisso
- **LS** Gravità della perdita
- **LSD** Gravità della perdita in caso di inadempienza
- **M** Numero di pagamenti di cedole all'anno
- **MP_{CB}** Prezzo di mercato delle obbligazioni convertibili
- **NCBP** Prezzo delle obbligazioni non richiamabili
- **NPBP** Prezzo delle obbligazioni non putabile
- **NY** Rendimento nominale
- **P** Prezzo di mercato per azione
- **P_{clean}** Prezzo pulito
- **P_{dirty}** Prezzo sporco
- **P_{vm}** Valore nominale alla scadenza
- **PBP** Prezzo delle obbligazioni putabili
- **POP** Prezzo dell'opzione put
- **R_{ref}** Tasso di riferimento
- **RR** Tasso di recupero
- **T** Periodo di maturazione
- **Y_{semi-annual}** Rendimento per periodo semestrale



- Δy Cambio di rendimento



Scarica altri PDF Importante Finanziario

- [Importante Bancario Formule](#) 
- [Importante Equità Formule](#) 
- [Importante Gestione delle istituzioni finanziarie Formule](#) 
- [Importante Modellazione e valutazione finanziaria Formule](#) 
- [Importante Titoli a reddito fisso Formule](#) 
- [Importante Investimento bancario Formule](#) 
- [Importante Fusioni e acquisizioni Formule](#) 
- [Importante Finanza pubblica Formule](#) 
- [Importante Gestione finanziaria strategica Formule](#) 
- [Importante Imposta Formule](#) 

Prova i nostri calcolatori visivi unici

-  [Aumento percentuale](#) 
-  [Calcolatore mcd](#) 
-  [Frazione mista](#) 

Per favore CONDIVIDI questo PDF con qualcuno che ne ha bisogno!

Questo PDF può essere scaricato in queste lingue

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

7/9/2024 | 6:32:48 AM UTC

