Résumé formule maths fin examen 2

Rappel de relation importante et formule

Début de période (due) :

où

où

Fin de période (fin de période) :

Annuité arithmétique croissante :

*Annuité due (début période)*

*Annuité immédiate (fin période)*

*Annuité perpétuité*

Annuité arithmétique décroissante :

*Annuité due (Début de période)*

*Annuité immédiate (fin de période)*

Sinkind fund

Force d’intérêt

*Densité de paiement h(t) avec une force d’intérêt variable*

*Si la force d’intérêt est constante*

Amortissement

*Rétrospective :*

*Prospective :*

*Paiements égaux :*

Rétrospective

Prospective

Fond amortissement

i=taux prêt

j=taux marché

*Montant des paiements mensuel Li sur le prêt, le reste en fond d’amortissement*

Calculer le taux d’intérêt effectif entre t et n

Obligation

*Si C=F alors,*

*Si K=*

*Si g= g est le taux modifier de coupon*

*Si C=F*

Prix obligation entre 2 dates

*Prix entre 2 dates*

*Prix d’achat*

*Prix du marché (prix d’achat moins coupon en cours)*

Taux rendement obligation

*Directement après le mième coupon*

*entre 2 coupons*

Amortissement d’une obligation

Pour t, *Toute période*

Pour t+1