



Formules Exemples avec unités

Liste de 20 Important La finance internationale Formules

1) Effet Fischer international utilisant les taux spot Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻

2) Effet Fisher international utilisant les taux d'intérêt Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻

3) Gain FRA (position longue) Formule ↻

Formule

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

Évaluer la formule ↻

Exemple

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

4) Gamma Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻



5) indice de force relative Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻

6) Nombre optimal de contrats Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻

7) Option Prime Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻

8) Parité des taux d'intérêt couverts Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻

9) Parité des taux d'intérêt non couverte Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻

10) Parité put-call Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻



11) Prime à terme annualisée Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻

12) Ratio de couverture Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻

13) Ratio de couverture optimal Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻

14) Rho (Options grecques) Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻

15) Solde du compte courant Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻

16) Solde du compte de capital Formule ↻

Formule

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

Exemple

$$121000 = 45000 + 40000 + 36000$$

Évaluer la formule ↻

17) Solde du compte financier Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻

18) Spread acheteur-vendeur Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻



19) Thêta Formule

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule 

20) Vega (options grecques) Formule

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule 



Variables utilisées dans la liste de La finance internationale Formules ci-dessus

- $\% \Delta$ Changement dans Delta
- **A** Financement d'actifs
- **AG** Gain moyen pendant la période de hausse
- **AL** Perte moyenne pendant la période de baisse
- **BA_{spread}** Spread acheteur-vendeur
- **BOF** Solde du compte financier
- **BOP_{capital}** Solde du compte de capital
- **C_t** Prix de l'option d'achat
- **CAB** Solde du compte courant
- **E** Erreurs et omissions
- **e_o** Taux de change au comptant actuel
- **e_t** Taux au comptant à l'avenir
- **ES_{t+1}** Taux au comptant futur attendu
- **F** Taux de change à terme
- **F_R** Taux à terme
- **FCS** Taille du contrat à terme
- **FRA_p** Gain FRA
- **HV** Valeur de couverture
- **I** Importations
- **n** Nombre de jours
- **n_m** Nombre de mois
- **n_{ur}** Nombre de jours dans le taux sous-jacent
- **NCT** Transferts courants nets
- **NCT_r** Transferts nets de capitaux
- **NDI** Investissement direct net
- **NFA** Actifs non financiers
- **NNP_{S/D}** Excédents ou déficits nets non produits
- **NP** Principal notionnel
- **NPH** Nombre de positions couvertes
- **NPI** Investissement net de portefeuille
- **NSOW** Nombre de titres par bon de souscription d'option
- **NY** Revenu net à l'étranger
- **OC** Nombre optimal de contrats
- **OPR** Option Prime



- **p** Prime à terme annualisée
- **P_{ask}** Demander le prix
- **P_{bid}** Prix de l'offre
- **p_t** Prix de l'option de vente
- **PP** Prix d'achat
- **PS** Sécurité des prix
- **r_d** Taux d'intérêt national
- **r_{exp}** Taux sous-jacent à l'expiration
- **r_f** Taux d'intérêt étranger
- **R_f** Taux de rendement sans risque
- **r_{forward}** Taux du contrat à terme
- **RSI** indice de force relative
- **S** Tarif au comptant
- **S_t** Prix au comptant de l'actif sous-jacent
- **SOW** Bon de souscription d'options sur actions
- **TPV** Valeur totale de la position
- **X** Exportations
- **X_s** Prix d'exercice
- **Γ** Gamma
- **Δ** Ratio de couverture
- **Δ_{optimal}** Ratio de couverture optimal
- **ΔE** Changement du taux de change
- **Δr** Changement du taux d'intérêt
- **ΔS** Variation du prix de l'actif sous-jacent
- **Δt** Modification du délai jusqu'à l'échéance
- **ΔV** Modification de la prime d'option
- **Δσ** Changement de volatilité de l'actif sous-jacent
- **θ** Thêta
- **v** Véga
- **ρ** Rho
- **ρ_{s/f}** Corrélation des changements dans les prix au comptant et à terme
- **σ_f** Écart type des variations des prix à terme
- **σ_s** Écart type des modifications du prix au comptant



Téléchargez d'autres PDF Important Financier

- Important Bancaire Formules 
- Important Équité Formules 
- Important Gestion des institutions financières Formules 
- Important Modélisation financière et évaluation Formules 
- Important Titres à revenu fixe Formules 
- Important Banque d'investissement Formules 
- Important Fusions et acquisitions Formules 
- Important Finance publique Formules 
- Important Gestion financière stratégique Formules 
- Important Impôt Formules 

Essayez nos calculatrices visuelles uniques

-  Pourcentage du nombre 
-  Calculateur PPCM 
-  Fraction simple 

Veuillez PARTAGER ce PDF avec quelqu'un qui en a besoin !

Ce PDF peut être téléchargé dans ces langues

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

7/9/2024 | 6:40:30 AM UTC

