



Formuły Przykłady z Jednostkami

Lista 14 Ważny Zarządzanie rynkiem Forex Formuły

1) Dystrybucja skumulowana druga Formuła ↻

Formuła

$$D_2 = D_1 - v_{us} \cdot \sqrt{t_s}$$

Przykład

$$57.5 = 350 - 195 \cdot \sqrt{2.25}$$

Oceń formułę ↻

2) Dystrybucja skumulowana pierwsza Formuła ↻

Formuła

$$D_1 = \frac{\ln\left(\frac{P_c}{K}\right) + \left(R_f + \frac{v_{us}^2}{2}\right) \cdot t_s}{v_{us} \cdot \sqrt{t_s}}$$

Przykład

$$146.2577 = \frac{\ln\left(\frac{440}{90}\right) + \left(0.30 + \frac{195^2}{2}\right) \cdot 2.25}{195 \cdot \sqrt{2.25}}$$

Oceń formułę ↻

3) Kurs terminowy Formuła ↻

Formuła

$$F_o = Sp \cdot \ln\left((r_d - r_f) \cdot T\right)$$

Przykład

$$40.8641 = 21 \cdot \ln\left((0.90 - 0.20) \cdot 10\right)$$

Oceń formułę ↻

4) Model trójczynnikowy Famy-Francuza Formuła ↻

Formuła

$$R_{exc} = \alpha + \beta_F \cdot (R_{mkt} - R_f) + (s_i \cdot SMB + h_{ml} + E_i)$$

Przykład

$$23.134 = 8 + 0.07 \cdot (6.5 - 0.30) + (2.5 \cdot 3.5 + 4.5 + 1.45)$$

Oceń formułę ↻

5) Model wyceny opcji Blacka-Scholesa-Mertona dla opcji kupna Formuła ↻

Formuła

$$C = P_c \cdot P_{normal} \cdot (D_1) - (K \cdot \exp(-R_f \cdot t_s)) \cdot P_{normal} \cdot (D_2)$$

Przykład

$$7568.2558 = 440 \cdot 0.05 \cdot (350) - (90 \cdot \exp(-0.30 \cdot 2.25)) \cdot 0.05 \cdot (57.5)$$

Oceń formułę ↻



6) Model wyceny opcji Blacka-Scholesa-Mertona dla opcji sprzedaży Formuła

Formuła

$$P = K \cdot \exp(-R_f \cdot t_s) \cdot (-D_2) - P_c \cdot (-D_1)$$

Oceń formułę 

Przykład

$$151365.1155 = 90 \cdot \exp(-0.30 \cdot 2.25) \cdot (-57.5) - 440 \cdot (-350)$$

7) Model wzrostu Gordona Formuła

Formuła

$$P_c = \frac{D}{RR - g}$$

Przykład

$$440 = \frac{22}{0.08 - 0.03}$$

Oceń formułę 

8) Parytet stóp procentowych Formuła

Formuła

$$k_f = Sp \cdot \left(\frac{1 + I_Q}{1 + I_B} \right)$$

Przykład

$$27.2519 = 21 \cdot \left(\frac{1 + 16}{1 + 12.1} \right)$$

Oceń formułę 

9) Rozmiar pozycji na rynku Forex Formuła

Formuła

$$Pf = \frac{A_E \cdot R_{f\%}}{S_{LP} \cdot P_{VF}}$$

Przykład

$$1200 = \frac{45 \cdot 4}{15 \cdot 0.01}$$

Oceń formułę 

10) Stopa procentowa Vasicka Formuła

Formuła

$$dr_t = a \cdot (b - r_t) \cdot dt + \sigma \cdot dW_t$$

Przykład

$$3675 = 12 \cdot (6 - 5) \cdot 50 \cdot 2 + 9 \cdot 50 \cdot 5.5$$

Oceń formułę 

11) Teoria parytetu siły nabywczej z wykorzystaniem inflacji Formuła

Formuła

$$E_f = \left(\frac{1 + I_h}{1 + I_f} \right) - 1$$

Przykład

$$0.0373 = \left(\frac{1 + 0.39}{1 + 0.34} \right) - 1$$

Oceń formułę 

12) Wewnętrzna wartość Formuła

Formuła

$$ITV = SP - BSV$$

Przykład

$$1.6 = 1.85 - 0.25$$

Oceń formułę 

13) Zapłata dla kupującego połączenie Formuła

Formuła

$$PCB = \max(0, S_T - X)$$

Przykład

$$3 = \max(0, 29 - 26)$$

Oceń formułę 



Formuła

$$Pft = \max (0, S_T - X) - c_0$$

Przykład

$$1.5 = \max (0, 29 - 26) - 1.5$$

Oceń formułę 



Zmienne użyte na liście Zarządzanie rynkiem Forex Formuły powyżej

- **a** Szybkość średniego odwrócenia
- **A_E** Kapitał konta
- **b** Średnia długoterminowa
- **BSV** Wartość podstawowa
- **C** Teoretyczna cena opcji kupna
- **c₀** Zadzwoń do Premium
- **d** Pochodne
- **D** Dywidenda na akcję
- **D₁** Dystrybucja skumulowana 1
- **D₂** Dystrybucja skumulowana 2
- **dr_t** Pochodna krótkiej stopy procentowej
- **E_f** Współczynnik kursu wymiany
- **E_i** Termin błędu
- **F₀** Kurs terminowy
- **g** Stała stopa wzrostu dywidendy
- **h_{ml}** Wrażliwość składnika aktywów na HML
- **I_B** Stopa procentowa waluty bazowej
- **I_Q** Stopa procentowa waluty kwotowanej
- **ITV** Wewnętrzna wartość
- **K** Cena wykonania opcji
- **k_f** Stała stawka forward
- **P** Teoretyczna cena opcji sprzedaży
- **P_C** Aktualna cena akcji
- **P_{normal}** Normalna dystrybucja
- **PCB** Zapłata dla kupującego połączenie
- **Pf** Rozmiar pozycji na rynku Forex
- **Pft** Zysk dla kupującego połączenie
- **r_d** Krajowa stopa procentowa
- **R_{f%}** Procent ryzyka na rynku Forex
- **r_f** Zagraniczna stopa procentowa
- **R_f** Stopa wolna od ryzyka
- **R_{mkt}** Zwrot na portfelu rynkowym

Stale, funkcje, miary użyte na liście Zarządzanie rynkiem Forex Formuły powyżej

- **Funkcje: exp**, exp(Number)
w przypadku funkcji wykładniczej wartość funkcji zmienia się o stały współczynnik przy każdej zmianie jednostki zmiennej niezależnej.
- **Funkcje: ln**, ln(Number)
Logarytm naturalny, znany również jako logarytm o podstawie e, jest funkcją odwrotną do naturalnej funkcji wykładniczej.
- **Funkcje: max**, max(a1, ..., an)
Maksimum funkcji to najwyższa wartość, jaką funkcja może wyprowadzić dla dowolnego możliwego wejścia.
- **Funkcje: sqrt**, sqrt(Number)
Funkcja pierwiastka kwadratowego to funkcja, która jako dane wejściowe przyjmuje liczbę nieujemną i zwraca pierwiastek kwadratowy z podanej liczby wejściowej.



- r_t Krótka stawka
- **Rexc** Nadwyżka zwrotu z aktywów
- **RR** Wymagana stopa zwrotu
- **S_{LP}** Zatrzymaj stratę w pipsach
- **S_T** Cena instrumentu bazowego w momencie wygaśnięcia
- **si** Wrażliwość aktywów na SMB
- **SMB** Mały Minus Duży
- **Sp** Kurs wymiany
- **SP** Cena akcji
- **t** Okres czasu
- **T** Czas na Dojrzałość
- **t_s** Czas do wygaśnięcia zapasów
- **v_{us}** Zmienne akcje bazowe
- **W_t** Losowe ryzyko rynkowe
- **X** Cena zadania
- **αi** Wersja alfa dotycząca konkretnych zasobów
- **β_F** Beta na rynku Forex
- **If** Inflacja za granicą
- **Ih** Inflacja w kraju macierzystym
- **P_{VF}** Wartość pipsa na rynku Forex
- **σ** Zmienność w czasie



Pobierz inne pliki PDF z kategorii Ważny Inwestycja

- [Ważny Bond Yield Formuły](#) 
- [Ważny Zarządzanie rynkiem Forex Formuły](#) 

Wypróbuj nasze unikalne kalkulatory wizualne

-  [Spadek procentowy](#) 
-  [NWD trzy liczby](#) 
-  [Pomnóż ułamek](#) 

UDOSTĘPNIJ ten plik PDF komuś, kto go potrzebuje!

Ten plik PDF można pobrać w tych językach

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

7/9/2024 | 6:18:54 AM UTC

