

Μεθοδολογία υπολογισμού Daily Non-Cumulative Compounded RFR

Το Daily Non Cumulative Compounded RFR για οποιαδήποτε Εργάσιμη Ημέρα “i” κατά την διάρκεια μιας Περιόδου Επιτοκίου, είναι το ετήσιο ποσοστό που υπολογίζεται ως ακολούθως:

$$(UCCDR_i - UCCDR_{i-1}) \times \frac{dcc}{n_i}$$

Όπου:

“dcc” σημαίνει 365/366, εκτός εάν καθορίζεται διαφορετικά στη Συμφωνία Δανείου για αναφορά του αριθμού των ημερών σε ένα έτος.

“UCCDR_i” σημαίνει το Unannualised Cumulative Compounded Daily Rate για την Εργάσιμη Ημέρα “i”.

“UCCDR_{i-1}” σημαίνει, σε σχέση με την Εργάσιμη Ημέρα “i”, το Unannualised Cumulative Compounded Daily Rate για την αμέσως προηγούμενη Εργάσιμη Ημέρα (εάν υπάρχει) κατά την διάρκεια αυτής της Περιόδου Επιτοκίου.

“n_i” σημαίνει τον αριθμό των ημερολογιακών ημερών από, και συμπεριλαμβανομένης, αυτής της Εργάσιμης Ημέρας «i» έως, αλλά εξαιρουμένης της επόμενης Εργάσιμης Ημέρας.

“Unannualised Cumulative Compounded Daily Rate” για οποιαδήποτε Εργάσιμη Ημέρα (“Cumulated Business Day”) κατά την διάρκεια αυτής της Περιόδου Επιτοκίου είναι το ποσοστό που υπολογίζεται ως καθορίζεται πιο κάτω:

$$ACCCR \times \frac{tn_i}{dcc}$$

“ACCCR” σημαίνει το Annualised Cumulative Compounded Daily Rate για εκείνη την Cumulated Business Day.

“dcc” έχει την έννοια που δίνεται πιο πάνω.

“tn_i” σημαίνει τον αριθμό των ημερολογιακών ημερών από, και συμπεριλαμβανομένης, της πρώτης ημέρας του Cumulation Period έως, αλλά εξαιρουμένης της Εργάσιμης Ημέρας που ακολουθεί αμέσως την τελευταία ημέρα του Cumulation Period.

“Cumulation Period” σημαίνει την περίοδο από, και συμπεριλαμβανομένης, της πρώτης Εργάσιμης Ημέρας αυτής της Περιόδου Επιτοκίου έως, και συμπεριλαμβανομένης αυτής της Cumulated Business Day.

“Annualised Cumulative Compounded Daily Rate” σημαίνει, για αυτή την Cumulated Business Day, το ετήσιο ποσοστό που υπολογίζεται ως ακολούθως:

$$\left[\prod_{i=1}^{d_0} \left(1 + \frac{\text{Daily Rate}_{i-BD} \times n_i}{dcc} \right) - 1 \right] \times \left(\frac{dcc}{tn_i} \right)$$

Όπου:

“d₀” σημαίνει τον αριθμό των Εργάσιμων Ημερών στο Cumulation Period.

“dcc” έχει την έννοια που δίνεται πιο πάνω.

“ n_i ” έχει την έννοια που δίνεται πιο πάνω.

“ tn_i ” έχει την έννοια που δίνεται πιο πάνω.

“Cumulation Period” έχει την έννοια που δίνεται πιο πάνω.

“ i ” είναι μια σειρά ακέραιων αριθμών από το 1 έως το d_0 , καθένας από τους οποίους αντιπροσωπεύει μια Εργάσιμη Ημέρα σε χρονολογική σειρά στο Cumulation Period.

“Daily Rate $_{i-BD}$ ” σημαίνει, σε σχέση με οποιαδήποτε Εργάσιμη Ημέρα που εμπίπτει εντός εκείνου του Cumulation Period, το Ημερήσιο Επιτόκιο για την ημέρα που είναι το Lookback Period πριν από εκείνη την Εργάσιμη Ημέρα « i ».

“Ημερήσιο Επιτόκιο” σημαίνει το RFR για εκείνη την Εργάσιμη Ημέρα.

“Lookback Period” σημαίνει πέντε Εργάσιμες Ημέρες.