

Справка за компонентите на рисковата премия

(наименование на пенсионния фонд)
.....
(наименование на пенсионноосигурителното дружество)
към

И	/лит.чип	ISIN	Рискови премии*					Обща рискова премия $R=R1+R2+R3+R4+...+Rn$	/SN на използваната ценна книга със сходни характеристики	Доходността до падежа на ценната книга със сходни характеристики	Норма на дисконтиране/ Дисконтов процент	Коментари	Цена за преценка
			R1	R2	R3	R4	Rn						
1													
2													
3													
4													
5													

Рисков фактор	Премия/дисконт	Общо в %	Описание
1. Кредитен рейтинг - стойността на средна, получен от съответната таблица за изчисляване на вътрешния кредитен рейтинг - R1			
2. Матуритет - за всяка календарна година или единица доракия (при облигации с погасяване на главницата) разлика спрямо референтната облигация - R2			
3. Валута - (при различие между валута на емитиране и валута на референтната облигация) - R3			
4. Обезпечение - R4			
5. Обем на емисията - R5			
5.1. под 5 млн. лв.			
5.2. от 5 млн. лв. до 10млн. лв.			
5.3. от 10 млн. лв. до 20 млн. лв.			
5.4. от 20 млн. лв. до 50 млн. лв.			
5.5.			
6. Други рискови фактори			
6.1.			
ОБЩО РИСКОВА ПРЕМИЯ - R			

Скала за изчисляване на въртене кредитен рейтинг на не-финансови компании

Коефициент на покритие на лихвите	≤	Рейтинг	Сред
>	-10,0000	0,499999 C-defaib/D	20,0000%
	0,500	0,799999 C/C	16,0000%
	0,800	0,999999 CwCC	12,0000%
	1,000	1,249999 Caa3/CCC-	10,5000%
	1,250	1,374999 Caa2/CCC	9,0000%
	1,375	1,499999 Caa1/CCC+	8,2500%
	1,500	1,999999 B3/B-	7,5000%
	2,000	2,499999 B2/B	6,5000%
	2,500	2,999999 B1/B+	5,5000%
	3,000	3,249999 Ba3/BB-	4,7500%
	3,250	3,499999 Ba2/BB	4,2500%
	3,500	3,749999 Ba1/BB+	3,2500%
	3,750	3,999999 Baa3/BBB-	2,7500%
	4,000	4,249999 Baa2/BBB	2,2500%
	4,250	4,499999 Baa1/BBB+	2,0000%
	4,500	5,999999 A3/A-	1,7500%
	6,000	7,499999 A2/A	1,2500%
	7,500	9,499999 A1/A+	1,1000%
	9,500	10,499999 Aa3/AA-	1,0500%
	10,500	11,499999 Aa2/AA	1,0000%
	11,500	12,499999 Aa1/AA+	0,8750%
	12,500	100000 Aaa/AAA	0,7500%

Скала за изчисляване на въртене кредитен рейтинг на финансови компании

Коефициент на покритие на лихвите	≤	Рейтинг	Сред
>	-10,0000	0,049999 C-defaib/D	20,0000%
	0,050	0,099999 C/C	16,0000%
	0,100	0,199999 CwCC	12,0000%
	0,200	0,249999 Caa3/CCC-	10,5000%
	0,250	0,274999 Caa2/CCC	9,0000%
	0,275	0,299999 Caa1/CCC+	8,2500%
	0,300	0,399999 B3/B-	7,5000%
	0,400	0,499999 B2/B	6,5000%
	0,500	0,599999 B1/B+	5,5000%
	0,600	0,699999 Ba3/BB-	4,7500%
	0,700	0,799999 Ba2/BB	4,2500%
	0,800	0,899999 Ba1/BB+	3,2500%
	0,900	0,999999 Baa3/BBB-	2,7500%
	1,000	1,049999 Baa2/BBB	2,2500%
	1,050	1,199999 Baa1/BBB+	2,0000%
	1,200	1,499999 A3/A-	1,7500%
	1,500	1,999999 A2/A	1,2500%
	2,000	2,499999 A1/A+	1,1000%
	2,250	2,499999 Aa3/AA-	1,0500%
	2,500	2,499999 Aa2/AA	1,0000%
	2,750	2,999999 Aa1/AA+	0,8750%
	3,000	100000 Aaa/AAA	0,7500%

Данни за ценната книга - анализ

ISIN	
Емитент	
Кредитен рейтинг	
Валута	
Дата смятане	
Дата падеж	
Купон	
Тип купон	
Брой лихв. плащания	
Конвенция	
Конвенция брой дни	
Конвенция база	
Преднило плащане	
Следващо плащане	
Чиста цена	
Натрупава лихва	
Брутна цена	
Доходност до падеж	