Своп – временный обмен активами в ходе торговли на бирже. Через определенное время стороны обязуются вернуть друг другу эти же бумаги, либо делать обратный платеж

Кросс-валютный своп – стороны обмениваются периодическими выплатами в разных валютах

Ставка дисконтирования — это ставка процента, по которой будущая стоимость денег (финансового инструмента) приводится к их настоящей стоимости, т.е. по которой осуществляется процесс дисконтирования.

Кривая дисконтирования – зависимость ставки дисконтирования от сроков

Форвардная ставка – это процентная ставка, устанавливаемая сегодня, которая будет выплачена за пользование деньгами, занятыми в определенный момент в будущем на определенный период. В случае если одна из сторон выплачивает купон на основании плавающей ставки, для расчёта будущих купонных выплат используются форвардные ставки соответствующих индикаторов, которые отвечают требованиям достоверности и наблюдаемости.

Форвардная кривая – зависимость форвардной ставки от сроков

Annual – годовой

Semi Ann. – полугодовой

Interest rate – процентная ставка

IRS (interest rate swap) – процентный своп

MOSPRIME rate – индикативная ставка предоставления рублевых кредитов (депозитов) на московском денежном рынке

3M MOSPRIME mid – среднее значение MOSPRIME за 3 месяца

LIBOR – Лондонская Межбанковская ставка предложения (форвардная ставка)

o/n (overnight) – процентная ставка по депозиту на 1 рабочий день