

# Important Titres à revenu fixe Formules PDF



## Formules Exemples avec unités

### Liste de 14 Important Titres à revenu fixe Formules

#### 1) Ajustement de la convexité Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻

#### 2) Gravité de la perte Formule ↻

Formule

$$LS = 1 - RR$$

Exemple

$$0.12 = 1 - 0.88$$

Évaluer la formule ↻

#### 3) Intérêt accru Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻

#### 4) Perte attendue Formule ↻

Formule

$$EL = DP \cdot LSD$$

Exemple

$$0.04 = 0.05 \cdot 0.80$$

Évaluer la formule ↻

#### 5) Prime de conversion Formule ↻

Formule

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

Exemple

$$5 = 100 - 95$$

Évaluer la formule ↻

#### 6) Prix des obligations putables Formule ↻

Formule

$$PBP = NPBP + POP$$

Exemple

$$90 = 85.5 + 4.5$$

Évaluer la formule ↻

#### 7) Prix des obligations rachetables Formule ↻

Formule

$$CBP = NCBP - COP$$

Exemple

$$59 = 65 - 6$$

Évaluer la formule ↻



## 8) Prix propre Formule ↻

Évaluer la formule ↻

Formule

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

Exemple

$$57.5 = 63 - 5.5$$

## 9) Prix sale Formule ↻

Évaluer la formule ↻

Formule

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

Exemple

$$63 = 57.5 + 5.5$$

## 10) Rendement équivalent aux obligations semestrielles Formule ↻

Évaluer la formule ↻

Formule

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

Exemple

$$7000 = 3500 \cdot 2$$

## 11) Rendement nominal Formule ↻

Évaluer la formule ↻

Formule

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

Exemple

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

## 12) Taux de conversion Formule ↻

Évaluer la formule ↻

Formule

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

Exemple

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

## 13) Taux d'intérêt flottant Formule ↻

Évaluer la formule ↻

Formule

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

Exemple

$$25 = 10 + 15$$

## 14) Valeur de conversion Formule ↻

Évaluer la formule ↻

Formule

$$CV = P \cdot CR$$

Exemple

$$100 = 50 \cdot 2$$



- **AI** Intérêt accru
- **AIP** Paiements d'intérêt annuels totaux
- **BC** La convexité de Bond
- **BEY<sub>semi-annual</sub>** Rendement équivalent aux obligations semestrielles
- **C** Taux du coupon annuel total
- **CA** Ajustement de la convexité
- **CBP** Prix des obligations rachetables
- **COP** Prix de l'option d'achat
- **CP** Prime de conversion
- **CP<sub>equity</sub>** Prix de conversion des actions
- **CR** Taux de conversion
- **CV** Valeur de conversion
- **D** Jours depuis la dernière date de paiement
- **DP** Probabilité par défaut
- **EL** Perte attendue
- **F** Valeur nominale
- **FIR** Taux d'intérêt flottant
- **FS** Spread fixe
- **LS** Gravité de la perte
- **LSD** Gravité de la perte en cas de défaut
- **M** Nombre de paiements de coupons par an
- **MP<sub>CB</sub>** Prix de marché de l'obligation convertible
- **NCBP** Prix des obligations non rachetables
- **NPBP** Prix des obligations non putables
- **NY** Rendement nominal
- **P** Prix du marché par action
- **P<sub>clean</sub>** Prix propre
- **P<sub>dirty</sub>** Prix sale
- **P<sub>vm</sub>** Valeur nominale à l'échéance
- **PBP** Prix des obligations putables
- **POP** Prix de l'option de vente
- **R<sub>ref</sub>** Taux de référence
- **RR** Taux de récupération
- **T** Période d'accumulation
- **Y<sub>semi-annual</sub>** Rendement par période semestrielle



- $\Delta y$  Changement de rendement



## Téléchargez d'autres PDF Important Financier

- [Important Bancaire Formules](#) 
- [Important Équité Formules](#) 
- [Important Gestion des institutions financières Formules](#) 
- [Important Modélisation financière et évaluation Formules](#) 
- [Important Titres à revenu fixe Formules](#) 
- [Important Banque d'investissement Formules](#) 
- [Important Fusions et acquisitions Formules](#) 
- [Important Finance publique Formules](#) 
- [Important Gestion financière stratégique Formules](#) 
- [Important Impôt Formules](#) 

## Essayez nos calculatrices visuelles uniques

-  [Augmentation en pourcentage](#) 
-  [Calculateur PGCD](#) 
-  [Fraction mixte](#) 

Veuillez PARTAGER ce PDF avec quelqu'un qui en a besoin !

## Ce PDF peut être téléchargé dans ces langues

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

7/9/2024 | 6:32:35 AM UTC

