

IB-Instruments базисы

D. Selin

June 2019

Содержание

1 Введение	1
2 База Act/Act ISDA	1
2.1 Обозначения при расчетах	1

Аннотация

Приятного чтения

1 Введение

В документе перечислено описание основных базисов, используемых для расчета долей купонных периодов по облигациям и другим процентным инструментам (в дальнейшем). СФИ использует расширенную версию библиотеки открытого доступа в части базисов Strata OpenGamma.

2 База Act/Act ISDA

Один из стандартных базисов, который вычисляет разницу дней между границами периода, и делит ее либо на 366 (для високосного года), либо на 365 (для не високосного года). Однако, результат базы "собирается" из нескольких слагаемых.

2.1 Обозначения при расчетах

FD = FirstDate или дата начала периода;

LD = LastDate или дата окончания периода;

Y1 = Year.Of(FD) или значение года FD;

Y2 = Year.Of(LD) или значение года LD;

YearLength.Of(*date*) или длина года, на которую приходится *date*;

$$Base = \left(\frac{YearLength.FD}{YearLength.Of(date)} \right) \quad (1)$$

$$T_{j_1 j_2 \dots j_q}^{i_1 i_2 \dots i_p} = T(x^{i_1}, \dots, x^{i_p}, e_{j_1}, \dots, e_{j_q}) \quad (2)$$