



## Fórmulas Exemplos com unidades

## Lista de 20 Importante Finanças Internacionais Fórmulas

### 1) Efeito Fischer Internacional usando taxas spot Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula

### 2) Efeito Fisher Internacional usando taxas de juros Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula

### 3) Gama Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula

### 4) Índice de Força Relativa Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula

### 5) Número ideal de contratos Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula



## 6) Oferta e pedido de spread Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula 

## 7) Opção Premium Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula 

## 8) Pagamento FRA (posição longa) Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula 

## 9) Paridade da taxa de juros coberta Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula 

## 10) Paridade descoberta da taxa de juros Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula 



## 11) Paridade Put-Call Fórmula ↻

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula ↻

## 12) Prêmio futuro anualizado Fórmula ↻

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula ↻

## 13) Rho (Opções Grego) Fórmula ↻

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula ↻

## 14) Saldo atual da conta Fórmula ↻

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula ↻

## 15) Saldo da conta de capital Fórmula ↻

Fórmula

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

Exemplo

$$121000 = 45000 + 40000 + 36000$$

Avaliar Fórmula ↻

## 16) Saldo da conta financeira Fórmula ↻

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula ↻

## 17) Taxa de hedge Fórmula ↻

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula ↻



## 18) Taxa de hedge ideal Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula 

## 19) Teta Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula 

## 20) Vega (Opções Grego) Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula 



## Variáveis usadas na lista de Finanças Internacionais Fórmulas acima

- $\% \Delta$  Mudança no Delta
- **A** Financiamento de ativos
- **AG** Ganho médio durante o período de alta
- **AL** Perda média durante o período de inatividade
- **BA<sub>spread</sub>** Oferta e pedido de spread
- **BOF** Saldo da conta financeira
- **BOP<sub>capital</sub>** Saldo da conta de capital
- **C<sub>t</sub>** Preço da opção de compra
- **CAB** Saldo atual da conta
- **E** Erros e omissões
- **e<sub>o</sub>** Taxa de câmbio à vista atual
- **e<sub>t</sub>** Taxa à vista no futuro
- **ES<sub>t+1</sub>** Taxa futura esperada à vista
- **F** Taxa de câmbio a termo
- **F<sub>R</sub>** Taxa futura
- **FCS** Tamanho do contrato futuro
- **FRA<sub>p</sub>** Pagamento FRA
- **HV** Valor de hedge
- **I** Importações
- **n** N° de dias
- **n<sub>m</sub>** N° de meses
- **n<sub>ur</sub>** Número de dias na taxa subjacente
- **NCT** Transferências Correntes Líquidas
- **NCT<sub>r</sub>** Transferências Líquidas de capital
- **NDI** Investimento direto líquido
- **NFA** Ativos Não Financeiros
- **NNP<sub>SD</sub>** Excedentes ou Déficits de Não Produzidos Líquidos
- **NP** Principal Nacional
- **NPH** Número de posições cobertas
- **NPI** Investimento líquido do portfólio
- **NSOW** Número de títulos por garantia de opção
- **NY** Lucro líquido no Exterior
- **OC** Número ideal de contratos
- **OPR** Opção Premium
- **p** Prêmio futuro anualizado



- $P_{ask}$  Pergunte o preço
- $P_{bid}$  Preço de oferta
- $p_t$  Preço da opção de venda
- $PP$  Preço de compra
- $PS$  Segurança de preço
- $r_d$  Taxa de juros interna
- $r_{exp}$  Taxa subjacente no vencimento
- $r_f$  Taxa de juros estrangeira
- $R_f$  Taxa de retorno livre de risco
- $r_{forward}$  Taxa de contrato a termo
- $RSI$  Índice de Força Relativa
- $S$  Taxa à vista
- $S_t$  Preço à Vista do Ativo Subjacente
- $SOW$  Garantia de opção de ações
- $TPV$  Valor total da posição
- $X$  Exportações
- $X_s$  Preço de exercício
- $\Gamma$  Gama
- $\Delta$  Taxa de hedge
- $\Delta_{optimal}$  Taxa de hedge ideal
- $\Delta E$  Mudança na taxa de câmbio
- $\Delta r$  Mudança na taxa de juros
- $\Delta S$  Mudança no preço do ativo subjacente
- $\Delta t$  Mudança no tempo até a maturidade
- $\Delta V$  Mudança na Opção Premium
- $\Delta \sigma$  Mudança na volatilidade do ativo subjacente
- $\theta$  Teta
- $v$  Vega
- $\rho$  Ró
- $\rho_{s/f}$  Correlação de mudanças nos preços à vista e futuros
- $\sigma_f$  Desvio padrão das mudanças no preço futuro
- $\sigma_s$  Desvio padrão de mudanças no preço spot



## Baixe outros PDFs de Importante Financeiro

- [Importante Bancário Fórmulas](#) 
- [Importante Equidade Fórmulas](#) 
- [Importante Gestão de Instituições Financeiras Fórmulas](#) 
- [Importante Modelagem e Avaliação Financeira Fórmulas](#) 
- [Importante Títulos de Renda Fixa Fórmulas](#) 
- [Importante Investimento bancário Fórmulas](#) 
- [Importante Fusões e aquisições Fórmulas](#) 
- [Importante Finanças públicas Fórmulas](#) 
- [Importante Gestão Financeira Estratégica Fórmulas](#) 
- [Importante Imposto Fórmulas](#) 

## Experimente nossas calculadoras visuais exclusivas

-  [Fração simples](#) 
-  [Calculadora MMC](#) 

Por favor, **COMPARTILHE** este PDF com alguém que precise dele!

## Este PDF pode ser baixado nestes idiomas

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

7/9/2024 | 6:40:49 AM UTC

