

## Fórmulas Exemplos com unidades



## Lista de 14 Importante Títulos de Renda Fixa Fórmulas

### 1) Ajuste de convexidade Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula

### 2) Conversão Premium Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

$$5 = 100 - 95$$

Avaliar Fórmula

### 3) Gravidade da Perda Fórmula

Fórmula

$$LS = 1 - RR$$

Exemplo

$$0.12 = 1 - 0.88$$

Avaliar Fórmula

### 4) Juros acumulados Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula

### 5) Perda Esperada Fórmula

Fórmula

$$EL = DP \cdot LSD$$

Exemplo

$$0.04 = 0.05 \cdot 0.80$$

Avaliar Fórmula

### 6) Preço do título putável Fórmula

Fórmula

$$PBP = NPBP + POP$$

Exemplo

$$90 = 85.5 + 4.5$$

Avaliar Fórmula

### 7) Preço do título resgatável Fórmula

Fórmula

$$CBP = NCBP - COP$$

Exemplo

$$59 = 65 - 6$$

Avaliar Fórmula



## 8) Preço Limpo Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

$$57.5 = 63 - 5.5$$

Avaliar Fórmula 

## 9) Preço sujo Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

$$63 = 57.5 + 5.5$$

Avaliar Fórmula 

## 10) Rendimento equivalente de título semestral Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

$$7000 = 3500 \cdot 2$$

Avaliar Fórmula 

## 11) Rendimento Nominal Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula 

## 12) Taxa de conversão Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula 

## 13) Taxa de juros flutuante Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

$$25 = 10 + 15$$

Avaliar Fórmula 

## 14) Valor de conversão Fórmula

Fórmula

$$CV = P \cdot CR$$

Exemplo

$$100 = 50 \cdot 2$$

Avaliar Fórmula 



## Variáveis usadas na lista de Títulos de Renda Fixa Fórmulas acima

- **AI** Juros acumulados
- **AIP** Pagamentos totais de juros anuais
- **BC** Convexidade de Bond
- **BEY<sub>semi-annual</sub>** Rendimento equivalente de título semestral
- **C** Taxa total de cupom anual
- **CA** Ajuste de convexidade
- **CBP** Preço do título exigível
- **COP** Preço da opção de compra
- **CP** Conversão Premium
- **CP<sub>equity</sub>** Preço de conversão do patrimônio
- **CR** Taxa de conversão
- **CV** Valor de conversão
- **D** Dias desde a última data de pagamento
- **DP** Probabilidade padrão
- **EL** Perda Esperada
- **F** Valor nominal
- **FIR** Taxa de juros flutuante
- **FS** Spread Fixo
- **LS** Gravidade da perda
- **LSD** Gravidade da perda dada por padrão
- **M** Número de pagamentos de cupom por ano
- **MP<sub>CB</sub>** Preço de mercado do título conversível
- **NCBP** Preço do título não resgatável
- **NPBP** Preço do título não putável
- **NY** Rendimento Nominal
- **P** Preço de mercado por ação
- **P<sub>clean</sub>** Preço Limpo
- **P<sub>dirty</sub>** Preço sujo
- **P<sub>vm</sub>** Valor nominal no vencimento
- **PBP** Preço do título putável
- **POP** Preço da opção de venda
- **R<sub>ref</sub>** Taxa de referência
- **RR** Taxa de recuperação
- **T** Período de acumulação
- **Y<sub>semi-annual</sub>** Rendimento por período semestral




- $\Delta y$  Mudança de rendimento



## Baixe outros PDFs de Importante Financeiro

- [Importante Bancário Fórmulas](#) 
- [Importante Equidade Fórmulas](#) 
- [Importante Gestão de Instituições Financeiras Fórmulas](#) 
- [Importante Modelagem e Avaliação Financeira Fórmulas](#) 
- [Importante Títulos de Renda Fixa Fórmulas](#) 
- [Importante Investimento bancário Fórmulas](#) 
- [Importante Fusões e aquisições Fórmulas](#) 
- [Importante Finanças públicas Fórmulas](#) 
- [Importante Gestão Financeira Estratégica Fórmulas](#) 
- [Importante Imposto Fórmulas](#) 

## Experimente nossas calculadoras visuais exclusivas

-  [Fração mista](#) 
-  [Calculadora MDC](#) 

Por favor, COMPARTILHE este PDF com alguém que precise dele!

## Este PDF pode ser baixado nestes idiomas

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

7/9/2024 | 6:32:52 AM UTC

