

Важный С фиксированным доходом ценных бумаг

Формулы PDF



Формулы
Примеры
с единицами

Список 14

Важный С фиксированным доходом
ценных бумаг Формулы

1) Грязная цена Формула ↗

Формула

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

Пример

$$63 = 57.5 + 5.5$$

Оценить формулу ↗

2) Конверсионный премиум Формула ↗

Формула

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

Пример

$$5 = 100 - 95$$

Оценить формулу ↗

3) Коэффициент конверсии Формула ↗

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу ↗

4) Начисленные проценты Формула ↗

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу ↗

5) Номинальная доходность Формула ↗

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу ↗

6) Ожидаемая потеря Формула ↗

Формула

$$EL = DP \cdot LSD$$

Пример

$$0.04 = 0.05 \cdot 0.80$$

Оценить формулу ↗



7) Плавающая процентная ставка Формула ↻

Формула

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

Пример

$$25 = 10 + 15$$

Оценить формулу ↻

8) Полугодовая эквивалентная доходность облигаций Формула ↻

Формула

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

Пример

$$7000 = 3500 \cdot 2$$

Оценить формулу ↻

9) Регулировка выпуклости Формула ↻

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу ↻

10) Серьезность потерь Формула ↻

Формула

$$LS = 1 - RR$$

Пример

$$0.12 = 1 - 0.88$$

Оценить формулу ↻

11) Цена облигации с правом погашения Формула ↻

Формула

$$PBP = NPBP + POP$$

Пример

$$90 = 85.5 + 4.5$$

Оценить формулу ↻

12) Цена отзывной облигации Формула ↻

Формула

$$CBP = NCBP - COP$$

Пример

$$59 = 65 - 6$$

Оценить формулу ↻

13) Ценность конверсии Формула ↻

Формула

$$CV = P \cdot CR$$

Пример

$$100 = 50 \cdot 2$$

Оценить формулу ↻

14) Чистая цена Формула ↻

Формула

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

Пример

$$57.5 = 63 - 5.5$$

Оценить формулу ↻



Переменные, используемые в списке С фиксированным доходом ценных бумаг Формулы выше

- **AI** Начисленные проценты
- **AIP** Общая годовая процентная выплата
- **BC** Выпуклость Бонда
- **BEY_{semi-annual}** Полугодовая эквивалентная доходность облигаций
- **C** Общая годовая ставка купона
- **CA** Регулировка выпуклости
- **CBP** Цена отзывной облигации
- **COP** Цена опциона колл
- **CP** Конверсионный премиум
- **CP_{equity}** Цена конвертации собственного капитала
- **CR** Коэффициент конверсии
- **CV** Ценность конверсии
- **D** Дней с даты последнего платежа
- **DP** Вероятность дефолта
- **EL** Ожидаемая потеря
- **F** Номинальная стоимость
- **FIR** Плавающая процентная ставка
- **FS** Фиксированный спред
- **LS** Серьезность потери
- **LSD** Серьезность убытка при условии дефолта
- **M** Количество купонных выплат в год
- **MP_{CB}** Рыночная цена конвертируемой облигации
- **NCBP** Цена облигации без права отзыва
- **NPBP** Цена облигации без права продажи
- **NY** Номинальная доходность
- **P** Рыночная цена за акцию
- **P_{clean}** Чистая цена
- **P_{dirty}** Грязная цена
- **P_{vm}** Номинальная стоимость при погашении
- **PBP** Цена облигации с правом погашения
- **POP** Цена опциона пут
- **R_{ref}** Базовая ставка
- **RR** Скорость восстановления
- **T** Период начисления



- $Y_{\text{semi-annual}}$ Доходность за полугодовой период
- Δy Изменение доходности



Загрузите другие PDF-файлы Важный финансовый

- Важный Банковское дело Формулы 
- Важный Капитал Формулы 
- Важный Управление финансовыми институтами Формулы 
- Важный Финансовое моделирование и оценка Формулы 
- Важный С фиксированным доходом ценных бумаг Формулы 
- Важный Инвестиционная деятельность банков Формулы 
- Важный Слияние и поглощение Формулы 
- Важный Общественные финансы Формулы 
- Важный Стратегический финансовый менеджмент Формулы 
- Важный налог Формулы 

Попробуйте наши уникальные визуальные калькуляторы

-  процент увеличения 
-  калькулятор НОД 
-  Смешанная дробь 

Пожалуйста, ПОДЕЛИТЕСЬ этим PDF-файлом с теми, кому он нужен!

Этот PDF-файл можно скачать на этих языках

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

7/9/2024 | 6:32:43 AM UTC

