

Importante Finanza internazionale Formule PDF



**Formule
Esempi
con unità**

Lista di 20 Importante Finanza internazionale Formule

1) Differenza tra domanda e offerta Formula

Formula

$$BA_{\text{spread}} = \left(\frac{P_{\text{ask}} - P_{\text{bid}}}{P_{\text{ask}}} \right) \cdot 100$$

Esempio

$$35.7143 = \left(\frac{70 - 45}{70} \right) \cdot 100$$

Valutare la formula 

2) Effetto Fischer internazionale utilizzando i tassi spot Formula

Formula

$$\Delta E = \left(\frac{e_o}{e_t} \right) - 1$$

Esempio

$$0.5 = \left(\frac{150}{100} \right) - 1$$

Valutare la formula 

3) Effetto Fisher internazionale utilizzando i tassi di interesse Formula

Formula

$$\Delta E = \left(\frac{r_d - r_f}{1 + r_f} \right)$$

Esempio

$$0.5833 = \left(\frac{0.90 - 0.20}{1 + 0.20} \right)$$

Valutare la formula 

4) Gamma Formula

Formula

$$\Gamma = \frac{\% \Delta}{\Delta S}$$

Esempio

$$0.002 = \frac{0.05}{25}$$

Valutare la formula 

5) Indice di forza relativa Formula

Formula

$$RSI = 100 - \left(\frac{100}{1 + \left(\frac{AG}{AL} \right)} \right)$$

Esempio

$$75 = 100 - \left(\frac{100}{1 + \left(\frac{60}{20} \right)} \right)$$

Valutare la formula 



6) Numero ottimale di contratti Formula

Formula

$$OC = \frac{\Delta_{\text{optimal}} \cdot NPH}{FCS}$$

Esempio

$$3.06 = \frac{0.17 \cdot 4500}{250}$$

Valutare la formula 

7) Opzione Premio Formula

Formula

$$OPR = \left(\left(\frac{SOW}{NSOW} \right) + \left(PP \cdot \frac{100}{PS} - 100 \right) \right)$$

Esempio

$$846.5909 = \left(\left(\frac{500}{55} \right) + \left(1500 \cdot \frac{100}{160} - 100 \right) \right)$$

Valutare la formula 

8) Parità dei tassi di interesse scoperta Formula

Formula

$$ES_{t+1} = e_o \cdot \left(\frac{1 + r_d}{1 + r_f} \right)$$

Esempio

$$237.5 = 150 \cdot \left(\frac{1 + 0.90}{1 + 0.20} \right)$$

Valutare la formula 

9) Parità del tasso di interesse coperta Formula

Formula

$$F = (e_o) \cdot \left(\frac{1 + r_f}{1 + r_d} \right)$$

Esempio

$$94.7368 = (150) \cdot \left(\frac{1 + 0.20}{1 + 0.90} \right)$$

Valutare la formula 

10) Parità Put-Call Formula

Formula

$$c_t = S_t + p_t - \left(\frac{X_s}{\left(1 + \left(\frac{R_f}{100} \right) \right)^{\frac{n_m}{12}}} \right)$$

Esempio

$$7.293 = 53 + 4 - \left(\frac{50.1}{\left(1 + \left(\frac{3.2}{100} \right) \right)^{\frac{3}{12}}} \right)$$

Valutare la formula 



11) Payoff FRA (posizione lunga) Formula

Formula

Valutare la formula 

$$FRA_p = NP \cdot \left(\frac{\left(r_{\text{exp}} - r_{\text{forward}} \right) \cdot \left(\frac{n_{\text{ur}}}{360} \right)}{1 + \left(r_{\text{exp}} \cdot \left(\frac{n_{\text{ur}}}{360} \right) \right)} \right)$$

Esempio

$$1793.722 = 50000 \cdot \left(\frac{\left(52 - 50 \right) \cdot \left(\frac{96}{360} \right)}{1 + \left(52 \cdot \left(\frac{96}{360} \right) \right)} \right)$$

12) Premio a termine annualizzato Formula

Formula

Esempio

Valutare la formula 

$$p = \left(\left(\frac{F_R - S}{S} \right) \cdot \left(\frac{360}{n} \right) \right) \cdot 100$$

$$12.1212 = \left(\left(\frac{102 - 99}{99} \right) \cdot \left(\frac{360}{90} \right) \right) \cdot 100$$

13) Rapporto di copertura Formula

Formula

Esempio

Valutare la formula 

$$\Delta = \frac{HV}{TPV}$$

$$0.65 = \frac{6500}{10000}$$

14) Rapporto di copertura ottimale Formula

Formula

Esempio

Valutare la formula 

$$\Delta_{\text{optimal}} = \left(\frac{\sigma_s}{\sigma_f} \right) \cdot \rho_{s/f}$$

$$0.1667 = \left(\frac{0.05}{0.09} \right) \cdot 0.3$$

15) Rho (Opzioni Greco) Formula

Formula

Esempio

Valutare la formula 

$$\rho = \frac{\Delta V}{\Delta r}$$

$$1.6667 = \frac{2.5}{1.5}$$

16) Saldo del conto capitale Formula

Formula

Esempio

Valutare la formula 

$$BOP_{\text{capital}} = NNP_{S/D} + NFA + NCT_r$$

$$121000 = 45000 + 40000 + 36000$$

17) Saldo del conto corrente Formula

Formula

Esempio

Valutare la formula 

$$CAB = X - I + NY + NCT$$

$$220000 = 500000 - 400000 + 20000 + 100000$$



18) Saldo del conto finanziario Formula

Formula

$$BOF = NDI + NPI + A + E$$

Esempio

$$140000 = 60000 + 35000 + 30000 + 15000$$

Valutare la formula 

19) Theta Formula

Formula

$$\theta = - \frac{\Delta V}{\Delta t}$$

Esempio

$$-5 = - \frac{2.5}{0.5}$$

Valutare la formula 

20) Vega (Opzioni Greco) Formula

Formula

$$v = \frac{\Delta V}{\Delta \sigma}$$

Esempio

$$2 = \frac{2.5}{1.25}$$

Valutare la formula 



Variabili utilizzate nell'elenco di Finanza internazionale Formule sopra

- $\% \Delta$ Cambiamento nel Delta
- **A** Finanziamento patrimoniale
- **AG** Guadagno medio durante il periodo di aumento
- **AL** Perdita media durante il periodo di ribasso
- **BA_{spread}** Differenza tra domanda e offerta
- **BOF** Saldo del conto finanziario
- **BOP_{capital}** Saldo del conto capitale
- **C_t** Prezzo dell'opzione call
- **CAB** Saldo del conto corrente
- **E** Errori e omissioni
- **e_o** Tasso di cambio spot attuale
- **e_t** Tasso spot nel futuro
- **ES_{t+1}** Tasso spot futuro previsto
- **F** Tasso di cambio a termine
- **F_R** Tasso a termine
- **FCS** Dimensione del contratto futures
- **FRA_p** Pagamento della FRA
- **HV** Valore di copertura
- **I** Importazioni
- **n** N. di giorni
- **n_m** N. di mesi
- **n_{ur}** Numero di giorni nel tasso sottostante
- **NCT** Trasferimenti correnti netti
- **NCT_r** Trasferimenti netti di capitale
- **NDI** Investimenti diretti netti
- **NFA** Attività non finanziarie
- **NNP_{S/D}** Eccedenze o deficit del netto non prodotto
- **NP** Principale nozionale
- **NPH** Numero di posizioni coperte
- **NPI** Investimento netto di portafoglio
- **NSOW** Numero di titoli per warrant di opzione
- **NY** Reddito netto all'estero
- **OC** Numero ottimale di contratti
- **OPR** Opzione Premio
- **p** Premio a termine annualizzato



- **P_{ask}** Chiedere il prezzo
- **P_{bid}** Prezzo di offerta
- **p_t** Prezzo dell'opzione put
- **PP** Prezzo d'acquisto
- **PS** Sicurezza dei prezzi
- **r_d** Tasso di interesse domestico
- **r_{exp}** Tasso sottostante alla scadenza
- **r_f** Tasso di interesse estero
- **R_f** Tasso di rendimento privo di rischio
- **r_{forward}** Tasso del contratto a termine
- **RSI** Indice di forza relativa
- **S** Tasso spot
- **S_t** Prezzo spot dell'asset sottostante
- **SOW** Garanzia di opzione su azioni
- **TPV** Valore totale della posizione
- **X** Esportazioni
- **X_s** Prezzo d'esercizio
- **Γ** Gamma
- **Δ** Rapporto di copertura
- **Δ_{optimal}** Rapporto di copertura ottimale
- **ΔE** Variazione del tasso di cambio
- **Δr** Variazione del tasso di interesse
- **ΔS** Variazione del prezzo dell'asset sottostante
- **Δt** Cambiamento nel tempo alla scadenza
- **ΔV** Modifica dell'opzione Premium
- **Δσ** Variazione della volatilità dell'asset sottostante
- **θ** Theta
- **v** Vega
- **ρ** Rho
- **ρ_{s/f}** Correlazione delle variazioni dei prezzi spot e future
- **σ_f** Deviazione standard delle variazioni dei prezzi dei futures
- **σ_s** Deviazione standard delle variazioni del prezzo spot



Scarica altri PDF Importante Finanziario

- [Importante Bancario Formule](#) 
- [Importante Equità Formule](#) 
- [Importante Gestione delle istituzioni finanziarie Formule](#) 
- [Importante Modellazione e valutazione finanziaria Formule](#) 
- [Importante Titoli a reddito fisso Formule](#) 
- [Importante Investimento bancario Formule](#) 
- [Importante Fusioni e acquisizioni Formule](#) 
- [Importante Finanza pubblica Formule](#) 
- [Importante Gestione finanziaria strategica Formule](#) 
- [Importante Imposta Formule](#) 

Prova i nostri calcolatori visivi unici

-  [Percentuale del numero](#) 
-  [Calcolatore mcm](#) 
-  [Frazione semplice](#) 

Per favore CONDIVIDI questo PDF con qualcuno che ne ha bisogno!

Questo PDF può essere scaricato in queste lingue

[English](#) [Spanish](#) [French](#) [German](#) [Russian](#) [Italian](#) [Portuguese](#) [Polish](#) [Dutch](#)

7/9/2024 | 6:40:44 AM UTC

