



calculatoratoz.com



unitsconverters.com

С фиксированным доходом ценных бумаг Формулы

Калькуляторы!

Примеры!

Преобразования!

Закладка calculatoratoz.com, unitsconverters.com

Самый широкий охват калькуляторов и рост - **30 000+ калькуляторов!**

Расчет с разными единицами измерения для каждой переменной -

Встроенное преобразование единиц измерения!

Самая широкая коллекция измерений и единиц измерения - **250+ измерений!**



Не стесняйтесь ПОДЕЛИТЬСЯ этим документом с друзьями!

[Пожалуйста, оставьте свой отзыв здесь...](#)



Список 14 С фиксированным доходом ценных бумаг Формулы

С фиксированным доходом ценных бумаг

1) Грязная цена

$$fx \quad P_{dirty} = P_{clean} + AI$$

[Открыть калькулятор !\[\]\(cbe2492b119e39e02a1dab2af4a4b296_img.jpg\)](#)

$$ex \quad 63 = 57.5 + 5.5$$

2) Конверсионный премиум

$$fx \quad CP = CV - MP_{CB}$$

[Открыть калькулятор !\[\]\(870f5d5e9c0d57485634be3ecf52f3ca_img.jpg\)](#)

$$ex \quad 5 = 100 - 95$$

3) Коэффициент конверсии

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(7d1d6890825e83a6a4a51febe2dcc7f3_img.jpg\)](#)

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



4) Начисленные проценты

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

Открыть калькулятор 

$$ex \quad 5.10989 = \frac{1500 \cdot 0.06 \cdot 31}{3 \cdot 182}$$

5) Номинальная доходность

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

Открыть калькулятор 

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

6) Ожидаемая потеря

$$fx \quad EL = DP \cdot LSD$$

Открыть калькулятор 

$$ex \quad 0.04 = 0.05 \cdot 0.80$$

7) Плавающая процентная ставка

$$fx \quad FIR = R_{ref} + FS$$

Открыть калькулятор 

$$ex \quad 25 = 10 + 15$$

8) Полугодовая эквивалентная доходность облигаций

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

Открыть калькулятор 

$$ex \quad 7000 = 3500 \cdot 2$$



9) Регулировка выпуклости

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(e2376d476d06eb31946dc01a69a4403a_img.jpg\)](#)

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

10) Серьезность потерь

$$fx \quad LS = 1 - RR$$

[Открыть калькулятор !\[\]\(0b5e7e25e8775f7e7e80906ada4f0021_img.jpg\)](#)

$$ex \quad 0.12 = 1 - 0.88$$

11) Цена облигации с правом погашения

$$fx \quad PBP = NPBP + POP$$

[Открыть калькулятор !\[\]\(bd3b31712ad9bab5a241210fa6925cdd_img.jpg\)](#)

$$ex \quad 90 = 85.5 + 4.5$$

12) Цена отзывной облигации

$$fx \quad CBP = NCBP - COP$$

[Открыть калькулятор !\[\]\(7bc43b319a082987e20f7bf78f4bab80_img.jpg\)](#)

$$ex \quad 59 = 65 - 6$$

13) Ценность конверсии

$$fx \quad CV = P \cdot CR$$

[Открыть калькулятор !\[\]\(4a7b4ce770af8456e11a71f9565c8c2b_img.jpg\)](#)

$$ex \quad 100 = 50 \cdot 2$$



14) Чистая цена

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

Открыть калькулятор 

ex $57.5 = 63 - 5.5$



Используемые переменные

- **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_{semi-annual}** Доходность за полугодовой период
- **Δy** Изменение доходности



Константы, функции, используемые измерения



Проверьте другие списки формул

- **Банковское дело Формулы** 
- **Управление финансовыми институтами Формулы** 
- **С фиксированным доходом ценных бумаг Формулы** 
- **Общественные финансы Формулы** 
- **налог Формулы** 

Не стесняйтесь ПОДЕЛИТЬСЯ этим документом с друзьями!

PDF Доступен в

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

5/22/2024 | 6:19:57 AM UTC

[Пожалуйста, оставьте свой отзыв здесь...](#)

